

国金基金管理有限公司
国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金
清算报告

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日期：2024年6月20日

清算报告公告日期：2024年6月26日

一、重要提示

国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金，基金简称“国金鑫瑞灵活”（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]2437号文准予注册募集，于2017年9月13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”），基金托管人为兴业银行股份有限公司（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《国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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4月19日发布《关于以通讯方式召开国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议《关于终止国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”）。本基金份额持有人大会投票表决起止时间自2024年4月20日起，至2024年5月20日15:00止。本基金管理人于2024年5月22日发布《关于国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金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5月22日起进入清算程序，由基金管理人、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5月22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	国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国金鑫瑞灵活
基金代码	002155
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月13日
基金最后运作日（2024年5月21日）基金份额总额	515,234.58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	1、资产配置策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、可转换债券投资策略 5、权证投资策略 6、股指期货投资策略
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%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，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	兴业银行股份有限公司

三、基金运作情况

国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]2437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2017年6月30日至2017年9月8日止向社会公开发行人募集，本基金基金合同于2017年9月13日正式生效。基金合同生效日的基金总份额（含利息结转的份额）为200,170,888.02份。自2017年9月13日至2024年5月21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5月21日有效通过，大会决议自通过之日起生效，本基金2024年5月22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：国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年5月21日

单位：人民币元

	最后运作日 2024年5月21日
资产：	
货币资金	4,174.33
结算备付金	15,336.23
存出保证金	5,964.25
交易性金融资产	284,505.92
买入返售金融资产	65,000.00
应收清算款	2,688.15
资产总计	377,668.88
负债：	
应付清算款	2,366.34
应付赎回款	200.15
应付管理人报酬	240.59
应付托管费	68.72
应付销售服务费	75.80
应付税费	1.80
其他负债	27,232.10
负债合计	30,185.50
净资产：	
实收基金	515,234.58
未分配利润	-167,751.20
净资产合计	347,483.38
负债和净资产总计：	377,668.88

注：1、本基金最后运作日 2024 年 5 月 21 日。

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》及其他规定编制的。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 5 月 22 日至 2024 年 6 月 20 日止为清算期间，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》“第十九部分 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 4,174.33 元，其中包含活期存款应计利息人民币 30.27 元。清算期间产生活期存款利息人民币 98.45 元，截至 2024 年 6 月 20 日，活期存款余额为人民币 358,912.65 元，其中包含应计活期存款利息余额为人民币 128.72 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 15,336.23 元，其中上海结算备付金为人民币 12,423.34 元，应计上海结算备付金利息为人民币 119.97 元，深圳结算备付金为人民币 623.02 元，应计深圳结算备付金利息为人民币 0.93 元，期货结算备付金为人民币 2,166.49 元，应计期货结算备付金利息为人民币 2.48 元。清算期间，收到上海结算备付金人民币 5,677.20 元，计提上海结算备付金利息人民币 14.20 元，收到深圳结算备付金人民币 407.03 元，计提深圳结算备付金利息人民币 0.70 元，收到期货结算备付金人民币 2,166.49 元，收到期货结算备付金利息人民币 2.24 元，结息产生期货结算备付金应计利息调整人民币 -0.24 元。截至 2024 年 6 月 20 日，结算备付金余额为人民币 7,097.93 元，其中上海结算备付金应计利息为人民币 134.17 元，深圳结算备付金应计利息为人民币 1.63 元。该款项将于清算期后划付至托管账户；

3、本基金最后运作日存出保证金为人民币 5,964.25 元，其中上海存出保证金为人民币 3,645.32 元，应计上海存出保证金利息为人民币 13.69 元，深圳存出保证金为人民币 2,298.33 元，应计深圳存出保证金利息为人民币 6.91 元。清算期间收到上海存出保证金人民币 3,645.32 元，计提上海存出保证金利息人民

币 2.08 元，收到深圳存出保证金人民币 2,298.33 元，计提深圳存出保证金利息人民币 1.30 元。截至 2024 年 6 月 20 日，存出保证金余额为人民币 23.98 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 15.77 元，深圳存出保证金应计利息为人民币 8.21 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 284,505.92 元，其中各明细资产最后运作日余额及清算情况如下：

