

创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

一、重要提示

创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金（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 2020 年 1042 号《关于准予创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册。由创金合信基金管理有限公司按照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期，募集期间为 2020 年 8 月 21 日到 2020 年 8 月 25 日止，设立募集（不包括认购资金利息）人民币 11,040,824.36 元，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）第 2000468 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2020 年 8 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 11,041,174.80 份，其中认购资金利息折合 350.44 份。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”及“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”“二、《基金合同》的终止事由”的约定：基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。根据上述约定，截至 2023 年 8 月 27 日日终，本基金的基金资产净值低于二亿元，已触发基金合同终止事由，将根据《基金合同》规定进入基金财产清算程序并终止《基金合同》，不需召开基金份额持有人大会。

本基金于 2023 年 8 月 28 日在指定媒介就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告，详见《关于创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金从 2023 年 8 月 28 日起进入清算期，由基金管理人创金合信基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市锦天城（深圳）律师事务所于 2023 年 8 月 28 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市锦天城（深圳）律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金名称：创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金（其中 A 类份额基金简称：创金合信港股通大消费精选股票 A；基金代码：009733；C 类份额基金简称：创金合信港股通大消费精选股票 C；基金代码：009734）

2、基金类型：股票型证券投资基金

3、基金托管人：兴业银行股份有限公司

4、基金运作方式：契约型开放式

5、投资目标：本基金精选 A 股及港股市场大消费主题行业中的优质公司，在合理控制风险的前提下，通过积极的主动管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。

6、风险收益特征：本基金为股票型基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还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以及汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

7、基金发售时间：2020 年 8 月 21 日到 2020 年 8 月 25 日

8、基金合同生效日：2020 年 8 月 27 日

三、财务会计报告

资产负债表（已审计）

会计主体：创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金

基金最后运作日：2023 年 8 月 27 日

单位：人民币元

资产	基金最后运作日：2023 年 8 月 27 日
----	-------------------------

资 产：	
银行存款	1,782,656.75
结算备付金	591,120.27
存出保证金	30,015.41
交易性金融资产	10,577,228.60
其中：股票投资	10,577,228.60
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	770,206.47
应收股利	27,426.16
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	13,778,653.66
负债和净资产	基金最后运作日：2023年8月27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	-
应付证券清算款	0.04
应付赎回款	962,495.14
应付管理人报酬	13,672.07
应付托管费	2,278.70

应付销售服务费	4,934.78
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	41,407.56
负债合计	1,024,788.29
净资产：	
实收基金	21,905,236.59
未分配利润	-9,151,371.22
净资产合计	12,753,865.37
负债和净资产总计	13,778,653.66

注：1、基金最后运作日 2023 年 8 月 27 日，A 类基金份额净值 0.5895 元，C 类基金份额净值 0.5772 元，基金份额总额 21,905,236.59 份，其中 A 类基金份额 9,001,504.54 份，C 类基金份额 12,903,732.05 份。

2、本财务报告已经由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师叶云晖、刘西茜签字出具了毕马威华振审字第 2309745 号的无保留意见的审计报告。

四、基金财产分配

自 2023 年 8 月 28 日至 2023 年 10 月 24 日止为本次清算期间，基金财产清算小组对本基金的基金财产进行清算，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：

（一）清算费用

按照《基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（二）资产清算情况

截至本次清算结束日（2023年10月24日），部分资产尚未收回，为维护基金份额持有人利益并提高清算效率，基金管理人以自有资金对其中部分资产进行垫付。各项资产清算情况如下：

- 1、本基金最后运作日银行存款余额为人民币 1,782,656.75 元（含银行存款应计利息 1,904.56 元），截止本次清算结束日，银行存款余额为人民币 9,102,148.76 元（含银行存款应计利息 2,387.97 元）。
- 2、本基金最后运作日结算备付金为人民币 591,120.27 元（含结算备付金应计利息 3.15 元），存出保证金为人民币 30,015.41 元（含存出保证金应计利息 5.05 元），截止本次清算结束日，结算备付金为人民币 117,461.76 元（含结算备付金应计利息 1.75 元），存出保证金为人民币 1,723.23 元（含存出保证金应计利息 1.02 元）。
- 3、本基金最后运作日持有的股票投资市值共计人民币 10,577,228.60 元，已变现完毕

