

---

凯石源混合型证券投资基金  
清算报告

基金管理人：凯石基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

清算报告出具日期：2021年1月11日

清算报告公告日期：2021年1月15日

---

## 目录

一. 重要提示.....	3
二. 基金概况.....	4
三. 基金运作情况说明.....	6
四. 财务会计报告.....	7
五. 清算事项说明.....	8
六. 备查文件目录.....	11

## 一. 重要提示

凯石源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】2104号文准予注册，于2019年8月9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”），基金托管人为平安银行股份有限公司（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》和《凯石源混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“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2020年12月23日日终，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形，根据基金合同约定，本基金满足基金合同终止条件，已于2020年12月24日进入财产清算程序。

本基金管理人已于2020年12月25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《关于凯石源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2020年12月24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、基金托管人平安银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海源泰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，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二. 基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	凯石源混合型证券投资基金	
基金简称	凯石源混合	
基金主代码	006820	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年08月09日	
基金管理人	凯石基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末（2020年12月23日）基金份额总额	999,559.86份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	凯石源混合A	凯石源混合C
下属分级基金的交易代码	006820	006821
报告期末下属分级基金的份额总额	500,885.38份	498,674.48份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过专业的研究分析，力求超越业绩比较基准的资产回报，为投资者实现资产长期稳健增值。
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，以资产配置为主，以积极的主动管理做补充，结合宏观经济、估值、流动性及投资者交易行为分析，根据经济周期的不同阶段，配置所适合持有的资产种类。动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。
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	平安银行股份有限公司

### 三. 基金运作情况说明

凯石源混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会《关于准予凯石源混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】2104号）准予注册，由基金管理人依照《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》等有关规定和《凯石源混合型证券投资基金基金合同》的规定公开募集，于2019年8月9日成立并正式运作，基金合同生效日基金份额总额为200,020,239.98份。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为凯石基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《凯石源混合型证券投资基金基金合同》以及凯石基金管理有限公司于2020年12月25日发布的《关于凯石源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》，截至2020年12月23日日终，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形，本基金根据基金合同约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金最后运作日为2020年12月23日，自2020年12月24日起，本基金进入基金财产清算程序，停止办理申购（含定投）、赎回、转换等业务。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费等费用。

## 四. 财务会计报告

### 4.1 基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：凯石源混合型证券投资基金

报告截止日：2020年12月23日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2020 年 12 月 23 日 (基金最后运作日)
<b>资产：</b>	
银行存款	636,060.64
交易性金融资产	818,840.00
其中：股票投资	818,840.00
应收利息	17.85
应收申购款	12,610.80
<b>资产总计</b>	<b>1,467,529.29</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负债：</b>	
应付赎回款	55,116.77
应付管理人报酬	844.77
应付托管费	211.19
应付销售服务费	231.61
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
其他负债	55,005.29
<b>负债合计</b>	<b>111,409.63</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	999,559.86
未分配利润	356,559.80
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,356,119.66</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,467,529.29</b>

注：1. 报告截止日 2020 年 12 月 23 日(基金最后运作日)，基金份额总额 999,559.86 份，其中凯石源混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.3644 元，基金份额总额 500,885.38 份；凯石源混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.3490 元，基金份额总额 498,674.48 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 23 日(基金最后运作日)止期间。

## 五. 清算事项说明

根据《凯石源混合型证券投资基金基金合同》约定，自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。自 2020 年 12 月 24 日至 2021 年 1 月 11 日止的清算期间，本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 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 636,060.64 元，本基金的银行存款为托管户活期存款以及存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 818,840.00 元，全部为股票资产。本基金于 2020 年 12 月 24 日将最后运作日持有的其他交易性股票投资变现，成交金额为 820,311.00 元。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 17.85 元，其中应收银行存款利息为人民币 4.38 元、应收券商资金户存款利息为人民币 13.47 元；自 2020 年 12 月 24 日本基金进入清算程序起至本财务报表批准报出日(2021 年 1 月 11 日)止期间，本基金银行存款产生的利息收入归基金份额持有人所有。款项将于结息时按实际金额划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 12,610.80 元，该款项已于 2020 年 12 月 31 日前划入托管账户完毕。

### 5.2 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 55,116.77 元，该款项已于 2020 年 12 月 31 日前支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 844.77 元，该款项已于 2020 年 12 月 31 日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 211.19 元，该款项已于 2020 年 12 月 31 日前支付完毕。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 231.61 元，该款项已于 2020 年 12 月 31 日前支付完毕。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 55,005.29 元，其中应付赎回费为人民币 5.29 元，该款项已于 2020 年 12 月 31 日前支付完毕；预提信息披露费 10,000.00 元、预提审计费 45,000.00 元该款项已于 2020 年 12 月 31 日前支付完毕。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2020 年 12 月 24 日至 2021 年 1 月 11 日 清算期间
一、收益	
存款利息收入（注 1）	248.01
投资收益（注 2）（损失以“-”填列）	33,396.91
公允价值变动损益（注 3）	-32,604.91
其他收入	204.53
二、费用	
交易费用	1,485.76
其他费用（注 4）	20,000.00
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-20,241.22

注 1：存款利息收入主要系计提的清算期间的银行存款利息及基金结算机构的证券账户利息。

注 2：投资收益系清算期间的股票投资差价收入。

注 3：公允价值变动损益系清算期间的股票投资产生的公允价值变动。

注 4：其他费用系清算期间所产生的律师费。

### 5.4 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、最后运作日基金净资产	1,356,119.66
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-20,241.22
减：基金净赎回金额（净申购以“-”填列）	-12,750.05
二、清算结束日基金净资产	1,348,628.49

---

资产处置及负债清偿后，于清算结束日 2021 年 1 月 11 日本基金剩余财产为人民币 1,348,628.49 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、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 2021 年 1 月 12 日至清算款划出日前一日的银行存款、基金结算机构的证券账户利息亦属份额持有人所有。截至清算款划出日前一日的银行存款、基金结算机构的证券账户利息中仍未收到的部分将由基金管理人以自有资金垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。基金管理人所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，报中国证监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》等规定及时分配。

## 六. 备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

6.1.1 《凯石源混合型证券投资基金清算审计报告》

6.1.2 《关于凯石源混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》

6.2 存放地点上海市黄浦区延安东路1号2楼

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。

凯石源混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二一年一月十一日