

广发稳润一年持有期混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日期：2025年12月24日

报告公告日期：2026年1月30日

目录

1. 重要提示	2
2. 基金概况	3
3. 基金运作情况说明	5
4. 财务报告	6
5. 清算事项说明	7
6. 备查文件目录	10

1. 重要提示

广发稳润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证监许可〔2022〕2493号文准予注册，于2023年1月18日成立并正式运作。本基金基金管理人为广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《广发稳润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》约定：“《基金合同》生效后，连续二十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5000万元人民币情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续五十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。”截至2025年11月27日日终，本基金的基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元人民币，触发《基金合同》终止的上述情形，基金管理人将终止《基金合同》，并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。2025年11月27日为本基金的最后运作日，清算期间为自2025年11月28日至2025年12月24日，2025年12月24日为清算期间结束日。

由基金管理人广发基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和广东广信君达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，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，广东广信君达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	广发稳润一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	广发稳润一年持有期混合
基金主代码	017096
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年1月18日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
最后运作日（2025年11月27日） 基金份额总额	19,103,449.40份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	具体包括：1. 大类资产配置；2. 债券投资策略；3. 股票投资策略；4. 金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+人民币计价的恒生指数收益率×5%+中证全债指数收益率×80%
风险收益特征	<p>本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金若投资于港股通标的股票，会面临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，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香</p>

	港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。
--	--------------------------------------------

3. 基金运作情况说明

广发稳润一年持有期混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可（2022）2493号《关于准予广发稳润一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《广发稳润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》公开募集，募集时间为2022年12月28日至2023年1月16日，并于2023年1月18日正式成立。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定期，募集资金总额为人民币410,168,885.15元。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《广发稳润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》约定：“《基金合同》生效后，连续二十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5000万元人民币情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续五十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。”截至2025年11月27日日终，本基金的基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元人民币，触发《基金合同》终止的上述情形，基金管理人将终止《基金合同》，并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。详见基金管理人发布的《关于广发稳润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》。本基金最后运作日为2025年11月27日，自2025年11月28日起进入基金财产清算程序。

4. 财务报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：广发稳润一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2025年11月27日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2025年11月27日
资产：	
货币资金	3,890,830.98
结算备付金	1,187,808.83
存出保证金	4,171.64
交易性金融资产	15,215,124.97
其中：股票投资	3,703,695.44
债券投资	11,511,429.53
买入返售金融资产	6,000,000.00
应收清算款	3,174,386.45
应收股利	1,497.60
应收申购款	100.00
资产总计	29,473,920.47
负债：	
应付赎回款	8,728,015.56
应付管理人报酬	18,889.11
应付托管费	4,857.21
应付销售服务费	3,051.65
应交税费	3.51
其他负债	63,514.23
负债合计	8,818,331.27
净资产：	
实收基金	19,103,449.40
未分配利润	1,552,139.80
净资产合计	20,655,589.20
负债和净资产总计	29,473,920.47

注1：报告截止日2025年11月27日（基金最后运作日），本基金A类基金份额单位净值为1.0858元，C类基金份额单位净值为1.0720元，A类基金份额总额为12,858,937.55份，C类基金份额总额为6,244,511.85份。

注2：本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产、负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

5. 清算事项说明

根据《广发稳润一年持有期混合型证券投资基金基金合同》约定：“《基金合同》生效后，连续二十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 万元人民币情形的，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续五十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。”截至 2025 年 11 月 27 日日终，本基金的基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元人民币，触发《基金合同》终止的上述情形，基金管理人将终止《基金合同》，并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。

2025 年 11 月 27 日为本基金的最后运作日。本基金的清算期间为自 2025 年 11 月 28 日至 2025 年 12 月 24 日止（以下简称“清算期间”），2025 年 12 月 24 日为本基金的清算期间结束日。