（三）负债清偿情况

- 1、本基金 2023 年 8 月 27 日（最后运作日）应付赎回款为人民币 962,495.14 元，该款项已于 2023 年 8 月 30 日支付完毕。
2023 年 8 月 28 日（清算起始日）至 2023 年 10 月 24 日（清算结束日）期间，应付赎回款增加人民币 564,742.07 元，该款项已于 2023 年 8 月 31 日支付完毕。
- 2、本基金 2023 年 8 月 27 日（最后运作日）应付管理人报酬为人民币 13,672.07 元，该款项会于实际支付时扣除。
- 3、本基金 2023 年 8 月 27 日（最后运作日）应付托管费为人民币 2,278.70 元，该款项已于 2023 年 9 月 5 日支付完毕。
- 4、本基金 2023 年 8 月 27 日（最后运作日）应付销售服务费为人民币 4,934.78 元，该款项已于 2023 年 9 月 4 日支付完毕。
- 5、本基金 2023 年 8 月 27 日（最后运作日）应付证券清算款为人民币 0.04 元，该款项已于 2023 年 8 月 28 日支付完毕。
- 6、本基金 2023 年 8 月 27 日（最后运作日）其他负债为人民币 41,407.56 元，为应付赎回费、银行间账户维护费、预提汇划费、应付交易费用、清盘审计费、律师费。其中，

应付赎回费为人民币 18.52 元，该款项已于 2023 年 8 月 30 日支付完毕；银行间账户维护费为人民币 4,500.00 元，该款项已于 2023 年 10 月 20 日支付完毕；预提汇划费为人民币 400.00 元，应付交易费用为人民币 11,489.04 元，清盘审计费为人民币 10,000.00 元，律师费为人民币 15,000.00 元，以上款项于实际支付时扣除。

2023 年 8 月 28 日（清算起始日）至 2023 年 10 月 24 日（清算结束日）期间应付赎回费增加人民币 21.20 元，该款项已于 2023 年 8 月 31 日支付完毕。

（四）清算期间的损益情况

自 2023 年 8 月 28 日至 2023 年 10 月 24 日清算期间

单位：人民币元

项目	金额
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	4,027.76
2、公允价值变动损益	473,976.75
3、投资收益（注 2）	-678,203.64
4、其他收入（注 3）	668.37
清算收益小计	-199,530.76
二、清算费用	
其他费用（注 4）	-
清算费用小计	-
三、清算净收益	-199,530.76

注：利息收入为以当前使用的利率预估计提的 2023 年 8 月 28 日至 2023 年 10 月 24 日的银行存款利息、交易所备付金及保证金利息（根据实际持仓变化）。清算起始日至清算款划出前一日的银行存款产生的利息、交易所备付金及保证金产生的利息归基金份额持有人所有，基金管理人将于基金清算资金分配前对尚未结息部分予以垫资。基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

注 2：投资收益为 2023 年 8 月 28 日至 2023 年 10 月 24 日的股票差价收入、股票红利收入及相关交易费用等。

注 3：其他收入为 2023 年 8 月 25 日提出的赎回申请对应的赎回费收入。

（五）剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 8 月 27 日基金净资产	12,753,865.37
减：基金赎回金额（于 2023 年 8 月 25 日提出的投资者赎回申请）	565,431.64
加：清算期间净收益	-199,530.76
二：本次清算结束日 2023 年 10 月 24 日基金净资产	11,988,902.97

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、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按运作终止日基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人有权于收到基金托管人通知后当日内将款项补足。

（六）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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后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。

五、备查文件

1、备查文件目录

（1）创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金 2020 年 8 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 8 月 27 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

（2）关于《创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

3、查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信港股通大消费精选股票型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2023 年 11 月 10 日