

广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告出具日期：2024年12月6日

报告公告日期：2025年2月17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 | 9 |

1. 重要提示

广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可〔2020〕2824 号文准予注册，于 2021 年 2 月 3 日成立并正式运作。本基金基金管理人为广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）约定：“本基金基金合同生效满三年后，在每个开放期届满之日，若基金资产净值低于 5000 万元，基金合同自动终止，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会。”本基金基金合同生效已满三年，最近一个开放期为 2024 年 11 月 1 日至 2024 年 11 月 28 日，截至 2024 年 11 月 28 日日终，本基金的基金资产净值低于 5000 万元人民币，触发基金合同终止的上述情形，基金管理人将终止基金合同，并按照基金合同的约定履行基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。本基金自 2024 年 11 月 29 日起进入基金财产清算程序。

由于本基金持有的锁定期限售股票无法确定变现时间，本基金计划进行两次清算，其中第一次清算期间为 2024 年 11 月 29 日至 2024 年 12 月 6 日止，第二次清算期间将根据锁定期限售股票的变现时间确定。由基金管理人广发基金管理有限公司、基金托管人上海银行股份有限公司、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 | 广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 广发瑞轩三个月定开混合 |
| 基金代码 | 010628 |
| 基金运作方式 | 契约型、定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 2 月 3 日 |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 |
| 最后运作日（2024 年 11 月 28 日）基金份额总额 | 50,000,332.90 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。 |
| 投资策略 | 具体包括：1.大类资产配置；2.股票投资策略；3.债券投资策略；4.资产支持证券投资策略；5.金融衍生品投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中债综合财富（总值）指数收益率×40% |
| 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。 |

3. 基金运作情况说明

广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可〔2020〕2824号《关于准予广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式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《广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》公开募集，自2020年12月25日至2021年2月2日向社会公开发行募集并于2021年2月3日正式成立。本基金为契约型、定期开放式基金，存续期限不定期，募集资金总额为人民币1,009,996,000.00元。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》约定：“本基金基金合同生效满三年后，在每个开放期届满之日，若基金资产净值低于5000万元，基金合同自动终止，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会。”本基金基金合同生效已满三年，最近一个开放期为2024年11月1日至2024年11月28日，截至2024年11月28日日终，本基金的基金资产净值低于5000万元人民币，触发基金合同终止的上述情形，基金管理人将终止基金合同，并按照基金合同的约定履行基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。详见基金管理人发布的《关于广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后运作日为2024年11月28日，自2024年11月29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：广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 11 月 28 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| | 最后运作日 2024 年 11 月 28 日 |
|-------------|---------------------------|
| 资 产： | |
| 货币资金 | 213,745,953.83 |
| 结算备付金 | 239,531.49 |
| 存出保证金 | 1,017,969.63 |
| 交易性金融资产 | 16,971,591.67 |
| 其中：股票投资 | 16,755,029.83 |
| 债券投资 | 216,561.84 |
| 应收清算款 | 36,475,017.77 |
| 资产总计 | 268,450,064.39 |
| 负 债： | |
| 应付赎回款 | 240,109,400.27 |
| 应付管理人报酬 | 670,516.26 |
| 应付托管费 | 37,250.93 |
| 应交税费 | 37.72 |
| 其他负债 | 463,995.80 |
| 负债合计 | 241,281,200.98 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 50,000,332.90 |
| 未分配利润 | -22,831,469.49 |
| 净资产合计 | 27,168,863.41 |
| 负债和净资产总计 | 268,450,064.39 |

注 1：报告截止日 2024 年 11 月 28 日（基金最后运作日），本基金基金份额单位净值为 0.5434，基金份额总额为 50,000,332.90 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财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。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

根据《广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》约定：“本基金基金合同生效满三年后，在每个开放期届满之日，若基金资产净值低于 5000 万元，基金合同自动终止，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会。”本基金基金合同生效已满三年，最近一个开放期为 2024 年 11 月 1 日至 2024 年 11 月 28 日，截至 2024 年 11 月 28 日日终，本基金的基金资产净值低于 5000 万元人民币，触发基金合同终止的上述情形，基金管理人将终止基金合同，并按照基金合同的约定履行基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。

