
凯石浩品质经营混合型证券投资基金
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

清算报告出具日期：2020年11月13日

清算报告公告日期：2020年11月20日

目录

一. 重要提示.....	3
二. 基金概况.....	4
三. 基金运作情况说明.....	6
四. 财务会计报告.....	7
五. 清算事项说明.....	8
六. 备查文件目录.....	11

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，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》。

本基金从2020年10月30日起进入清算期，基金管理人按照本基金基金合同的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。由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）、上海源泰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，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，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

2.1 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05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	
报告期末（2020年10月29日）基金份额总额	517,554.70份	
基金合同存续期	不定期	
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
报告期末下属分级基金的份额总额	516,120.54份	1,434.16份

2.2 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。
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

三. 基金运作情况说明

凯石浩品质经营混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会《关于准予浩品质经营混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2019】606号）准予注册，由基金管理人依照《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《凯石浩品质经营混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）的规定公开募集，于2019年5月27日成立并正式运作，基金合同生效日基金份额总额为200,170,600.20份。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。本基金的基金管理人为凯石基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《凯石浩品质经营混合型证券投资基金基金合同》以及凯石基金管理有限公司于2020年10月31日发布的《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》，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，本基金根据基金合同约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金最后运作日为2020年10月29日，自2020年10月30日起，本基金进入基金财产清算程序，停止办理申购（含定投）、赎回、转换等业务。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费等费用。

四. 财务会计报告

4.1 基金最后运作日资产负债表（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：2020年10月29日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2020年10月29日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	898,927.40
交易性金融资产	1,309,695.15
其中：股票投资	1,309,695.15
应收利息	298.97
资产总计	2,208,921.52
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	1,454,429.72
应付管理人报酬	2,000.00
应付托管费	416.66
应付销售服务费	2.04
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
其他负债	139,357.74
负债合计	1,596,206.16
所有者权益：	
实收基金	517,554.70
未分配利润	95,160.66
所有者权益合计	612,715.36
负债和所有者权益总计	2,208,921.52

注：1. 报告截止日 2020 年 10 月 29 日(基金最后运作日)，基金份额总额 517,554.70 份，其中凯石浩品质经营混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.1839 元，基金份额总额 516,120.54 份；凯石浩品质经营混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.1594 元，基金份额总额 1,434.16 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 10 月 29 日(基金最后运作日)止期间。

五. 清算事项说明

根据《凯石浩品质经营混合型证券投资基金基金合同》约定，自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。自 2020 年 10 月 30 日至 2020 年 11 月 13 日止的清算期间，本基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行第一次清算，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) 本基金最后运作日银行存款为人民币 898,927.40 元，本基金的银行存款为托管户活期存款以及存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 1,309,695.15 元，全部为股票资产。除因处于锁定期内而无法卖出的股票投资外，本基金于 2020 年 10 月 30 日将最后运作日持有的其他交易性股票投资变现，变现金额为 1,254,201.89 元。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 298.97 元，其中应收银行存款利息人民币 72.21 元、应收券商资金户存款利息为人民币 226.76 元；自 2020 年 10 月 30 日本基金进入清算程序起至本财务报表批准报出日(2020 年 11 月 13 日)止期间，本基金银行存款产生的利息收入归基金份额持有人所有。款项将于结息时按实际金额划入托管账户。

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 1,454,429.72 元，该款项已于 2020 年 11 月 2 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 2,000.00 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 416.66 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 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 2.04 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日前支付完毕。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 139,357.74 元，其中应付赎回费为人民币 2,729.28 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日前支付完毕；预提信息披露费 99,344.61 元、预提审计费 37,253.85 元、汇划费 30 元，该款项已于 2020 年 11 月 6 日前支付完毕。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2020 年 10 月 30 日至 2020 年 11 月 13 日 清算期间
一、收益	
存款利息收入（注 1）	120.01
投资收益（注 2）（损失以“-”填列）	-42,060.66
公允价值变动损益（注 3）	38,533.60
其他收入（注 4）	0.01
二、费用	
交易费用	2,284.60
其他费用（注 5）	20,109.12
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-25,800.76

注 1：存款利息收入主要系计提的清算期间的银行存款利息及存出保证金利息。

注 2：投资收益系清算期间的股票投资差价收入。

注 3：公允价值变动损益系清算期间的股票投资产生的公允价值变动。

注 4：其他收入系于清算期间确认的最后运作日赎回申请所产生的基金赎回费收入及基金转换费收入。

注 5：其他费用系清算期间所产生的银行汇划费、律师费。

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	612,715.36
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-25,800.76
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）	12.02
二、清算结束日基金净资产	586,902.58

资产处置及负债清偿后，本基金于 2020 年 11 月 13 日全部剩余财产为人民币 586,902.58 元，其中锁定期内新股期末估值总额：人民币 55,822.00 元、应收利息余额：人民币 418.98 元，扣除以上未变现资产后，本次清算可供分配剩余财产为人民币 530,661.60 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其他清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。由于本基金截至本财务报表批准报出日（2020 年 11 月 13 日）所持有流通受限证券尚处于锁定期内，故需进行二次清算。本基金将于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，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的份额比例进行二次分配。

六. 备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 《凯石浩品质经营混合型证券投资基金清算审计报告》

6.1.2 《关于凯石浩品质经营混合型证券投资基金第一次清算事宜之法律意见》

6.2 存放地点上海市黄浦区延安东路1号2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。

凯石浩品质经营混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二〇年十一月二十日