

创金合信港股通成长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：交通银行股份有限公司

一、重要提示

创金合信港股通成长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 2021 年 858 号《关于准予创金合信港股通成长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《创金合信港股通成长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 2021 年 6 月 07 日到 2021 年 6 月 18 日止，设立募集（不包括认购资金利息）人民币 11,330,314.10 元，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验字第 2100099 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2021 年 6 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 11,332,298.89 份，其中认购资金利息折合 1,984.79 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》生效后之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。根据上述约定，截至 2024 年 6 月 23 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 2024 年 6 月 24 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成长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 2024 年 6 月 24 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、基金托管人交通银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）、上海源泰律师事务所于 2024 年 6 月 24 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，上海源泰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：创金合信港股通成长股票型发起式证券投资基金（基金简称：创金合信港股通成长股票；基金代码：A类基金份额 012315、C类基金份额 012316）

2、基金类型：股票型证券投资基金

3、基金托管人：交通银行股份有限公司

4、基金运作方式：契约型开放式

5、投资目标：本基金将在严格控制风险的前提下，采用自下而上的投资方法，深入分析基本面，精选具有成长潜力的股票，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

6、风险收益特征：本基金为股票型证券投资基金，长期来看，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金除可投资A股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。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：2021年6月7日到2021年6月18日

8、基金合同生效日：2021年6月23日

三、财务会计报告

资产负债表（已审计）

会计主体：创金合信港股通成长股票型发起式证券投资基金

基金最后运作日：2024年6月23日

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日：2024年6月23日
-----	--------------------

资 产：	
货币资金	1, 803, 840. 51
结算备付金	—
存出保证金	128, 244. 64
交易性金融资产	17, 863, 458. 76
其中：股票投资	17, 863, 458. 76
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	1, 895, 306. 80
应收股利	2, 673. 50
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	21, 693, 524. 21
负债和净资产	基金最后运作日：2024 年 6 月 23 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	2, 230, 619. 21
应付管理人报酬	24, 386. 44
应付托管费	4, 064. 40

应付销售服务费	6,158.46
应交税费	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	52,213.29
负债合计	2,317,441.80
净资产：	
实收基金	53,545,225.37
未分配利润	-34,169,142.96
净资产合计	19,376,082.41
负债和净资产总计	21,693,524.21

注：1、基金最后运作日 2024 年 6 月 23 日，A 类基金份额净值 0.3650 元，C 类基金份额净值 0.3602 元，基金份额总额 53,545,225.37 份，其中 A 类基金份额 18,724,624.15 份，C 类基金份额 34,820,601.22 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 2413824 号的无保留意见的审计报告。

四、基金财产分配

自 2024 年 6 月 24 日至 2024 年 9 月 2 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（2024年9月2日），部分资产尚未收回。各项资产清算情况如下：

- 1、本基金最后运作日货币资金余额为人民币 1,803,840.51 元（含货币资金应计利息 30.06 元），截止本次清算结束日，货币资金余额为人民币 626,302.91 元（含货币资金应计利息 256.21 元）。
- 2、本基金最后运作日存出保证金为人民币 128,244.64 元（其中券商保证金为 128,242.51 元，券商保证金应计利息 2.13 元），截止本次清算结束日，存出保证金为人民币 10,924,929.81 元（其中券商保证金为 10,924,866.33 元，券商保证金应计利息 63.48 元）。
- 3、本基金最后运作日持有的股票投资市值共计人民币 17,863,458.76 元，其中：
 - 1）截止最后运作日，因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票人民币 2,928,346.49 元，截止清算结束日，该流通受限股票估值金额调整为 1,896,141.15 元，明细如下：

单位：人民币

证券代码	证券名称	数量（股）	最后运作日 估值价格 （元）	最后运作日估值总额 （元）	清算结 束日估 值价格 （元）	清算结束日估 值总额（元）
H06606	诺辉健康	227,000	12.90	2,928,346.49	8.35	1,896,141.15

注：1、本基金管理人于 2024 年 7 月 6 日发布《创金合信基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告》，对我司旗下证券投资基金持有的“诺辉健康（证券代码：6606.HK）”按照 9.17 港元/股进行估值，该估值价格按照 2024 年 9 月 2 日（清算结束日）人民银行公布的人民币兑换港币的汇率中间价折合计算为 8.35 元。