2024 年 11 月 28 日为本基金的最后运作日。由于本基金持有的锁定期限售股票无法确定变现时间，本基金计划进行两次清算，其中第一次清算期间为 2024 年 11 月 29 日至 2024 年 12 月 6 日止（以下简称“清算期间”），第二次清算期间将根据锁定期限售股票的变现时间确定。

于第一次清算期间，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 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日货币资金为人民币 213,745,953.83 元，其中银行存款本金为人民币 213,270,256.24 元，银行存款应计利息为人民币 475,697.59 元，上述银行存款应计利息将于清算结束日后划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 239,531.49 元，为上海证券交易所的最低备付金本金及其应计利息，以及深圳证券交易所的最低备付金应计利息，将于清算结束日后划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 1,017,969.63 元，为上海证券交易所的结算保证金本金及其应计利息，以及深圳证券交易所的结算保证金本金及其应计利息，将于清算结束日后划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 16,971,591.67 元，为股票投资与债券投资，其中股票投资成本为人民币 15,930,977.98 元，最后运作日估值为人民币 16,755,029.83 元；债券投资成本为人民币 219,000.00 元，最后运作日估值为人民币 216,561.84 元。除部分因在锁定期限售而未能变现的股票外，本基金所持其余交易性金融资产均已于 2024 年 12 月 6 日前完成变现，并于 2024 年 12 月 6 日前划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 36,475,017.77 元，已于 2024 年 12 月 6 日前划入托管账户。

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240,109,400.27元，该款项已于2024年12月6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670,516.26元，该款项已于2024年12月6日前支付完毕。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币37,250.93元，该款项已于2024年12月6日前支付完毕。
- (4) 本基金最后运作日应付税费为人民币37.72元，该款项已于2024年12月6日前支付完毕。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币463,995.80元，包括应付交易费用人民币285,400.09元、预提证券时报信息披露费人民币109,180.71元、预提审计费人民币66,000.00元及应付划款手续费人民币3,415.00元。其中，应付划款手续费已于2024年12月6日前支付完毕，其余款项将于2024年12月6日后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

| 单位：人民币元 | |
|---------------------|--------------------------------------|
| 项目 | 自2024年11月29日 至2024年12月6日 止清算期间 |
| 一、收益（损失以“-”填列） | |
| 利息收入（注1） | 9,425.41 |
| 投资收益（注2）（损失以“-”填列） | 1,042,154.89 |
| 公允价值变动损益（注3） | -455,389.08 |
| 二、费用 | |
| 其他费用（注4） | 20,200.00 |
| 三、清算期间净收益（损失以“-”填列） | 575,991.22 |

- 注1：利息收入系清算期间的银行存款利息、备付金利息和保证金利息。
- 注2：投资收益系清算期间处置交易性金融资产形成的损益。
- 注3：公允价值变动损益系清算期间股票投资和债券投资产生的公允价值变动，以及清算期间处置部分持有的股票投资和债券投资，同时将原计入该股票投资和债券投资的公允价值变动转出至投资收益的金额。
- 注4：其他费用系清算期间所产生的银行汇划费、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、最后运作日基金净资产 | 27,168,863.41 |

| | |
|------------------------------|---------------|
| 加：清算期间净收益（损失以“-”填列） | 575,991.22 |
| 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） | 21,736,000.00 |
| 二、清算结束日基金净资产 | 6,008,854.63 |

根据本基金基金合同约定，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。

于本次清算结束日2024年12月6日，本基金剩余财产为人民币6,008,854.63元。本基金剩余财产中包含尚未变现的交易性金融资产人民币701,717.88元，该金额为锁定期限售股票于本次清算结束日的估值金额，与锁定期限售股票流通后实际变现金额可能存在差异。上述剩余未变现的资产将根据变现情况在第二次清算时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 《广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金清算审计报告》

6.1.2 《关于广发基金管理有限公司广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金财产清算的法律意见书》

6.2 存放地点

广东省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。

广发瑞轩三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

二〇二五年二月十七日