

# 凯石浩品质经营混合型证券投资基金 第二次清算报告

基金管理人：凯石基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年1月21日

清算报告公告日：2021年1月22日

## 一、重要提示

凯石浩品质经营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”)证监许可【2019】606号文准予注册,于2019年5月27日成立并正式运作。本基金基金管理人为凯石基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”),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《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《凯石浩品质经营混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)等有关规定,“《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60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当根据基金合同约定进入清算程序并终止,而无需召开基金份额持有人大会。”截至2020年10月29日日终,本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形,根据基金合同约定,本基金满足基金合同终止条件,已于2020年10月30日进入财产清算程序。

本基金管理人已于2020年10月31日就本基金基金合同终止及进入基金财产清算程序的事宜进行了公告,详见《关于凯石浩品质经营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》。

基金管理人凯石基金管理有限公司、基金托管人招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于2020年10月30日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序,本基金第一次清算已经由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

本基金首次清算期间为2020年10月30日至2020年11月13日。本基金的基金管理人于2020年11月20日对《凯石浩品质经营混合型证券投资基金清算报告》进行了公告,并于2020年11月24日支付了第一次清算款。

本次清算为本基金第二次清算,清算期间为2020年11月14日至2021年1月4日。本清算报告已经基金托管人复核,在经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计、上海源泰律师事务所出具法律意见书后,已报中国证券监督管理委员会备案。

## 二、基金概况

## 1、基金基本情况

基金名称	凯石浩品质经营混合型证券投资基金	
基金简称	凯石浩品质经营混合	
基金主代码	007399	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年5月27日	
基金管理人	凯石基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
第二次清算结束日（2021年1月4日）基金份额总额	69,288.38份	
下属分级基金的基金简称：	凯石浩品质经营混合A	凯石浩品质经营混合C
下属分级基金的交易代码：	007399	007400
第二次清算结束日（2021年1月4日）下属分级基金的份额总额	69,096.25份	192.13份

## 2、基金产品说明

投资目标	在合理控制投资组合风险的前提下，主要通过运用品质经营策略优选股票构建投资组合，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债总全价指数收益率×30%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

## 三、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：凯石浩品质经营混合型证券投资基金

报告截止日：2021年1月4日（第二次清算结束日）

单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	49,056.84	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产		卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	
基金投资		应付托管费	
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	0.41	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	
其他资产		负债合计	
		所有者权益：	
		实收基金	69,288.38
		未分配利润	-20,231.13
		所有者权益合计	49,057.25
资产合计：	49,057.25	负债与持有人权益总计：	49,057.25

注：基金第二次清算结束日2021年1月4日，凯石浩品质经营混合A类份额单位净值为0.7081元，份额为69,096.25份，资产净值为48,924.18元。凯石浩品质经营混合C类份额单位净值为0.6926元，份额为192.13份，资产净值为133.07元。

## 四、基金财产分配

由于本基金于 2020 年 11 月 13 日（第一次清算结束日）仍持有限售股票导致部分资产尚未变现，故需进行第二次清算。限售股票已于 2021 年 1 月 4 日全部卖出变现。

本次清算为第二次清算，清算期间为 2020 年 11 月 14 日至 2021 年 1 月 4 日，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：

截至本次清算期结束日（2021 年 1 月 4 日）各项资产负债清算情况如下：

## 1、资产处置情况

(1) 本次清算期结束日银行存款为人民币 49,056.84 元；

(2) 本次清算期结束日应收利息为人民币 0.41 元，为券商资金户存款利息；应收利息于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清。

## 2、负债清偿情况

本次清算期结束日无应付费用。

## 3、清算期间损益情况

第二次清算期间损益情况		单位：人民币元
项目		
一、清算期间收入		
1. 利息收入（注 1）		52.11
2. 公允价值变动损益（注 2）		-12,034.50
3. 投资收益（注 2）		4,887.25
清算期间收入小计①		-7,095.14
二、清算期间费用		
1. 交易费用（注 2）		88.59

清算期间费用小计②	88.59
三、清算期间净收益①-②	-7,183.73

注1：存款利息收入为自2020年11月14日至2021年1月4日期间的活期存款利息、券商资金户存款利息。

注2：公允价值变动损益、投资收益以及交易费用均由持有的流通受限的交易性金融资产持有期间和变现时产生。

#### 4、资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、第一次清算结束日2020年11月13日基金净资产	586,902.58
加：第二次清算期间净收益（损失以“-”填列）	-7,183.73
减：第一次清算支付金额	530,661.60
二、2021年1月4日基金净资产	49,057.25

资产处置及负债清偿后，于2021年1月4日本基金剩余财产为人民币49,057.25元，根据本基金的基金合同约定，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。

2021年1月4日至最后一次清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算，为加快清盘进程，由基金管理人先行垫付。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

#### 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书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

### 五、备查文件目录

#### 1、备查文件目录

(1)《上海源泰律师事务所关于凯石浩品质经营混合型证券投资基金第二次清算事宜之法律意见》

(2) 《凯石浩品质经营混合型证券投资基金 2020 年 10 月 30 日（基金最后运作日次日）至 2021 年 1 月 4 日（基金第二次清算结束日）止期间的财务报表及审计报告》

2、存放地点 基金管理人的办公住所。

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。

凯石浩品质经营混合型证券投资基金财产清算小组

2021 年 1 月 21 日