

华商稳固添利债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：2020年7月27日

报告公告日期：2020年8月5日

§1 重要提示

华商稳固添利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]961号文准予注册，自2015年2月17日起基金合同生效。本基金基金管理人为华商基金管理有限公司，本基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据市场环境的变化和基金运作情况，为保护基金份额持有人利益，基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华商稳固添利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会（以下简称“本次基金份额持有人大会”），审议《关于终止华商稳固添利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于2020年7月13日表决通过了《关于终止华商稳固添利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。基金管理人于2020年7月14日发布《关于华商稳固添利债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“决议生效公告”）。根据决议生效公告，2020年7月14日是本基金的最后运作日，自2020年7月15日起，本基金进入清算程序。

基金管理人华商基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金简称	华商稳固添利债券
基金主代码	000937
交易代码	000937
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月17日
基金最后运作日（2020年7月14日）份额总额	12,121,312.12份
投资目标	在合理控制风险的基础上，通过对债券积极主动地投资管理，追求以超越业绩基准的绝对收益为目标。
投资策略	本基金为债券型基金，不直接从二级市场购买股票、权证

	<p>等权益类资产，也不参与一级市场新股申购或增发新股。本基金在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采取积极主动地投资管理策略，通过定性与定量分析，对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估，对不同投资品种运用不同的投资策略，并充分利用市场的非有效性，把握各类套利的机会。在信用风险可控的前提下，寻求组合流动性与收益的最佳配比，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。</p> <p>具体投资策略详见基金合同。</p>	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+1.2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，但高于货币市场基金，属于较低风险收益水平的投资品种。	
基金管理人	华商基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华商稳固添利债券 A	华商稳固添利债券 C
下属分级基金的交易代码	000937	000938
报告期末下属分级基金的份额总额	7,400,653.32 份	4,720,658.80 份

§3 基金运作情况

本基金经中国证监会 2014 年 9 月 17 日证监许可[2014]961 号文注册，由基金管理人华商基金管理有限公司于 2015 年 1 月 22 日至 2015 年 2 月 13 日向社会公开募集，《基金合同》于 2015 年 2 月 17 日生效，募集规模为 834,705,583.69 份基金份额。

自 2015 年 2 月 17 日至 2020 年 7 月 14 日期间，本基金按《基金合同》正常运作。本基金基金管理人于 2020 年 6 月 16 日起至 2020 年 7 月 10 日以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，并于 2020 年 7 月 13 日表决通过了《关于终止华商稳固添利债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“《议案》”）。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》以及上述经基金份额持有人大会表决通过的《议案》的有关规定，2020 年 7 月 14 日是本基金的最后运作日，本基金自 2020 年 7 月 15 日起进入财产清算期。

§4 财务会计报告（经审计）

基金最后运作日资产负债表

会计主体：华商稳固添利债券型证券投资基金

报告截止日：2020年7月14日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日（2020年7月14日）
资 产：	
银行存款	1,475,747.60
结算备付金	128,371.55
存出保证金	704.44
应收证券清算款	10,244,875.28
应收利息	335.73
资产总计	11,850,034.60
负债和所有者权益	基金最后运作日（2020年7月14日）
负 债：	
应付赎回款	960,864.12
应付管理人报酬	3,399.10
应付托管费	971.19
应付销售服务费	708.07
其他负债	51,333.54
负债合计	1,017,276.02
所有者权益：	
实收基金	12,121,312.12
未分配利润	-1,288,553.54
所有者权益合计	10,832,758.58
负债和所有者权益总计	11,850,034.60

注：1、基金最后运作日2020年7月14日，基金份额总额为12,121,312.12份。A类基金份额净值0.902元，基金份额总额7,400,653.32份；C类基金份额净值0.881元，基金份额总额4,720,658.80份。

2、本基金财务报表按照中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协

会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华商稳固添利债券型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法、以及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定和允许的基金行业实务操作编制。

§5 清算情况说明

自 2020 年 7 月 15 日至 2020 年 7 月 27 日止清算期间,基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算,全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下:

5.1 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.2 资产处置情况

1、本基金最后运作日结算备付金为人民币 128,371.55 元,该款项基金管理人于 2020 年 7 月 27 日以自有资金垫付至本基金托管账户。

2、本基金最后运作日存出保证金为人民币 704.44 元,该款项由基金管理人于 2020 年 7 月 27 日以自有资金垫付至本基金托管账户。

3、本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 10,244,875.28 元,该款项已于 2020 年 7 月 15 日划入本基金托管账户。

4、本基金最后运作日应收利息为人民币 335.73 元,主要包括应收银行存款利息、应收结算备付金利息和应收存出保证金利息,该款项由基金管理人于 2020 年 7 月 27 日以自有资金垫付至本基金托管账户。

5.3 负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 960,864.12 元,已于 2020 年 7 月 15 日及 2020 年 7 月 16 日从本基金托管账户划付给基金份额持有人。2020 年 7 月 15 日确认的应付赎回款 1,496,547.54 元和应付转出款 48,707.08 元,已于 2020 年 7 月 17 日从本基金托管账户划付给基金份额持有人。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,399.10 元,该款项已于 2020

年 7 月 15 日从本基金托管账户支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 971.19 元，该款项已于 2020 年 7 月 15 日从本基金托管账户支付。

4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 708.07 元，该款项已于 2020 年 7 月 15 日从本基金托管账户支付。

5、本基金最后运作日其他负债为人民币 51,333.54 元，包括以下内容：

①应付赎回费及转出费为人民币 1,333.54 元，已于 2020 年 7 月 15 日、2020 年 7 月 16 日支付。

②应付清盘律师费 20,000.00 元，已于 2020 年 7 月 15 日从本基金托管账户支付；

③应付清盘会计师审计费 30,000.00 元，已于 2020 年 7 月 15 日从本基金托管账户中划出；

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2020 年 7 月 15 日 至 2020 年 7 月 27 日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	1,270.82
2、赎回费收入（注 2）	30.35
清算收入小计	1,301.17
二、清算费用	120.09
其他费用小计（注 3）	120.09
三、清算净收益	1,181.08

注 1：利息收入系计提的自 2020 年 7 月 15 日至 2020 年 7 月 27 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息。该款项基金管理人于 2020 年 7 月 27 日以自有资金垫付至本基金托管账户。

注 2：赎回费收入系于 2020 年 7 月 15 日确认的投资者赎回申请产生的归属于基金资产的赎回费收入。

注 3：清算费用是清算期间产品划付款项所产生的银行汇划费。按照《基金合同》的约定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	
一、最后运作日 2020 年 7 月 14 日基金净资产	10,832,758.58
加：清算期间净收益	1,181.08
减：基金净赎回金额（于 2020 年 7 月 15 日确认的投资者申购赎回申请）	1,545,284.97
二、2020 年 7 月 27 日基金净资产	9,288,654.69

截至本次清算期结束日 2020 年 7 月 27 日，本基金剩余财产为人民币 9,288,654.69 元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组将依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。清算终止日 2020 年 7 月 27 日至清算款划出日前一日银行存款、结算备付金、存出保证金产生的应收利息亦属份额持有人所有。以上利息均按实际适用的利率计算。

5.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时分配。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1. 《华商稳固添利债券型证券投资基金审计报告》；
2. 关于《华商稳固添利债券型证券投资基金清算报告》的法律意见。

6.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人的办公场所免费查阅。

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010-58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

华商稳固添利债券型证券投资基金
基金财产清算小组

2020 年 7 月 27 日