

中金丰硕混合型证券投资基金 二次清算报告

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告出具日期：2023年6月20日

报告公告日期：2023年6月29日

1 重要提示

中金丰硕混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“中金丰硕”)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[2017] 2023 号文注册, 2018 年 1 月 29 日基金合同生效。本基金的基金管理人为中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”或“基金管理人”), 本基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据市场环境变化, 为维护基金份额持有人利益, 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》等法律法规以及《中金丰硕混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的规定, 中金丰硕混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人中金基金管理有限公司经与基金托管人建设银行协商一致, 决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会, 审议《关于终止中金丰硕混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》, 并由参加基金份额持有人大会的基金份额持有人对本次会议议案进行表决。本次基金份额持有人大会表决投票时间从 2022 年 12 月 23 日至 2023 年 1 月 31 日止, 并于 2023 年 2 月 1 日计票表决通过了上述议案, 本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。

本基金自 2023 年 2 月 3 日起进入清算期, 由基金管理人中金基金、基金托管人建设银行、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力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, 并由毕马威华振会计师事务所(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。

本次清算为本基金第二次清算, 清算期间为 2023 年 2 月 7 日至 2023 年 6 月 15 日。本清算报告已经基金托管人复核, 在经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计、上海市通力律师事务所出具法律意见书后, 报中国证券监督管理委员会备案。

2 基金概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------------|---------------|
| 基金名称 | 中金丰硕混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 中金丰硕 |
| 基金主代码 | 005396 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年1月29日 |
| 基金管理人 | 中金基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 最后运作日(2023年2月2日) | |
| 基金份额总额 | 5,760,588.05份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产长期稳健的增值。 |
| 投资策略 | 本基金将重点投资于具备内生性增长基础的价值创造型企业,并重点关注相关个股的安全边际及绝对收益机会。具体包括:1、资产配置策略;2、普通债券投资策略;3、中小企业私募债的投资策略;4、可转换债券投资策略;5、可交换债券投资策略;6、资产支持证券投资策略;7、国债期货投资策略;8、股票投资策略;9、存托凭证投资策略;10、股指期货投资策略;11、权证投资策略。详见《中金丰硕混合型证券投资基金基金合同》。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×50%+中债综合财富(总值)指数收益率×50% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。 |

3 基金最后运作日财务会计报告(经审计)

资产负债表

会计主体:中金丰硕混合型证券投资基金

报告截止日:2023年6月15日(基金二次清算结束日)

单位:人民币元

| 资产 | 本期末2023年6月15日 (基金第二次清算结束日) |
|-------|-------------------------------|
| 资产: | |
| 银行存款 | 366,283.91 |
| 结算备付金 | |

| | |
|-------------------|-------------------|
| 存出保证金 | 29,232.91 |
| 交易性金融资产 | |
| 其中：股票投资 | |
| 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 | - |
| 应收清算款 | 5,145.20 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | - |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 400,662.02 |
| 负债和所有者权益 | |
| 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 | - |
| 应付管理人报酬 | |
| 应付托管费 | |
| 应付销售服务费 | |
| 应交税费 | |
| 应付利息 | |
| 应付利润 | |
| 递延所得税负债 | |
| 其他负债 | 165.45 |
| 负债合计 | 165.45 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 282,958.43 |
| 未分配利润 | 117,538.14 |
| 所有者权益合计 | 400,496.57 |
| 负债和所有者权益总计 | 400,662.02 |

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

中金丰硕混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2017年11月9日证监许可[2017]2023号《关于准予中金丰硕混合型证券投资基金注册的批复》注册,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金丰硕混合型证券投资基金招募说明书》和《中金丰硕混合型证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金的基金管理人为中金基金,原基金托管人为包商银行股份有限公司(以下简称“包商银行”)。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台、中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)、中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”)、中国银河证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、包商银行及上海挖财金融信息服务有限公司等共同销售,募集期为自2017年12月20日至2018年1月23日止期间。经向中国证监会备案,原《中金丰硕混合型证券投资基金基金合同》于2018年1月29日正式生效,《基金合同》生效日基金实收份额为245,273,572.56份(含利息转份额128,974.98份),发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

