

# 金鹰民稳混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二四年八月五日

清算报告公告日：二〇二四年八月二十二日

## §1 重要提示

金鹰民稳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(以下简称"中国证监会")机构部函[2022]826号文《关于金鹰民稳混合型证券投资基金备案确认的函》批准,于2022年8月9日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为267,470,052.63份基金份额。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司(以下简称"基金管理人"),基金托管人为中国民生银行股份有限公司(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》等法律法规的规定和《金鹰民稳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,基金管理人经与基金托管人协商一致,召集了本基金基金份额持有人大会,审议《关于终止金鹰民稳混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,议案于2024年6月24日表决通过,自该日起本次基金份额持有人大会决议生效,详见《金鹰民稳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公告》。

本基金最后运作日为2024年6月25日。本基金从2024年6月26日起进入清算期,清算期间为自2024年6月26日至2024年07月08日止。由基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和广东岭南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)对本基金进行清算审计,广东岭南律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## §2 基金概况

基金名称	金鹰民稳混合型证券投资基金
基金简称	金鹰民稳混合
基金主代码	014761
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年8月9日

最后运作日（2024-6-25） 基金份额总额	4,804,702.53 份
最后运作日（2024-6-25） 基金净值	4,733,398.09
投资目标	本基金在严格控制风险及保持良好流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币政策和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征的变化，据此确定投资组合中固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间的配置比例并根据市场环境变化动态调整。</p> <p>在大类资产配置的基础上，本基金将综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，并据此确定债券资产的久期配置、类属配置、期限结构配置与个券选择。力争做到保证基金资产的流动性、把握债券市场投资机会，实施积极主动的组合管理，精选个券，控制风险，提高基金资产的使用效率和投资收益。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数收益率×5%
风险收益特征	<p>本基金为混合型证券投资基金，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。</p> <p>本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波</p>

	动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

### §3 基金运作情况

金鹰民稳混合型证券投资基金(简称"本基金")经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）机构部函[2022]826 号文《关于金鹰民稳混合型证券投资基金备案确认的函》批准，于 2022 年 8 月 9 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 267,470,052.63 份基金份额。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。自 2022 年 8 月 9 日至 2024 年 6 月 25 日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，召集了本基金基金份额持有人大会，审议《关于终止金鹰民稳混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，议案于 2024 年 6 月 24 日表决通过，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效，详见《金鹰民稳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公告》，基金管理人将根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金最后运作日为 2024 年 6 月 25 日，自 2024 年 6 月 26 日起，本基金进入基金财产清算程序。

### §4 财务报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：金鹰民稳混合型证券投资基金

报告截止日：2024年6月25日

单位：人民币元

	最后运作日 2024年6月25日
<b>资产：</b>	
银行存款	378,148.15
结算备付金	6,378,310.24
存出保证金	2,633.93
资产总计	6,759,092.32
<b>负债：</b>	
应付赎回款	1,975,284.19
应付管理人报酬	4,816.49
应付托管费	688.06
应付销售服务费	368.46
其他负债	44,537.03
负债合计	2,025,694.23
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	4,804,702.53
未分配利润	-71,304.44
所有者权益合计	4,733,398.09
负债和所有者权益总计	6,759,092.32

注：1、报告截止日2024年6月25日（本基金最后运作日），基金份额总额4,804,702.53份；其中金鹰民稳混合A基金份额净值0.9860元，份额总额2,731,722.56份，金鹰民稳混合C基金份额净值0.9841元，份额总额2,072,979.97份。

2、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》的有关规定编制的。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。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2024年6月26日至2024年7月8日止为清算期间，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：

### 5.1 清算费用

按照《金鹰民稳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) 本基金最后运作日银行存款总额378,148.15元，其中378,089.05元是存储于基金托管人中国民生银行股份有限公司的活期银行存款，59.10元为应计活期银行存款利息，应计活期银行存款利息预计于2024年9月23日收回，该款项由基金管理人以自有资金先行垫付，供清算分配使用。

(2) 本基金最后运作日上交所最低备付金余额为14,501.44元（含应计利息2.60元），在清算期内上述款项产生应计利息8.45元，上交所最低备付金余额已于2024年7月8日全部调回托管户，上交所最低备付金应计利息预计将于2024年9月23日收回。

(3) 本基金最后运作日期货结算备付金余额6,363,808.80元（含应计利息25,349.25元），该款项已于2024年7月5日全部调回托管户；截至清算结束日2024年7月8日期货结算备付金余额余额为应计利息520.82元，该款项已于2024年7月17日调回托管户，实际到账520.85元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金总额2,633.93元，其中存出保证金余额2633.45元，该款项已于2024年8月2日全部调回托管户，应计利息0.48元，存出保证金应计利息预计于2024年9月23日收回。

### 5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为1,975,284.19元，该款项已于2024年6月27日全部划出。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为4,816.49元，该款项已于2024年7月2日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为688.06元，该款项已于2024年7月2日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为368.46元，该款项已于2024年7月2日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债44,537.03元，其中20,000.00元为预提律师费，该笔费用将于收到律师事务所付费发票后进行支付；其中20,000.00元为预提审计费，该笔费用将于收到会计师事务所付费发票后进行支付；其中2,481.51元为应付赎回费，该款项已于2024年6月27日支付；其中2,055.52元为应付交易费用，该款项已于2024年7月8日支付。

#### 5.4 清算期剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 6 月 25 日基金净资产	4,733,398.09
加：清算期间（2024-6-26 至 2024-7-8）收入	
利息收入（注 1）	-461.47
减：清算期间（2024-6-26 至 2024-7-8）费用	
其他费用（注 2）	54.56
减：清算期间确认的最后运作日净赎回金额（含费用）	205.55
二、2024 年 7 月 8 日基金净资产	4,732,676.51

注：（1）利息收入系以当前适用的利率计提的自2024年6月26日至2024年7月8日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金的应计利息，以及清算期间基金管理人根据期货结算备付金存款结息实际收到的金额与应计利息余额之间的差额进行的调整。

（2）其他费用为清算期间支付的汇划手续费。

资产处置及负债清偿后，于清算结束日2024年7月8日本基金剩余财产为人民币4,732,676.51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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算结束日次日 2024 年 7 月 9 日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，

加快清盘速度，截至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金的利息中仍未收到的部分将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。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。

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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时进行分配。

## §6 备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

- 1、《金鹰民稳混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《金鹰民稳混合型证券投资基金基金清算事宜之法律意见》

### 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免费查阅

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人金鹰基金管理有限公司

客户服务电话：400-6135-888

金鹰民稳混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二四年八月二十二日