

中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告出具日期：2021年6月30日

报告公告日期：2021年7月7日

1 重要提示

中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“中金瑞康基金”）经中国证监会证监许可[2020]1507号文注册，2020年9月15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”），本基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《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 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形之一的，本基金应当根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止，无须召开基金份额持有人大会。”

截至 2021 年 6 月 15 日日终，本基金连续 50 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形，满足基金合同约定的前述终止条件，本基金将根据基金合同约定进入基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会。

本基金自 2021 年 6 月 16 日起进入清算期，由基金管理人中金基金、基金托管人兴业银行、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。

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中金瑞康
基金主代码	010185
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年9月15日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
最后运作日（2021年6月15日）	
基金份额总额	12,334,229.49份

2.2 基金产品说明

投资目标	在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	本基金将采用“自上而下”的分析方法，结合长期战略资产配置、中期周期资产配置和短期战术资产配置的模型及研判，动态调整各大类资产的投资比例。一方面积极通过长中短期的策略相结合动态把握不同宏观及中观时点的市场收益，另一方面通过各策略间的风险预算控制，有效管理组合风险。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、普通债券投资策略；5、可转换债券投资策略；6、可交换债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、证券公司短期公司债券投资策略；9、国债期货投资策略；10、股指期货投资策略；11、股票期权投资策略；12、融资业务投资策略；13、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率*50%+沪深300指数收益率*45%+恒生中国企业指数收益率（使用估值汇率调整）*5%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金，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：中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年6月15日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2021年6月15日 (基金最后运作日)
----	-----------------------------

资产：	-
银行存款	13,137,545.56
结算备付金	-
存出保证金	212,584.53
交易性金融资产	450,523.55
其中：股票投资	450,523.55
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	-
应收利息	37,527.58
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	13,838,181.22
负债和所有者权益	本期末 2021 年 6 月 15 日 (基金最后运作日)
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	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	3,919.72
应付托管费	603.03
应付销售服务费	-
应付交易费用	913.52
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	84,137.10
负债合计	89,573.37
所有者权益：	-
实收基金	12,334,229.49
未分配利润	1,414,378.36
所有者权益合计	13,748,607.85
负债和所有者权益总计	13,838,181.22

注：报告截止日 2021 年 6 月 15 日（基金最后运作日），中金瑞康基金份额净值 1.1147 元，基金份额总额 12,334,229.49 份。

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金依据中国证监会于 2020 年 7 月 15 日证监许可[2020]1507 号《关于准予中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由中金基金依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）、《中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称《招募说明书》）和《中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》公开募集。中金瑞康基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。中金瑞康基金的基金管理人为中金基金，基金托管人为兴业银行。

中金瑞康基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台等共同销售，募集期为 2020 年 9 月 11 日起至 2020 年 9 月 11 日止。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2020 年 9 月 15 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 500,002,475.00 份（含利息转份额零份），认购价格为人民币 1.00 元。认购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。

根据《基金合同》和《招募说明书》的规定，中金瑞康基金的投资范围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或注册发行上市的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、国债期货、股指期货、股票期权、银行存款、同业存单、信用衍生品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），并可依据法律法规的规定参与融资业务。

4.2 清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《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 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形之一的，本基金应当根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止，无须召开基金份额

持有人大会。”

截至 2021 年 6 月 15 日日终，本基金连续 50 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形，满足基金合同约定的前述终止条件，本基金将根据基金合同约定进入基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会。

4.3 清算起始日

本基金于 2021 年 6 月 16 日起进入清算期，由于本基金持有的流通受限股票，本基金将进行两次清算，其中第一次清算期为 2021 年 6 月 16 日至 2021 年 6 月 18 日。本基金将于前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、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二次分配。

4.4 清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。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 2021 年 6 月 16 日至 2021 年 6 月 18 日止为本基金第一次清算报告期，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剩余财产中支付。

5.2 资产处置情况

(1) 银行存款、保证金及应收款项资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价值	清算金额	清算期期末账面价值
1	银行存款	13,137,545.56	-5,313.80	13,132,231.76
2	存出保证金	212,584.53	0.00	212,584.53
3	应收利息	37,527.58	411.78	37,939.36

(2) 金融资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价值	清算期内最后处置日	清算金额	清算期末账面价值
1	股票投资	450,523.55	-	0.00	455,005.26

注：截至 2021 年 6 月 15 日股票投资为人民币 450,523.55 元，均为流通受限股票。截至 2021 年 6 月 18 日股票投资为人民币 455,005.26 元，均为流通受限股票。该部分预计于锁定期结束后变现并进入二次清算程序。

5.3 负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 3,919.72 元，该款项已于 2021 年 6 月 17 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 603.03 元，该款项已于 2021 年 6 月 17 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 913.52 元，该款项已于 2021 年 6 月 17 日支付。
- (4) 本基金最后运作日其他负债人民币 84,137.10 元，其中预提信息披露费 54,575.82 元，预提审计费 29,561.28 元，另 438.72 元审计费于 2021 年 6 月 16 日进行补提，相关费用将由基金管理人在清算款划出前扣除。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 6 月 16 日（基金清算起始日）至 2021 年 6 月 18 日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	5,015.96
1. 利息收入	411.78
其中：存款利息收入	411.78
债券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	122.47
其中：股票投资收益	-
债券投资收益	-
股利收益	122.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,481.71
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	-
二、清算费用	-25,438.72
1. 交易费用	-
2. 其他费用	-25,438.72
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-20,422.76

5.5 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、最后运作日2021年6月15日基金净资产	13,748,607.85
加：清算期间净收益	-20,422.76
减：基金净赎回金额	-
二、2021年6月18日基金净资产	13,728,185.09

资产处置及负债清偿后，于2021年6月18日本基金剩余财产为人民币13,728,185.09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。

截止2021年6月18日，本基金仍持有因认购新发证券而流通受限的股票投资，该部分市值为455,005.26元，因此需要进行二次清算。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、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二次分配。因上述股票变现金额存在不确定性，因而最终有可能无法按照清盘报告中净值予以清盘，实际清盘净值以所持股票全部变现为准。自本次清算期结束日次日2021年6月19日至第一次清算款项支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有。

5.6 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) 中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 《中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金清算报告》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。

中金瑞康灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二一年七月七日