中金基金于2021年2月7日发布《关于中金丰硕混合型证券投资基金由中国建设银行股份有限公司担任临时基金托管人的公告》,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《北京市第一中级人民法院民事裁定书》(2020)京01破270号之一及中国证监会指定,建设银行自包商银行被依法宣告破产之日(2021年2月7日)起担任本基金临时基金托管人。

中金基金于2021年6月3日发布《中金基金管理有限公司关于中金丰硕混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》,基金份额持有人大会于2021年6月2日表决通过了《关于中金丰硕混合型证券投资基金选任基金托管人等有关事项的议案》,同意选聘建设银行为基金托管人,中金基金与建设银行签订的经变更注册的《中金丰硕混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)和《中金丰硕混合型证券投资基金托管协议》于2021年6月2日生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《基金合同》和《中金丰硕混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、

债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

4.2 清算原因

根据市场环境变化，为维护基金份额持有人利益，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》等法律法规以及《基金合同》的规定，基金管理人经与本基金基金托管人建设银行协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，2023年2月1日审议通过了《关于终止中金丰硕混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。

由于本基金于2023年2月6日（第一次清算期结束日）仍持有流通受限股票，该部分已于2023年6月15日前全部完成变现，故本基金进行第二次清算。

4.3 清算起始日

本基金二次清算起始日为2023年2月7日（第一次清算期结束日次日），二次清算期为2023年2月7日至2023年6月15日（基金第二次清算结束日）。

4.4 清算报表编制基础

本基金清算报表的编制遵循了《企业会计准则》以及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5 清算情况

自2023年2月7日（第一次清算期结束日次日）至2023年6月15日（基金第二次清算结束日）止为本基金第二次清算报告期，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

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。

5.2 资产/负债处置情况

1、本基金持仓的流通受限股票已于2023年6月15日（含当天）前全部变现完毕，清算金额为392,222.49元，均已于2023年6月16日（含当天）前划回托管户。

2、本次清算结束日账面应收利息 338.88 元，预计于 2023 年 6 月 21 日划回托管户。

3、本次清算结束日账面应付佣金 165.45 元，上述款项已于 2023 年 6 月 16 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------------------|---|
| | 2023年2月7日(基金二次清算起始日)至2023年6月15日(基金二次清算结束日)止期间 |
| 一、资产处置损益 | 16,510.45 |
| 1.利息收入 | 1,513.78 |
| 其中：存款利息收入 | 1,513.78 |
| 买入返售金融资产收入 | |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 45,849.04 |
| 其中：股票投资收益 | 45,644.27 |
| 债券投资收益 | |
| 债券利息收入 | |
| 股利收益 | 204.77 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -30,852.37 |
| 4.其他收入（损失以“-”号填列） | |
| 二、清算净损益（净亏损以“-”号填列） | 16,510.45 |

5.4 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、首次清算结束日2023年2月6日基金净资产 | 8,203,751.05 |
| 加：清算期间净收益 | 16,510.45 |
| 减：一次清算金额 | 7,819,764.93 |
| 二、二次清算结束日2023年6月15日基金净资产 | 400,496.57 |

资产处置及负债清偿后，截止本基金二次清算报告期结束日 2023 年 6 月 15 日，本基金剩余财产为人民币 400,496.57 元，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。

自 2023 年 6 月 15 日至清算款划出日前一日的银行存款、存出保证金产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。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。

5.5 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。

6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- (1) 中金丰硕混合型证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 关于《中金丰硕混合型证券投资基金清算报告》的法律意见
- (3) 中金丰硕混合型证券投资基金二次清算财务报表及审计报告
- (4) 关于《中金丰硕混合型证券投资基金二次清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

中金丰硕混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二三年六月二十九日