于清算期间，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 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日货币资金为人民币 3,890,830.98 元，其中银行存款本金为人民币 3,886,915.69 元，银行存款应计利息为人民币 3,915.29 元，上述银行存款应计利息已于 2025 年 12 月 24 日前划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 1,187,808.83 元，为上海证券交易所的最低备付金本金及其应计利息、期货备付金本金及其应计利息、沪港通备付金的本金及其应计利息和沪港通预付款的应计利息；其中上海证券交易所的最低备付金本金人民币 83,230.85 元、期货备付金本金人民币 273,008.58 元以及沪港通备付金本金人民币 512,343.44 元已于 2025 年 12 月 24 日前划入托管账户，剩余部分将于清算结束后划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 4,171.64 元，为上海证券交易所的结算保证金本金及其应计利息、深圳证券交易所的结算保证金本金及其应计利息和沪港通风控资金的应计利息，已于 2025 年 12 月 24 日前划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 15,215,124.97 元，为股票投资与债券投资，其中股票投资成本为人民币 3,528,659.28 元，最后运作日估值为人民币 3,703,695.44 元；债券投资成本为人民币 11,392,174.00 元，最后运作日应计利息为人民币 114,849.53 元，最后运作日估值为人民币 11,511,429.53 元。本基金所持交易性金融资产均已于 2025 年 12 月 24 日前完成变现，并于 2025 年 12 月 24 日前划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日买入返售金融资产为人民币 6,000,000.00 元，已于 2025 年 12 月 24 日前

到期，并于2025年12月24日前划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收股利为人民币1,497.60元，将于清算结束后划入托管账户。

(7) 本基金最后运作日应收申购款为人民币100.00元，已于2025年12月24日前划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币8,728,015.56元，该款项已于2025年12月24日前支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币18,889.11元，该款项已于2025年12月24日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币4,857.21元，该款项已于2025年12月24日前支付完毕。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币3,051.65元，该款项已于2025年12月24日前支付完毕。

(5) 本基金最后运作日应付税费为人民币3.51元，该款项已于2025年12月24日前支付完毕。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币63,514.23元，包括应付赎回费人民币43.00元、应付交易费用人民币2,264.90元、预提证券时报信息披露费人民币45,343.69元、预提中债登账户维护费人民币2,836.78元、预提上清所账户维护费人民币2,836.78元、预提上清所账户查询费人民币189.08元、预提律师费人民币5,000.00元及预提审计费人民币5,000.00元。其中应付赎回费已于2025年12月24日前支付完毕，其余款项将于2025年12月24日后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2025年11月28日 至2025年12月24日 止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	2,872.36
投资收益（注2）	260,278.08
公允价值变动损益（注3）（损失以“-”填列）	-179,442.16
二、费用	
其他费用（注4）	13,967.50
税金及附加	0.03
三、清算期间净收益	69,740.75

注1：利息收入系清算期间银行存款、结算备付金、存出保证金以及买入返售金融资产所产生的利息收入。

注2：投资收益系清算期间债券投资产生利息收入和差价收入、股票投资产生的股利收入和差价收入以及交易费用。

注3：公允价值变动损益系清算期间股票投资和债券投资产生的公允价值变动，以及清算期间处置部分持有的股票投资和债券投资，同时将原计入该股票投资和债券投资的公允价值变动转出至投资收益的金额。

注4：其他费用系清算期间所产生的银行汇划费、律师费、审计费、上海清算所账户查询费、上海清算所账户维护费、中央国债登记结算有限责任公司账户维护费以及证券组合费。

5.4 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	金额
一、最后运作日基金净资产	20,655,589.20
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	69,740.75
减：基金净赎回金额（于清算期间确认的最后运作日赎回申请）	8,560,755.10
二、清算结束日基金净资产	12,164,574.85

于本次清算结束日2025年12月24日，本基金剩余财产为人民币12,164,574.85元。本基金剩余财产中包含尚未收到的股票现金股利为人民币1,497.60元，该股票现金股利已于2026年1月5日收回。根据《基金合同》约定，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资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。

6. 备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 《广发稳润一年持有期混合型证券投资基金清算审计报告》

6.1.2 《关于广发基金管理有限公司广发稳润一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算的法律意见书》

6.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

广发稳润一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二六年一月三十日