

国金基金管理有限公司
国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
清算报告

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：2024 年 4 月 30 日

清算报告公告日：2024 年 5 月 9 日

一、重要提示

国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF），基金代码：501000，基金简称“国金鑫新灵活配置（LOF）”，场内简称为“国金鑫新”（以下简称“本基金”）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[2015]928 号文件准予注册募集，于 2015 年 7 月 3 日正式运作。基金管理人为国金基金管理有限公司（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”）。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人利益，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《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）等有关规定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，于 2024 年 2 月 6 日发布《关于以通讯方式召开国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》，审议《关于终止国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》。本基金份额持有人大会投票表决起止时间自 2024 年 2 月 7 日起，至 2024 年 3 月 11 日 15:00 止。本次会议议案于 2024 年 3 月 12 日有效通过，大会决议自通过之日起生效，基金管理人于 2024 年 3 月 13 日发布《关于国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，于公告的当日起，本基金进入清算期。

本基金自 2024 年 3 月 13 日起进入清算程序。基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2024 年 3 月 13 日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，由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

基金名称	国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	国金鑫新灵活配置（LOF）
基金代码	501000
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 3 日
基金最后运作日（2024 年 3 月 12 日）基金份额总额	1,865,767.04 份
投资目标	本基金通过合理的资产配置和积极的证券选择，追求在严格控制风险的前提下实现资本的长期稳健回报。
主要投资策略	本基金将根据对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在权益类资产投资方面，本基金将综合运用定量分析和定性分析手段，精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合。在固定收益类资产投资方面，本基金会深入研究分析宏观经济和利率趋势，选择流动性好，到期收益率与信用质量相对较高的债券品种进行投资。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、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。
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

三、基金运作情况

国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）经中国证监会证监许可[2015]928 号文准予注册募集。由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自 2015 年 6 月 8 日至 2015 年 6 月 25 日止向社会公开发行募集，本基金基金合同于 2015 年 7 月 3 日正式生效。基金合同生效日的基金总份额为 204,137,143.70 份。自 2015 年 7 月 3 日至 2024 年 3 月 12 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

根据《基金合同》等有关规定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，并经本基金基金份额持有人大会投票表决，本次会议议案于 2024 年 3 月 12 日有效通过，大会决议自通过之日起生效，本基金 2024 年 3 月 13 日起进入清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2024 年 3 月 12 日

单位：人民币元

	最后运作日 2024 年 3 月 12 日
资产：	
货币资金	67,287.69
结算备付金	87,127.70
存出保证金	4,734.55
交易性金融资产	506,079.45
买入返售金融资产	600,000.00
应收清算款	302,572.01
应收申购款	445.23
资产总计	1,568,246.63
负债：	
应付赎回款	26,846.63
应付管理人报酬	673.63
应付托管费	56.15
应付税费	0.75
其他负债	50,546.26
负债合计	78,123.42
净资产：	
实收基金	1,865,767.04
未分配利润	-375,643.83
净资产合计	1,490,123.21
负债和净资产总计：	1,568,246.63

注：1、本基金最后运作日 2024 年 3 月 12 日，国金鑫新灵活配置（LOF）基金份额为 1,865,767.04 份，基金资产净值为 1,490,123.21 元，单位净值为 0.799 元。

2、本基金的清算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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自 2024 年 3 月 13 日至 2024 年 4 月 30 日止清算期间，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：

（一）清算费用

根据《基金合同》“第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的约定：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财产中支付。

（二）资产处置情况

1、本基金最后运作日货币资金为人民币 67,287.69 元，其中包含活期存款应计利息人民币 234.89 元。清算期间产生活期存款利息人民币 674.81 元，活期存款利息人民币 331.65 元已于 2024 年 3 月 21 日划入托管账户。截至 2024 年 4 月 30 日，活期存款余额为人民币 1,467,202.19 元，其中包含应计活期存款利息余额为人民币 578.05 元。活期存款应计利息将于下一银行结息日 2024 年 6 月 21 日划付至托管账户；

2、本基金最后运作日结算备付金为人民币 87,127.70 元，其中上海结算备付金为人民币 79,813.73 元，应计上海结算备付金利息为人民币 317.81 元，深圳结算备付金为人民币 2,062.56 元，应计深圳结算备付金利息为人民币 12.04 元，期货结算备付金为人民币 4,921.56 元。上海结算备付金人民币 56,670.87 元和深圳结算备付金人民币 2,062.56 元已于 2024 年 4 月 10 日划至托管账户，期货结算备付金人民币 4,921.56 元已于 2024 年 3 月 14 日划至托管账户，清算期间产生上海结算备付金利息人民币 122.51 元，产生深圳结算备付金利息人民币 2.56 元，上海结算备付金利息人民币 346.68 元和深圳结算备付金利息人民币 12.80 元已于 2024 年 3 月 21 日划入托管账户。截至 2024 年 4 月 30 日，结算备付金余额为人民币 23,238.30 元，其中上海结算备付金为人民币 23,142.86 元，该款项将于清算期后划付至托管账户；上海结算备付金应计利息为人民币 93.64 元，深圳结算备付金应计利息为人民币 1.80 元，该款项将于下一银行结息日 2024 年 6 月 21 日划付至托管账户；

