

万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年5月13日

清算报告公告日：2024年5月21日

一、重要提示

万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]733号文《关于准予万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为管理人于2017年11月15日至2018年1月26日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2018]第ZA30020号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2018年2月2日生效。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《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》、《万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金份额持有人大会已于2024年4月9日起，至2024年5月6日通过通讯方式召开。本次基金份额持有人大会于2024年5月7日表决通过了《关于终止万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

本基金自2024年5月8日（含）起进入清算期，由基金管理人万家基金管理有限公司、基金托管人上海银行股份有限公司、立信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2024年5月8日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由立信会计师事务所（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。

二、基金概况

- 1、基金名称：万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、《基金合同》生效日：2018年2月2日
- 4、基金管理人：万家基金管理有限公司
- 5、基金托管人：上海银行股份有限公司
- 6、2024年5月7日基金份额总额：9,724,045.60份（其中万家瑞舜灵活配置混合A份额：6,968,310.22份，其中万家瑞舜灵活配置混合C份额：2,755,735.38份）
- 7、投资目标：本基金通过灵活运用股票资产投资策略、债券资产投资策略等多种投资策略，充分挖掘潜在的投资机会，追求基金资产长期稳定增值。
- 8、投资策略：（1）股票资产投资策略；（2）债券资产投资策略；（3）中小企业私募债券投资策略；（4）股指期货投资策略；（5）国债期货投资策略；（6）股票期权投资策略；（7）权证投资策略；（8）融资交易策略；（9）资产支持证券投资策略。
- 9、业绩比较基准：沪深300指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
- 10、风险收益特征：本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。

三、基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2017]733号文的核准,《基金合同》于2018年2月2日生效。自2018年2月2日至2024年5月7日期间,本基金按《基金合同》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》、《基金合同》的有关规定,本基金基金份额持有人大会已于2024年4月9日起,至2024年5月6日通过通讯方式召开。本次基金份额持有人大会于2024年5月7日表决通过了《关于终止万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。本基金从2024年5月8日起进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表(已经审计)

会计主体:万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2024年5月7日

单位:人民币元

最后运作日:2024年5月7日	
资产:	
货币资金	341,619.70
结算备付金	835,061.39
存出保证金	12,635.47
交易性金融资产	5,756,940.62
其中:股票投资	691,800.00
基金投资	-
债券投资	5,065,140.62
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	3,900,000.00
债权投资	-
其中:债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	62,057.17
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-

资产总计	10,908,314.35
负债和净资产：	
负 债：	
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	-
应付清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	1,454.12
应付托管费	207.74
应付销售服务费	114.41
应付投资顾问费	-
应交税费	248.43
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	13,805.32
负债合计	15,830.02
净资产：	
实收基金	9,724,045.60
其他综合收益	-
未分配利润	1,168,438.73
净资产合计	10,892,484.33
负债和净资产总计	10,908,314.35

注：截至 2024 年 5 月 7 日（基金最后运作日），万家瑞舜灵活配置混合 A 份额总额 6,968,310.22 份，基金份额净值 1.1327 元，基金资产净值 7,893,090.40 元；万家瑞舜灵活配置混合 C 份额总额 2,755,735.38 份，基金份额净值 1.0884 元，基金资产净值 2,999,393.93 元。

五、基金财产分配

自2024年5月8日至2024年5月13日止的清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《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剩余财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的律师费将由基金管理人承担。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日货币资金余额为 341,619.70 元。其中，银行活期存款为 341,362.44 元，存放于托管账户；应计银行存款利息为 257.26 元，由基金管理人以自有

资金先行垫付。

(2) 本基金最后运作日结算备付金余额为 835,061.39 元。其中, 期货备付金为 436,740.98 元, 已于 5 月 8 日全部划款至托管户; 应计期货备付金利息为 940.05 元, 已于 5 月 9 日全部划款至托管户; 最低清算备付金为 396,686.76 元, 已于 5 月 13 日划款至托管户 121,771.60 元; 应计最低清算备付金利息为 693.60 元。剩余部分款项由基金管理人以自有资金先行垫付。

(3) 本基金最后运作日存出保证金余额为 12,635.47 元。其中, 存出保证金为 12,603.76 元; 应计存出保证金利息为 31.71 元。该部分款项由基金管理人以自有资金先行垫付。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产余额为 5,756,940.62 元, 其中交易所股票投资公允价值为 691,800.00 元、交易所债券投资公允价值为 5,065,140.62 元。本基金持有的交易性金融资产已于 5 月 8 日、5 月 9 日全部变现完毕, 合计清算金额为 5,757,179.80 元。

(5) 本基金最后运作日买入返售金融资产余额为 3,900,000.00 元, 已于 5 月 8 日到期, 清算金额为 3,900,201.95 元。

(6) 本基金最后运作日应收清算款余额为 62,057.17 元, 已于 5 月 10 日前完成所有资金交收, 余额划款至托管户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 1,454.12 元, 该款项已于 2024 年 5 月 10 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为 207.74 元, 该款项已于 2024 年 5 月 10 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为 114.41 元, 该款项已于 2024 年 5 月 10 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付税费为 248.43 元, 该款项已于 2024 年 5 月 10 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为 13,805.32 元。其中, 券商席位佣金为 3,030.00 元, 已于 2024 年 5 月 10 日支付; 上清所账户服务费为 1,951.75 元, 已于 2024 年 5 月 10 日支付; 中债账户服务费为 1,829.65 元, 已于 2024 年 5 月 9 日支付; 应付审计费共计为 6,993.92 元, 在收到审计发票后支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

	自2024年5月8日至2024年5月13日的清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入	1,343.16
存款利息收入(注1)	1,147.09
买入返售金融资产收入	196.07
2、投资收益(损失以“-”号填列)(注2)	85,354.81
股票投资收益	36,289.91
债券投资收益	49,064.90

3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）（注3）	-85,729.21
清算收入小计	968.76
二、清算期间费用	
1、其他费用（注4）	2,679.60
清算费用小计	2,679.60
三、清算净收益	-1,710.84

注：（1）存款利息收入系计提自2024年5月8日至2024年5月13日止清算期间的银行存款、清算备付金和存出保证金。

（2）投资收益系清算期间持有的交易性金融资产产生的利息收入和处置产生的差价收入，同时将原计入该金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

（3）公允价值变动收益系清算期间卖出股票、债券时转出的公允价值变动累计金额。

（4）其他费用系清算期间产生的中债、上清账户维护费和银行汇划费。

5、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2024年5月7日基金净资产	10,892,484.33
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-1,710.84
减：基金净赎回转出金额	378.21
二、清算结束日2024年5月13日基金净资产	10,890,395.28

截至2024年5月13日，本基金剩余净资产为10,890,395.28元，其中万家瑞舜灵活配置混合A基金资产净值为7,891,850.61元，万家瑞舜灵活配置混合C基金资产净值为2,998,544.67元。资产处置及负债清偿后，将根据本基金的《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2024年5月14日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息归基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人万家基金管理有限公司将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。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。

6、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书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

- （1）《万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- （2）《上海市通力律师事务所关于〈万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2024年5月13日（清算报告出具日期）