

淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：淳厚基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二五年四月一日

清算报告公告日：二〇二五年四月十七日

目录

1、 重要提示	3
2、 基金概况	3
2.1 基金基本情况	3
2.2 基金产品说明	4
3、 基金运作情况说明	4
4、 财务报告	5
资产负债表（已审计）	5
5、 清算情况	7
5.1 资产处置情况	7
5.2 负债清偿情况	7
5.3 清算期间的清算损益情况	8
5.4 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排	8
5.5 基金财产清算报告的告知安排	9
6、 备查文件目录	9
6.1 备查文件目录	9
6.2 存放地点	9
6.3 查阅方式	9

1、重要提示

淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金（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”）2022年10月17日证监许可（2022）2488号文注册募集，于2022年12月19日成立并正式运作。本基金的基金管理人为淳厚基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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《淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的有关规定，本基金已触发基金合同终止情形，本基金管理人将依据法律法规的规定及基金合同的约定履行基金财产清算程序并终止基金合同，此事项不需召开基金份额持有人大会。

根据基金管理人于2025年03月08日发布的《关于淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金自2025年03月08日起进入清算程序，由基金管理人淳厚基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、上会会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2025年03月08日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由上会会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	淳厚优加一年持有混合	
基金类型	混合型	
基金主代码	017107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年12月19日	
基金管理人	淳厚基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
基金最后运作日(2025年03月07日)基金份额总额	6,386,602.57份	
基金最后运作日(2025年03月07日)基金份额净值	1.1013	
基金合同存续期	不定期	
注册登记机构	淳厚基金管理有限公司	
下属分级基金的基金简称	淳厚优加一年持有混合A	淳厚优加一年持有混合C
下属分级基金的交易代码	017107	017108

基金最后运作日(2025年03月07日)下属分级基金的份额总额	3,239,020.89份	3,147,581.68份
---------------------------------	---------------	---------------

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险、保持资产流动性的基础上，通过大类资产配置，力争达到控制波动率、获取稳定收益的投资目标。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、债券投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 久期策略 (2) 收益率曲线策略 (3) 类属配置策略 (4) 信用债及资产支持证券策略 (5) 可转换债券策略 3、股票投资策略 4、港股投资策略 5、存托凭证投资策略 6、衍生品投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 股指期货投资策略 (2) 国债期货投资策略 (3) 股票期权投资策略 (4) 信用衍生品策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+经人民币汇率调整的中证港股通综合指数收益率×5%+中债综合全价（总值）指数收益率×80%
风险收益特征	<p>本基金属于混合型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型证券投资基金、高于债券型证券投资基金、货币市场基金。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

3、基金运作情况说明

本基金经中国证监会2022年10月17日证监许可〔2022〕2488号文注册募集，由基金管理人淳厚基金管理有限公司于2022年11月18日至2022年12月15日向社会公

开发行募集，基金合同于 2022 年 12 月 19 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总数为 208,459,977.98 份（含募集期间利息结转的份额）。自 2022 年 12 月 19 日至 2025 年 3 月 7 日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”约定：

“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本基金合同将终止并进行基金财产清算，且无需召开基金份额持有人大会。”

截至 2025 年 03 月 07 日日终，本基金的基金资产净值连续 50 个工作日低于 5000 万元人民币，已触发上述《基金合同》终止的情形，本基金管理人将按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议。

根据基金管理人于 2025 年 03 月 08 日发布的《关于淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金的最后运作日为 2025 年 03 月 07 日，并于 2025 年 03 月 08 日进入清算程序。

4、 财务报告

资产负债表（已审计）

会计主体：淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2025年03月07日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	2025年03月07日 (基金最后运作日)
资 产：	
货币资金	13,343,209.70
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	1,195,023.59
其中：股票投资	574,258.27
基金投资	-
债券投资	620,765.32
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-

买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	161,826.73
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	14,700,060.02
负债和净资产	2025年03月07日 (基金最后运作日)
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	7,556,435.69
应付管理人报酬	3,714.23
应付托管费	742.84
应付销售服务费	393.79
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	105,001.35
负债合计	7,666,287.90
净资产：	
实收基金	6,386,602.57

其他综合收益	-
未分配利润	647,169.55
净资产合计	7,033,772.12
负债和净资产总计	14,700,060.02

5、 清算情况

本基金的清算期间为2025年03月08日至2025年04月01日。基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序对本基金的资产、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 资产处置情况

截至清算结束日（2025年04月01日），各项资产清算情况如下：

（1）本基金最后运作日货币资金为人民币13,343,209.70元，其中托管账户银行存款本金为13,008,782.95元，应计银行存款利息为1,258.67元，券商保证金账户本金为331,937.13元，应计券商保证金利息为1,230.95元。截至清算结束日，托管账户银行存款本金为6,909,000.06元，应计银行存款利息为708.12元，券商保证金账户本金为零元，应计券商保证金利息为零元。

（2）本基金最后运作日交易性金融资产余额为人民币1,195,023.59元，其中债券投资为620,765.32元，股票投资为574,258.27元。以上资产于清算期间全部处置变现，截至清算结束日，交易性金融资产余额为零元。

（3）本基金最后运作日应收清算款余额为人民币161,826.73元，截至清算结束日，该项清算款已全部交收，余额为零元。

5.2 负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币3,714.23元，该款项已于清算期间完成支付。

（2）本基金最后运作日应付托管费为人民币742.84元，该款项已于清算期间完成支付。

（3）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币393.79元，该款项已于清算期间完成支付。

（4）本基金最后运作日应付赎回款为人民币7,556,435.69元，该款项已于清算期间完成支付。

（5）本基金最后运作日其他负债金额为人民币105,001.35元。分别为已计提尚未支付的审计费15,030.60元，信息披露费80,000.00元，中债登账户维护费4,500.00元，上清所账户维护费4,500.00元，上清所证书查询费300.00元以及应付银行间交易费用670.75元。上述所有款项已于清算期间完成支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2025年03月08日至 2025年04月01日 (清算期间)
一、清算收益	-9,178.10
1. 利息收入(注1)	2,034.03
2. 投资收益(注2)	159,432.89
3. 公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-170,645.02
二、清算费用	486.41
1. 其他费用(注3)	486.41
三、清算收益总额(损失以“-”填列)	-9,664.51
减: 所得税费用	-
四、清算净收益(损失以“-”填列)	-9,664.51

注 1: 利息收入系本基金清算期间的银行存款利息收入, 券商保证金利息收入。

注 2: 投资收益系本基金清算期间债券投资收益以及股票投资收益。

注 3: 其他费用系本基金清算期间支付的汇划手续费及港股通证券组合费。

5.4 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日(2025年03月07日)基金净资产	7,033,772.12
加: 自(2025年03月08日)至(2025年04月01日)止清算期间净收益(损失以“-”填列)	-9,664.51
减: 清算期间确认的最后运作日净赎回金额(含费用)	114,399.43
二、清算结束日(2025年04月01日)基金净资产	6,909,708.18

注: 资产处置及负债清偿后, 截至本次清算期结束日2025年04月01日, 本基金剩余财产为人民币6,909,708.18元, 根据本基金的基金合同, 本基金将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、缴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。

自本次清算期起始日2025年03月08日至清算款划出前一日产生的银行存款利息归基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由基金份额持有人承担。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，尚未结息的利息将由基金管理人以自有资金垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

5.5 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后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

6、 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- (1) 《淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 上海市通力律师事务所关于《淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

6.2 存放地点

淳厚基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区民生路1299号丁香国际大厦西塔7楼

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-000-9738

淳厚优加回报一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组
二〇二五年四月十七日