

中加科瑞混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告出具日期: 2024 年 6 月 17 日

报告公告日期: 2024 年 6 月 21 日

一、重要提示

中加科瑞混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可【2021】262号文准予募集注册，于2021年10月26日备案后正式成立。中加基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）为本基金的基金管理人，中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）为本基金的基金托管人。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，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》等法律法规的有关规定及《中加科瑞混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的有关约定，本基金的基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，决定以通讯开会方式召开本基金基金份额持有人大会，提议终止《基金合同》，进行基金财产清算。本基金基金份额持有人大会经投票表决，审议通过了《关于终止中加科瑞混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金基金份额持有人大会表决投票时间自2024年4月15日起，至2024年5月10日17:00止（以收到表决票的时间为准）。

2024年5月13日，本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于终止中加科瑞混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见刊登在2024年5月14日中国证监会规定媒介和基金管理人网站（<http://www.bobbns.com>）上的《中加基金管理有限公司关于中加科瑞混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

根据本基金基金份额持有人大会通过的议案及议案的说明，基金份额持有人大会决议生效并公告之日的下一日起，本基金即进入清算程序。因此，本基金自2024年5月15日（含）起进入清算程序。

本基金清算期为17个工作日，自2024年5月15日（含）至2024年6月6日（含）止。由基金管理人中加基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和北京观韬中茂律师事务所于2024年5月15日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，北京观韬中茂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：中加科瑞混合型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金合同生效日：2021年10月26日
- 4、投资目标：在严格控制风险的前提下，追求超过业绩比较基准的投资回报，力争实现资产的长期、稳健增值。
- 5、投资策略：本基金采用积极的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健的收益。
- 6、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 40%+中债总全价（总值）指数收益率 60%。
- 7、风险收益特征：本基金为混合型基金，预期收益和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。
- 8、基金管理人：中加基金管理有限公司
- 9、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

三、财务会计报告

最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：中加科瑞混合型证券投资基金

报告截止日：2024年5月14日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024年5月14日
资产：	
银行存款	11,032,794.49

存出保证金	2.88
交易性金融资产	
其中：债券投资	
资产总计	11,032,797.37
负 债：	
应付管理人报酬	2,709.38
应付托管费	451.57
应付销售服务费	0.15
其他负债	13,573.45
负债合计	16,734.55
净资产：	
实收基金	11,150,065.14
未分配利润	-134,002.32
净资产合计	11,016,062.82
负债和净资产总计	11,032,797.37

注：报告截止日2024年5月14日（基金最后运作日）。中加科瑞混合型证券投资基金基金份额净值为人民币0.9880元，基金份额总额11,150,065.14份。

四、清盘事项说明

1、基本情况

中加科瑞混合型证券投资基金经中国证监会证监许可【2021】262号文准予募集注册，于2021年10月26日备案后正式成立。中加基金管理有限公司为本基金的基金管理人，中国工商银行股份有限公司为本基金的基金托管人。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权

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。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合资产配置比例：股票投资占基金资产的比例为0%-45%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产的20%。

2、清算原因

本基金基金份额持有人大会于2024年5月13日表决通过了《关于终止中加科瑞混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。

3、清算起始日

根据2024年5月14日发布的《中加基金管理有限公司关于中加科瑞混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自公告之日的下一日即2024年5月15日（含）起进入清算程序。

4、清算报表编制基础

本基金清算财务报表仅为按照有关法规要求对基金财产清算目的而编制，仅供基金管理人提交本基金全体持有人以及向中国证监会备案。因此，本清算财务报表不适用于其他用途。

本清算财务报表仅列示本基金于2024年5月14日（最后运作日）的资产负债表和自2024年5月15日（清算起始日）至2024年6月6日（清算结束日）止期间的清算损益表以及部分财务报表附注，未列示相关期间的比较数字，本清算财务报表未披露净资产变动表、金融工具的风险分析及敏感性分析、公允价值相关内容等。因此，本清算财务报表不是一份完整的财务报表，也不包含一份完整财务报表所应披露的所有会计政策及附注。

五、清算情况

自 2024 年 5 月 15 日（含）至 2024 年 6 月 6 日（含）止清算期间，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：

1、清算费用

按照《中加科瑞混合型证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的约定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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。

2、资产处置情况

（1）本基金最后运作日银行存款为人民币 11,032,794.49 元，其中银行存款应计利息人民币 5,923.88 元。于清算结束日的银行存款余额为人民币 11,005,850.44 元，其中银行存款应计利息人民币 8,387.93 元。

（2）本基金于最后运作日及清算结束日的存出保证金余额为人民币 2.88 元，均为应计存出保证金利息。

（3）截至清算期结束日，银行存款和保证金应计利息为人民币 8,390.81 元，该款项由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，待托管账户销户时返还基金管理人。

3、负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 2,709.38 元，应付托管费为人民币 451.57 元，应付销售服务费为人民币 0.15 元。截至清算期结束日，已全部支付；

（2）本基金最后运作日其他负债为人民币 13,573.45 元，包括预提审计费、中债登维护结算费、上清所账户维护费。预提审计费人民币 9,221.85 元，实际于 2024 年 6 月 5 日支付人民币 20,000.00 元，费用差额已于 2024 年 5 月 15 日补提并于 2024 年 6 月 5 日按照实际支付金额调整；中债登维护结算费人民币 2,175.80 元，实际于 2024 年 5 月 24 日支付人民币 3,000.00 元，费用差额于 2024 年 5 月 15 日补提并于 2024 年 5 月 24 日按照实际支付金额调整；上清所账户维护费人

人民币 2,175.80 元，实际于 2024 年 5 月 24 日支付人民币 3,000.00 元，费用差额于 2024 年 5 月 15 日补提并于 2024 年 5 月 24 日按照实际支付金额调整。

4、清算日的清算损益情况

单位：人民币元

	自2024年5月15日起 至2024年6月6日止的清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	2,464.05
公允价值变动损益	0.00
投资收益	0.00
清算期间收益小计	2,464.05
二、清算期间费用	
其他费用（注2）	-12,673.55
三、清算期间净收益	-10,209.50

注 1：利息收入包括银行活期存款利息。

注 2：其他费用包括 2024 年 5 月 15 日至 2024 年 6 月 6 日期间汇划手续费、补提的账户维护费、上清查询费、以及审计费。

5、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 2024 年 5 月 14 日基金净资产	11,016,062.82
加：清算期间基金份额交易产生的基金净值变动数（减少以“-”号填列）	
加：清算期间净收益	-10,209.50
二、清算期结束日 2024 年 6 月 6 日基金资产净值	11,005,853.32

注：截至清算期结束日 2024 年 6 月 6 日，本基金剩余财产为人民币 11,005,853.32 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，按本基金基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金管理人以自有资金垫付的资金将于清算款划出前划入托管账户，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，基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。自清算期结束日次日（2024年6月7日）至清算款划出前一日银行存款等产生的利息亦归本基金基金份额持有人所有，在支付清算款时扣除相关汇划手续费后将一并计算并支付给本基金基金份额持有人。

6、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后向本基金基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《中加科瑞混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 关于《中加科瑞混合型证券投资基金清算报告》的法律意见书。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

中加科瑞混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2024年6月17日