3、本基金最后运作日存出保证金为人民币 4,734.55 元，其中上海存出保证

金为人民币 3,600.68 元，应计上海存出保证金利息为人民币 34.52 元，深圳存出保证金为人民币 1,094.98 元，应计深圳存出保证金利息为人民币 4.37 元。上海存出保证金人民币 3,600.68 元和深圳存出保证金人民币 1,094.98 元已于 2024 年 4 月 2 日划至托管账户。清算期间产生上海存出保证金利息人民币 3.16 元，产生深圳存出保证金利息人民币 0.80 元，上海存出保证金利息人民币 35.76 元和深圳存出保证金利息人民币 4.57 元已于 2024 年 3 月 21 日划入托管账户。截至 2024 年 4 月 30 日，存出保证金余额为人民币 2.52 元，全部为上海和深圳存出保证金应计利息，其中上海存出保证金应计利息为人民币 1.92 元，深圳存出保证金应计利息为人民币 0.60 元。该款项将于下一银行结息日 2024 年 6 月 21 日划付至托管账户；

4、本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 506,079.45 元，全部为债券投资。明细如下：

金额单位：人民币元

交易平 台	债券名 称	债券代 码	最后运 作日单 价	数量	最后运 作日 市值总 额	最后运 作日应 计利息	最后运作日 估值总额
上交所	23 国债 24	019727	100. 34	5,000	501,700. 00	4,379.45	506,079.45

以上债券投资于清算期处置变现，处置净收益为人民币60.00元，处置期间未产生交易费用，清算期间计提的债券利息为人民币31.51元，变现产生的清算款为人民币506,170.96元，该款项已于清算期内收到；

5、本基金最后运作日买入返售金融资产余额为人民币 600,000.00 元，清算期间产生买入返售金融资产款利息人民币 63.65 元。买入返售金融资产已于清算期间到期，到期产生的清算款项已于清算期内收到；

6、本基金最后运作日应收清算款为人民币 302,572.01 元，该款项已于清算期内收到；

7、本基金最后运作日应收申购款为人民币 445.23 元，其中包含应收申购款应计利息人民币 45.83 元。以上款项已于清算期内划至托管账户。

（三）负债清偿情况

（1）基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 673.63 元，已于清算期内支

付；

(2) 基金最后运作日应付赎回款为人民币 26,846.63 元，清算期间发生应付赎回款人民币 639.20 元，合计为人民币 27,485.83 元，已于清算期内支付；

(3) 基金最后运作日应付托管费为人民币 56.15 元，已于清算期内支付；

(4) 基金最后运作日应交税费为人民币 0.75 元，已于清算期内支付；

(5) 基金最后运作日其他负债为人民币 50,546.26 元，其中，预提 2023 年度审计费人民币 50,000 元，应付交易费用人民币 546.26 元，上述款项合计人民币 50,546.26 元已于清算期内支付。

(四) 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元	
项目	自 2024 年 3 月 13 日 至 2024 年 4 月 30 日 止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注 1）	867.49
处置交易性金融资产产生的净收益（注 2）	91.51
清算收益小计	959.00
二、清算期间费用（注 3）	
清算费用小计	-
三、清算期间净损益	959.00

注 1：利息收入系清算期间产生的银行活期存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息及买入返售金融资产利息。

注 2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出债券成交金额扣除最后运作日债券市值的净额。

注 3：清算审计费、律师费、公证费等与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

(五) 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元	
项目	金额
最后运作日 2024 年 3 月 12 日基金净资产	1,490,123.21
加：清算期间净损益	959.00

减：基金净赎回金额	639.20
2024 年 4 月 30 日净资产	1,490,443.01

截至本次清算期结束日 2024 年 4 月 30 日，本基金剩余财产为人民币 1,490,443.01 元。自本次清算期结束日次日 2024 年 5 月 1 日至清算款分配划出日前一日的银行存款等产生的利息归份额持有人所有，按实际适用的利率计算，由基金管理人以自有资金垫付并于清算款划出前划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

（六）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。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进行分配剩余财产。

六、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）清算报表审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于<国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）清算报告>的法律意见》

（二）存放地点

基金管理人的办公场所。

（三）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。

国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

基金财产清算小组

2024年5月9日

《国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）清算报告》签署页

基金管理人：国金基金管理有限公司（盖章）

基金托管人：平安银行股份有限公司（盖章）