

# 广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）清算报告

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日期：2020年6月3日

报告公告日期：2020年7月29日

# 目录

1. 重要提示 .....	2
2. 基金概况 .....	3
3. 基金运作情况说明 .....	4
4. 财务报告 .....	5
5. 清算事项说明 .....	6
6. 备查文件目录 .....	10

## 1. 重要提示

广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据证监许可[2016]2341号文募集的广发鑫瑞混合型证券投资基金的基金合同已于2017年3月3日生效，根据《广发鑫瑞混合型证券投资基金基金合同》及《广发鑫瑞混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，封闭期届满后，自2018年9月4日起转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）”（以下简称“本基金”）。详见基金管理人于2018年8月31日发布的《广发基金管理有限公司关于广发鑫瑞混合型证券投资基金转为上市开放式基金（LOF）的公告》。

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》、《广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，2020年3月19日至2020年4月19日止，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。于2020年4月20日，本基金基金份额持有人大会审议并通过了《关于终止广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）基金合同相关事项的议案》。根据基金管理人于2020年4月23日公布的《关于广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）终止上市并终止申购赎回的公告》，本基金自2020年4月28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。

2020年6月3日为本基金清算的最后一日，由本基金管理人广发基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和广东广信君达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，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，广东广信君达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	广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	广发鑫瑞混合（LOF）
场内简称	广发鑫瑞
基金主代码	162718
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月3日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
最后运作日基金份额总额	11,255,695.08份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性基础上，通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	在封闭期内，本基金在深入研究、严格控制风险的基础上，通过投资固定收益类金融工具以及定向增发（非公开发行股份）主题的股票，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳健增值。转为LOF后本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。

### 3. 基金运作情况说明

广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据证监许可[2016]2341号文募集的广发鑫瑞混合型证券投资基金的基金合同已于2017年3月3日生效，首次设立募集规模为213,936,709.46份基金份额。根据本基金的管理人于2018年8月31日公告的《广发基金管理有限公司关于广发鑫瑞混合型证券投资基金转为上市开放式基金（LOF）的公告》，本基金的封闭期自2017年3月3日起至2018年9月3日止，自2018年9月4日起本基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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》、《广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，2020年3月19日至2020年4月19日止，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。于2020年4月20日，本基金基金份额持有人大会审议并通过了《关于终止广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）基金合同相关事项的议案》。根据基金管理人于2020年4月23日公布的《关于广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）终止上市并终止申购赎回的公告》，本基金最后运作日为2020年4月27日，自2020年4月28日起进入基金财产清算程序。

## 4. 财务报告

### 4.1 基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020年4月27日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2020年4月27日
<b>资产：</b>	
银行存款	17,682,625.96
存出保证金	6,156.61
应收利息	13,561.34
资产总计	17,702,343.91
<b>负债：</b>	
应付赎回款	6,263,637.32
应付管理人报酬	22,303.11
应付托管费	3,717.19
其他负债	123,670.90
负债合计	6,413,328.52
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	11,255,695.08
未分配利润	33,320.31
所有者权益合计	11,289,015.39
负债和所有者权益总计	17,702,343.91

注1：报告截止日2020年4月27日（基金最后运作日），本基金基金份额单位净值为1.003，基金份额总额为11,255,695.08份。

注2：本基金的清算财务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。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

## 5. 清算事项说明

### 5.1 广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）简介

#### 5.1.1 基本情况

广发鑫瑞混合型证券投资基金经中国证监会证监许可【2016】2341号《关于准予广发鑫瑞混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《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《广发鑫瑞混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于2017年3月3日募集成立。根据本基金的管理人于2018年8月31日公告的《广发基金管理有限公司关于广发鑫瑞混合型证券投资基金转为上市开放式基金（LOF）的公告》，自2018年9月4日起本基金转换为上市开放式基金（LOF）。基金名称变更为广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）（“本基金”）。

本基金的投资范围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上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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）。

本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。

根据《广发基金管理有限公司关于广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）终止上市并终止申购赎回的公告》，本基金于2020年4月28日终止办理申购、赎回、转换、定投及转托管等业务并进入清算程序，基金财产将在清算完毕后进行分配。

#### 5.1.2 清算原因

2020年3月19日起至2020年4月19日15:00止，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。于2020年4月20日，本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于终止广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）基金合同相关事项的议案》。根据基金管理人于2020年4月23日公布的《广发基金管理有限公司关于广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）终止上市并终止申购赎回

的公告》，本基金从 2020 年 4 月 28 日起进入清算期，基金管理人将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。

### 5.1.3 清算期间

根据《广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）基金合同》约定，本基金终止的 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。2020 年 4 月 27 日为本基金的终止日。本基金的清算期间为自 2020 年 4 月 28 日至 2020 年 6 月 3 日止（以下简称“清算期间”），2020 年 6 月 3 日为本基金的清算期间结束日。

## 5.2 清算财务报表编制基础

本基金的清算财务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。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

## 5.3 清算情况

于清算期间，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：

### 5.3.1 资产处置情况

本基金最后运作日应收利息为人民币 13,561.34 元，为应收银行存款利息和应收保证金利息，款项将于结息时按实际金额划入托管账户。

### 5.3.2 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 6,263,637.32 元，该款项已于 2020 年 6 月 3 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 22,303.11 元，该款项已于 2020 年 6 月 3 日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,717.19 元，该款项已于 2020 年 6 月 3 日前支付完毕。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 123,670.90 元，主要为账户维护费、信披费、审计费、银行手续费及应付赎回费。截至清算期间结束日 2020 年 6 月 3 日，除银行手续费人民币 55.00 元还未支付外，其他费用均已支付完毕。

### 5.3.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2020年4月28日 至2020年6月3日 止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
存款利息收入（注1）	3,302.73
其他收入（注2）	33.09
二、费用	
其他费用（注3）	10,067.14
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-6,731.32

注1：存款利息收入系计提的清算期间的银行存款利息和保证金利息。

注2：其他收入系投资者在最后运作日申请赎回所产生的基金赎回费收入。

注3：其他费用系清算期间所产生的银行手续费、律师费及审计费。

### 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2020年4月27日基金净资产	11,289,015.39
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-6,731.32
减：基金净赎回金额（于清算期间确认的最后运作日赎回申请）	2,343,302.39
二、2020年6月3日基金净资产	8,938,981.68

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。

## 6.备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

6.1.1 《广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）清算审计报告》

6.1.2 《关于广发基金管理有限公司广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）基金财产清算之法律意见书》

### 6.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33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。

广发鑫瑞混合型证券投资基金（LOF）基金财产清算小组

二〇二〇年七月二十九日