中金瑞祥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：平安银行股份有限公司

报告出具日期：2023 年 1 月 31 日

报告公告日期：2023 年 2 月 4 日

1 重要提示

中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“中金瑞祥”）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〔2018〕317号文注册，2018年11月13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”），本基金托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

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》（以下或简称“《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《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下或简称“《基金合同》”）的有关规定，基金管理人经与本基金基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于终止中金瑞祥灵活配置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15日起至2023年1月11日止，并于2023年1月12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1月16日起进入清算期，由基金管理人中金基金、基金托管人平安银行、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	中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中金瑞祥
基金主代码	006279
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 13 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
最后运作日(2023 年 1 月 13 日)基金份额总额	2,654,246.61 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	本基金的资产配置策略主要是基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估，在约定的投资比例范围内确定各大类资产的中长期基本配置比例并进行调整。具体包括：1、资产配置策略；2、普通债券投资策略；3、中小企业私募债券的投资策略；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《中金瑞祥灵活配置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：中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 1 月 13 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2023 年 1 月 13 日 （基金最后运作日）
资产：	

银行存款	7,746,979.92
结算备付金	-
存出保证金	108,971.26
交易性金融资产	3,463,361.57
其中：股票投资	3,463,361.57
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	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	**11,319,312.75**
负债和所有者权益	**本期末 2023 年 1 月 13 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	16,866.40
应付管理人报酬	2,127.87
应付托管费	425.58
应付销售服务费	8.22
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	185,036.02
负债合计	**204,464.09**
所有者权益:	
实收基金	2,654,246.61
未分配利润	8,460,602.05
所有者权益合计	**11,114,848.66**
负债和所有者权益总计	**11,319,312.75**

注：报告截止日 2023 年 1 月 13 日，中金瑞祥 A 的基金份额净值为 4.4164 元，期末份额总额为 2,468,068.41 份；中金瑞祥 C 的基金份额净值为 1.1547 元，期末份额总额为 186,178.20 份。基

金份额总额 2,654,246.61 份。

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金依据中国证监会于 2018 年 2 月 9 日证监许可[2018]317 号《关于准予中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中金基金管理有限公司依照《基金法》及配套规则、《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《中金瑞祥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。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为平安银行。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台等共同销售，募集期为自 2018 年 8 月 8 日至 2018 年 11 月 7 日止期间。经向中国证监会备案，《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 11 月 13 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 203,953,024.20 份(含利息转份额 9,685.62 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。

根据经中国证监会备案的基金合同和《中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购/申购费用、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金销售费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《基金法》及其配套规则、基金合同和《中金瑞祥灵活配置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《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平安银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，2023 年 1 月 12 日审议通过了《关于终止中金瑞祥灵活配置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。

4.3 清算起始日

本基金于 2023 年 1 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 2023 年 1 月 16 日至 2023 年 1 月 17 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 2023 年 1 月 16 日至 2023 年 1 月 17 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）	7,746,979.92（其中：应收存款利息 1,845.49）	2,415,844.06	10,163,148.51（其中：应收存款利息 2,170.02）
2	存出保证金（注）	108,971.26（其中：应收	-	108,990.86（其中：应收保

		保证金利息 122.64）		证金利息 142.24）

注：银行存款及存出保证金中所包含的应收利息部分由基金管理人在全部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	清算期期末账面价值
1	股票投资	3,463,361.57	2023/1/16	2,454,079.81	1,038,808.70

注：截至 2023 年 1 月 13 日股票投资为人民币 3,463,361.57 元，其中可流通股票投资为人民币 2,446,653.20 元，已于清算期全部卖出；流通受限股票投资为人民币 1,016,708.37 元。截至 1 月 17 日，股票投资为人民币 1,038,808.70 元，均为流通受限股票。该部分预计于锁定期结束后卖出并进入二次清算程序。

5.3 负债清偿情况

（1）本基金自 2023 年 1 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，2023 年 1 月 16 日应付赎回款及赎回费为人民币 16,975.15 元，该款项已于 2023 年 1 月 17 日支付。

（2）本基金最后运作日应付管理费为人民币 2,127.87 元，该款项已于 2023 年 1 月 17 日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币 425.58 元，该款项已于 2023 年 1 月 17 日支付。

（4）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 8.22 元，该款项已于 2023 年 1 月 17 日支付。

（5）本基金最后运作日其他负债为人民币 185,036.02 元，其中应付交易费用人民币 36.02 元；预提信息披露费 120,000.00 元；预提审计费人民币 65,000.00 元，本次清算审计费用为 30,000.00 元，于 2023 年 1 月 16 日回冲 35,000.00 元，以上费用将由基金管理人在全部清算款划出前扣除。

（6）本基金清算期间卖出股票资产产生的应付佣金费用为人民币 1,796.51 元，截至 1 月 16 日，应付交易费用余额 1,832.53 元，已于 2023 年 1 月 17 日支付。

（7）本次清算律师费用和持有人大会律师费用合计 35,000.00 元，将由基金管理人在全部清算款划出前扣除。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	**本期** **2023 年 1 月 16 日（基金清算起始日）至 2023 年 1 月 17 日（基金清算结束日）止期间**
一、资产处置损益	**27,812.52**
1.利息收入	183.73

其中：存款利息收入	183.73
买入返售金融资产收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	49,011.00
其中：股票投资收益	49,115.00
债券投资收益	-
债券利息收入	-
股利收益	-104.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-21,384.57
4.其他收入（损失以“-”号填列）	2.36
二、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	**27,812.52**

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2023年1月13日基金净资产	**11,114,848.66**
加：清算期间净收益	27,812.52
加：1月14日-1月15日利息收入	160.40
减：基金净赎回金额	16,977.51
二、2023年1月17日基金净资产	**11,125,844.07**

清算期资产处置及负债清偿安排，覆盖了 2023 年 1 月 14 日至 1 月 15 日的资产情况，于 2023 年 1 月 17 日本基金剩余财产为人民币 11,125,844.07 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。

由于本基金截止2023年1月17日仍持有因认购新发证券而流通受限的股票投资，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。自本次清算期结束日次日(即2023年1月18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）中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金资产负债表及审计报告

（2）关于《中金瑞祥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。

中金瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二三年二月四日