2、停牌股票最后清算日估值金额与实际变现金额可能存在差异，实际变现金额存在不确定性。待停牌股票变现后，本基金管理人将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。截止于 2024 年 9 月 2 日（清算结束日），本基金持有的停牌股票尚未复牌。

2）本基金最后运作日持有的非流通受限股票人民币 14,935,112.27 元，已于 2024 年 6 月 24 日至 2024 年 9 月 2 日期止清算期间处置变现，实际变现金额为 12,710,834.37 元。

4、本基金最后运作日应收清算款为人民币 1,895,306.80 元，已于 2024 年 6 月 25 日结转至券商保证金账户，截止本次清算结束日，应收清算款余额为人民币 22,853.28 元，已于 2024

年 9 月 4 日结转至券商保证金账户。

5、本基金最后运作日应收股利为人民币 2,673.50 元，已于 2024 年 8 月 23 日到账，截止本次清算结束日，应收股利余额为人民币 0.00 元。

（三）负债清偿情况

- 1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,230,619.21 元，该款项已于 2024 年 6 月 27 日支付完毕。
- 2、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 24,386.44 元，该款项将于实际支付时扣除。
- 3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,064.40 元，该款项已于 2024 年 7 月 3 日支付完毕。
- 4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 6,158.46 元，该款项已于 2024 年 7 月 2 日支付完毕。
- 5、本基金最后运作日应付交易费用为人民币 2,709.22 元，该款项已于 2024 年 6 月 26 日支付完毕。
- 6、本基金最后运作日其他负债为人民币 52,213.29 元，为预提审计费、律师费、信息披露费、应付汇划费及应付交易费用和应付赎回费。其中，应付赎回费人民币 27.07 元已于 2024 年 6 月 27 日支付，应付汇划费人民币 123.51 元已于 9 月 1 日支付，应付交易费用人民币 2,695.73 元已于 2024 年 9 月 2 日支付；此外，审计费人民币 8,000.00 元，律师费人民币 13,500.00 元，信息披露费人民币 27,677.00 元，应付汇划费人民币 176.49 元和应付交易费用人民币 13.49 元将于实际支付时扣除。

（四）清算期间的损益情况

自 2024 年 6 月 24 日至 2024 年 9 月 2 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）	327.92
2、公允价值变动损益（注 2）	958,688.81

3、投资收益（注 3）	-4,151,854.31
4、其他收入（注 4）	2,598.27
清算收益小计	-3,190,239.31
二、清算费用	
其他费用	-
清算费用小计	-
三、清算净收益	-3,190,239.31

注 1：利息收入为以当前使用的利率预估计提的 2024 年 6 月 24 日至 2024 年 9 月 2 日的货币资金利息及保证金利息（根据实际持仓变化）。2024 年 9 月 3 日至第二次清算款（不含保证金及未变现股票资产）划出日前一日的货币资金产生的利息亦属份额持有人所有，该部分利息将在二次清算时一并清算。

注 2：公允价值变动损益为最后运作日持仓股票在 2024 年 6 月 24 日至 2024 年 9 月 2 日产生的公允价值变动，以及清算期间处置持有股票投资时，将原计入该股票投资的公允价值变动转出至投资收益的金额。

注 3：投资收益为 2024 年 6 月 24 日至 2024 年 9 月 2 日的清算期间的股票投资收益、股票红利收入以及交易所市场交易费用等。

注 4：其他收入为 2024 年 6 月 21 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 2024 年 6 月 23 日基金净资产	19,376,082.41
减：基金赎回金额（于 2024 年 6 月 21 日提出的投资者赎回申请）	2,789,369.37
加：清算期间净收益	-3,190,239.31
二：本次清算结束日 2024 年 9 月 2 日基金净资产	13,396,473.73

本基金于 2024 年 9 月 2 日剩余财产为人民币 13,396,473.73 元，扣除清算结束日未变现资产，2024 年 9 月 2 日首次可供分配净资产为人民币 11,500,332.58 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、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。由于本基金截至清算结束日（2024年9月2日）仍持有未变现资产，故需进行二次清算。本基金将于上述未变现资产全部变现后进入二次清算程序，并将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行二次分配。

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）创金合信港股通成长股票型发起式证券投资基金清算审计报告；
- （2）关于《创金合信港股通成长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

创金合信港股通成长股票型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2024 年 9 月 20 日