本基金最后运作日股票投资为人民币 24,294.00 元，全部为已流通但尚未变现的股票，明细如下：

金额单位：人民币元

交易平台	股票名称	股票代码	最后运作日单价	数量	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
上交所	海螺水泥	600585	25.40	200.00	4,502.00	5,080.00
上交所	中船防务	600685	27.50	100.00	2,783.00	2,750.00
上交所	工商银行	601398	5.50	600.00	3,258.00	3,300.00
上交所	建设银行	601939	7.14	500.00	3,560.00	3,570.00
深交所	湖北宜化	000422	12.86	200.00	2,458.00	2,572.00
深交所	中兵红箭	000519	13.71	200.00	2,744.00	2,742.00

深交所	紫光股份	000938	22.55	100.00	2,237.00	2,255.00
深交所	易华录	300212	20.25	100.00	2,026.00	2,025.00

以上股票投资于清算期处置变现，处置净损失为人民币 46.84 元，其中处置期间产生交易费用为人民币 31.84 元，变现产生的清算款为人民币 24,265.30 元，该款项已于清算期内收到。

本基金最后运作日债券投资为人民币 260,211.92 元，全部为已流通但尚未变现的债券，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 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 16	019709	100.01	1,000.00	100,010.00	1,360.68	101,370.68
上交所	23 国债 20	019723	100.56	1,000.00	100,560.00	1,453.64	102,013.64
上交所	山鹰转债	110047	108.10	100.00	10,810.00	119.67	10,929.67
上交所	鹰 19 转债	110063	102.56	100.00	10,256.00	70.14	10,326.14
上交所	核建转债	113024	109.17	10.00	1,091.70	1.93	1,093.63
上交所	嘉泽转债	113039	126.81	10.00	1,268.10	8.91	1,277.01

上交所	长久转债	113519	114.97	60.00	6,898.20	51.55	6,949.75
上交所	大丰转债	113530	117.68	40.00	4,707.20	14.73	4,721.93
深交所	湖广转债	127007	106.40	60.00	6,384.00	86.27	6,470.27
深交所	希望转2	127049	112.41	50.00	5,620.50	17.62	5,638.12
深交所	凯中转债	128042	116.50	40.00	4,660.00	51.90	4,711.90
深交所	未来转债	128063	117.30	40.00	4,692.00	17.18	4,709.18

以上债券投资于清算期处置变现，处置净收益为人民币 882.27 元，其中处置期间产生交易费用为人民币 2.28 元，清算期间计提的债券利息为人民币 20.13 元，变现产生的清算款为人民币 261,094.35 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 65,000.00 元，清算期间产生买入返售金融资产款利息人民币 3.35 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 2,688.15 元，该款项已于清算期内收到。

（三）负债清偿情况

- 1、本基金最后运作日应付清算款为人民币 2,366.34 元，已于清算期内支付；
- 2、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 200.15 元，已于清算期内支付；
- 3、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 240.59 元，已于清算期内支付；
- 4、本基金最后运作日应付托管费为人民币 68.72 元，已于清算期内支付；

5、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 75.80 元，已于清算期内支付；

6、本基金最后运作日应交税费为人民币 1.80 元，已于清算期内支付；

7、本基金最后运作日其他负债为人民币 27,232.10 元，其中，预提 2024 年度审计费人民币 17,486.08 元，由于产品提前清算，预提审计费于清算期间冲回；应付交易费用人民币 6,086.72 元，应付中债账户维护费人民币 1,829.65 元，应付上清所账户维护费人民币 1,829.65 元，已于清算期内支付。清算期间产生应付交易费用人民币 18.14 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 5 月 22 日 至 2024 年 6 月 20 日 止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注 1）	119.84
处置交易性金融资产产生的净收益（注 2）	835.43
清算收益小计	955.27
二、清算期间费用（注 3）	
审计费	-17,486.08
银行手续费	90.00
税金及附加	0.02
清算费用小计	-17,396.06
三、清算期间净损益	18,351.33

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股票、债券成交金额减去卖出股票、债券最后运作日的估值总额及买卖股票、债券产生的交易费用后的差额。

注 3：清算审计费、律师费、公证费由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。由于产品提前清算，冲回 2024 年度审计费人民币 17,486.08 元。

（五）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
最后运作日 2024 年 5 月 21 日基金净资产	347,483.38

加：清算期间净损益	18,351.33
加：基金净申购金额	199.85
2024年6月20日净资产	366,034.56

截至本次清算期结束日 2024 年 6 月 20 日，本基金剩余财产为人民币 366,034.56 元。自本次清算期结束日次日 2024 年 6 月 21 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、《国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金清算报表审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于〈国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金清算报告〉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。

国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2024年6月26日

《国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金清算报告》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：兴业银行股份有限公司（盖章）