

---

凯石湛混合型证券投资基金  
第二次清算报告

基金管理人：凯石基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

清算报告出具日期：2022年6月24日

清算报告公告日期：2022年7月01日

---

## 目录

一. 重要提示.....	3
二. 基金概况.....	4
三. 财务会计报告.....	5
四. 基金财产分配.....	7
五. 备查文件目录.....	9

## 一. 重要提示

凯石湛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证监许可【2018】2119号文准予注册，于2019年03月20日成立并正式运作。本基金基金管理人为凯石基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”），基金托管人为广发证券股份有限公司（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》和《凯石湛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》”）等有关规定，“《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5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当根据基金合同约定进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会。”截至2022年1月14日日终，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元，根据基金合同约定，本基金满足基金合同终止条件，已于2022年1月17日进入财产清算程序。

本基金管理人已于2022年1月15日就本基金基金合同终止及进入基金财产清算程序的事宜进行了公告，详见《关于凯石湛混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金从2022年1月17日起进入清算期，基金管理人按照本基金基金合同的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。由基金管理人凯石基金管理有限公司、基金托管人广发证券股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、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，并由普华永道中天会计师事务所（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。

本基金首次清算期间为2022年1月17日至2022年3月21日。本基金的基金管理人于2022年4月12日对《凯石湛混合型证券投资基金清算报告》进行了公告，并于2022年4月15日支付了第一次清算款。

本次清算为本基金第二次清算，清算期间为2022年3月22日至2022年6月10日。本清算报告已经基金托管人复核，在经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计、上海市通力律师事务所出具法律意见书后，已报中国证券监督管理委员会备案。

## 二. 基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	凯石湛混合型证券投资基金	
基金简称	凯石湛混合	
基金主代码	006822	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年03月20日	
基金管理人	凯石基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
第二次清算结束日（2022年6月10日）基金份额总额	378,220.04份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	凯石湛混合A	凯石湛混合C
下属分级基金的交易代码	006822	006823
报告期末下属分级基金的份额总额	98,592.89份	279,627.15份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于受经济与产业发展的内生需求和宏观经济产业导向共同影响的行业中的上市公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策进行分析，结合宏观经济、估值、流动性及投资者交易行为分析，动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，定期对投资组合比例进行优化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中债总全价指数收益率×30%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其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。
基金管理人	凯石基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司

### 三. 财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：凯石湛混合型证券投资基金

报告截止日：2022年6月10日（第二次清算结束日）

单位：人民币元

资产	期末余额
<b>资产：</b>	
银行存款	315,916.94
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	
其中：股票投资	
基金投资	
债券投资	
资产支持证券	
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	
应收股利	
应收申购款	
<b>资产总计</b>	<b>315,916.94</b>
<b>负债和净资产</b>	
<b>负债：</b>	
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	
应付托管费	
应付销售服务费	
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-

应付利润	
其他负债	
<b>负债合计</b>	
<b>净资产：</b>	
实收基金	378,220.04
未分配利润	-62,303.10
净资产合计	315,916.94
<b>负债和净资产总计</b>	<b>315,916.94</b>

注：基金第二次清算结束日 2022 年 6 月 10 日，凯石湛混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 0.8496 元，基金份额总额 98,592.89 份，资产净值为 83,767.44 元；凯石湛混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 0.8302 元，基金份额总额 279,627.15 份，资产净值为 232,149.50 元。

#### 四. 基金财产分配

由于本基金于 2022 年 3 月 21 日（第一次清算结束日）仍持有限售股票导致部分资产尚未变现，故需进行第二次清算。限售股票已于 2022 年 6 月 8 日全部卖出变现。

本次清算为第二次清算，清算期间为 2022 年 3 月 22 日至 2022 年 6 月 10 日，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：

截至本次清算期结束日（2022 年 6 月 10 日）各项资产负债清算情况如下：

##### 1、资产处置情况

(1) 本次清算期结束日银行存款本金为人民币 314,483.70 元；

(2) 本次清算期结束日应收利息为人民币 1,433.24 元，其中托管户活期存款利息 504.58，券商户存款利息 928.66；应收利息于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清。

##### 2、负债清偿情况

本次清算期结束日无应付费用。

##### 3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2022 年 3 月 22 日至 2022 年 6 月 10 日 清算期间
一、收益	
存款利息收入（注 1）	1,288.25
投资收益（注 2）（损失以“-”填列）	32,150.13
公允价值变动损益（注 2）	-88,796.20
其他收入	
二、费用	
交易费用（注 2）	449.00
其他费用	
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-55,806.82

注 1：存款利息收入为自 2022 年 3 月 22 日至 2022 年 6 月 10 日期间的活期存款利息、券商资金户存款利息。

注 2：公允价值变动损益、投资收益以及交易费用均由持有的流通受限的交易性金融资产持有期间和变现时产生。

#### 4、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、第一次清算结束日 2022 年 3 月 21 日基金净资产	4,689,608.77
加：第二次清算期间净收益（损失以“-”填列）	-55,806.82
减：第一次清算支付金额	4,317,885.01
二、2022 年 6 月 10 日基金净资产	315,916.94

资产处置及负债清偿后，本基金于 2022 年 6 月 10 日全部剩余财产为人民币 315,916.94 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。

2022 年 6 月 10 日至最后一次清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算，为加快清盘进程，由基金管理人先行垫付（应垫付托管户应收利息金额为 184.86 元，划款日剩余财产为 316,243.62）。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起滋生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

#### 5、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后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

---

## 五. 备查文件目录

### 1、备案文件目录

- (1) 《凯石湛混合型证券投资基金 2022 年 1 月 15 日（基金最后运作日次日）至 2022 年 6 月 10 日（基金第二次清盘结束日）止期间的财务报表及审计报告》
- (2) 《上海市通力律师事务所关于<凯石湛混合型证券投资基金清算报告>的法律意见》

### 2、存放地点上海市黄浦区延安东路 1 号 2 楼

### 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。

凯石湛混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二二年 七月一日