

中金金序量化蓝筹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：中国建设银行股份有限公司

报告出具日期：2022年9月29日

报告公告日期：2022年10月14日

1 重要提示

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“中金金序量化蓝筹”）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〕936号文注册，2018年2月6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“本基金管理人”），本基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《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超过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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。”

本基金《基金合同》生效日为2018年2月6日。截至2022年8月9日（基金份额持有人大会权益登记日），该基金已达到基金资产净值连续60个交易日低于5000万元。本基金管理人管理的中金金序量化蓝筹以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议了《关于终止中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“议案”），并由参加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于2022年9月14日表决通过了《关于终止中金金序量化蓝筹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。自本次基金份额持有人大会决议生效并公告后的下一个工作日（即2022年9月16日）起，本基金进入清算程序。

本基金自2022年9月16日起进入清算期，由基金管理人中金基金、基金托管人中国建设银行、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。

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金
基金简称	中金金序量化蓝筹
基金主代码	005405
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月6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(2022年9月15日)	
基金份额总额	2,897,411.55份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用数量化技术对投资策略进行优化，将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数体现在数量模型中，通过数量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，充分发挥数量化投资的优势。一方面，在偏好大盘蓝筹的基础上，构建最小化市场波动性的投资组合；另一方面，通过量化选股等策略追求超越业绩比较基准的投资收益。具体包括：1、资产配置策略；2、量化选股策略；3、存托凭证投资策略；4、其他策略。详见《中金金序量化蓝筹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*75%+中债综合指数收益率*25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和预期收益高于货币市场基金、债券证券投资基金，低于股票型证券投资基金。

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：中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金

报告截止日：2022年9月15日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2022年9月15日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	445,478.44
结算备付金	6,819.75

存出保证金	1,176.19
交易性金融资产	1,652,937.80
其中：股票投资	1,652,937.80
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	1,001,710.14
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	3,108,122.32
负债和所有者权益	本期末 2022 年 9 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	-
应付清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	1,400.02
应付托管费	350.02
应付销售服务费	21.96
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	24,989.86
负债合计	26,761.86
所有者权益：	
实收基金	2,897,411.55
未分配利润	183,948.91
所有者权益合计	3,081,360.46
负债和所有者权益总计	3,108,122.32

注：报告截止日 2022 年 9 月 15 日，中金金序量化蓝筹 A 基金份额净值 1.0624 元，基金份额总额 2,787,066.37 份；中金金序量化蓝筹 C 基金份额净值 1.0915 元，基金份额总额 110,345.18 份。中金金序量化蓝筹份额总额合计为 2,897,411.55 份。

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金依据中国证监会于2017年6月16日证监许可[2017]936号《关于准予中金金序量化蓝筹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》及配套规则、《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金招募说明书》和《中金金序量化蓝筹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，原存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行。

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、中国中金财富证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司等共同销售，募集期为2017年12月5日起至2018年1月30日止期间。经向中国证监会备案，《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月6日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为203,049,881.65份（含利息转份额8.28份以及于2018年3月21日银行结息转份额55.87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。

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《中金金序量化蓝筹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、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、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《中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同》“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超过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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。”

本基金《基金合同》生效日为2018年2月6日。截至2022年8月9日（基金份额持有人大会

权益登记日), 该基金已达到基金资产净值连续 60 个交易日低于 5000 万元。本基金管理人管理的中金金序量化蓝筹以通讯方式召开了基金份额持有人大会, 会议审议了《关于终止中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》, 并由参加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于 2022 年 9 月 14 日表决通过了《关于终止中金金序量化蓝筹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。自本次基金份额持有人大会决议生效并公告后的下一个工作日(即 2022 年 9 月 16 日)起, 本基金进入清算程序。

4.3 清算起始日

本基金于 2022 年 9 月 16 日起进入清算期, 清算期为 2022 年 9 月 16 日至 2022 年 9 月 22 日。本基金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分配。

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《资产管理产品相关会计处理规定》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 2022 年 9 月 16 日至 2022 年 9 月 22 日止为本基金清算报告期, 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(单位: 人民币元)

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(注)	445,478.44(其中: 应收存款利息 256.72)	2,614,503.81	3,059,982.25(其中: 应收存款利息 59.50)
2	结算备付金(注)	6,819.75(其中: 应收	-49.69	6,770.06(其中: 应收结算

		结算备付金利息 50.31)		备付金利息 0.62)
3	存出保证金(注)	1,176.19 (其中: 应收 保证金利息 4.66)	-4.56	1,171.63 (其中: 应收保证 金利息 0.10)
4	应收清算款	1,001,710.14	-1,001,710.14	0.00

注: 结算备付金、存出保证金及银行存款中所包含应收利息部分由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户, 基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(2) 金融资产处置情况 (单位: 人民币元)

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	1,652,937.80	2022/9/19	1,624,037.79	0.00

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金自 2022 年 9 月 16 日进入清算期, 按照《基金合同》第六部分“基金份额的申购与赎回”的规定, 2022 年 9 月 16 日确认的赎回申请为人民币 2,700.33 元, 该款项已于 2022 年 9 月 19 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 1,400.02 元, 该款项已于 2022 年 9 月 16 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 350.02 元, 该款项已于 2022 年 9 月 16 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 21.96 元, 该款项已于 2022 年 9 月 16 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 24,989.86 元, 其中应付交易费用人民币 4,989.86 元, 已于 2022 年 9 月 20 日支付; 应付审计费人民币 20,000.00 元, 将由基金管理人在清算款划出前扣除。

(6) 本基金清算期间产生交易费用人民币 1,188.83 元, 已于 2022 年 9 月 20 日支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	本期 2022 年 9 月 16 日 (基金清算起始日) 至 2022 年 9 月 22 日 (基金清算结束日) 止期间
一、资产处置损益	-30,706.19
1. 利息收入	163.72
其中: 存款利息收入	163.72
买入返售金融资产收入	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)	-96,011.24

其中：股票投资收益	-95,230.17
债券投资收益	-
债券利息收入	-
股利收益	-781.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	65,141.33
4.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、清算费用	30.00
1. 其他费用	30.00
2. 利息支出	-
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-30,736.19

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2022年9月15日基金净资产	3,081,360.46
加：清算期间净收益	-30,736.19
减：基金净赎回金额	2,700.33
二、2022年9月22日基金净资产	3,047,923.94

资产处置及负债清偿后，于2022年9月22日本基金剩余财产为人民币3,047,923.94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。

自本次清算期结束日次日2022年9月23日至清算款项支付日前一日的存款利息归基金份额持有人所有。于清算划款日的应收利息余额由基金管理人以自有资金先行垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。除清算划款以及负债清偿产生的银行汇划费从基金资产中支付外，其他与本次清算相关产生的银行汇划费由基金管理人承担。

由于截止2022年9月22日的基金净资产中包含了备付金、保证金、应收利息等，将在划付本次清算金额（含费用）后对基金剩余财产进行后续清算，直至全部基金财产清算完毕。

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) 中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金资产负债表及审计报告
- (2) 《中金金序量化蓝筹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。

中金金序量化蓝筹混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二二年十月十四日