

新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2024年1月5日

清算报告公告日期：2024年1月18日

一、基金简介

1、基本情况

新华鑫泰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]500号文件《关于准予新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批准，新华基金管理股份有限公司于2017年6月12日至2017年7月28日向社会公开募集，首次募集资金总额275,893,870.93元，其中募集资金产生利息62,387.85元，并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2017]01360026号验资报告予以验证。2017年8月9日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不设定，本基金基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、权证、股指期货、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、现金等，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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为0-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

本基金从2023年12月25日起进入清算期，基金清算期自2023年12月25日起至2024年1月5日止，并由致同会计师事务所(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。

2、清算原因

根据基金合同第五部分“基金备案”中：“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模，《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或

者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规另有规定时，从其规定。”

截至 2023 年 12 月 20 日，本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已触发基金合同中约定的基金合同终止条款。根据基金合同有关约定，本基金将依据基金财产清算程序进行财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会审议。

3、清算起始日

根据《关于新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2023 年 12 月 25 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2023 年 12 月 25 日。

二、清算报表编制基础

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，本基金的清算报表并无比较期间的相关数据列示。

三、财务报告

资产负债表

会计主体：新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 24 日

单位：人民币元

项目	报告截止日：2023 年 12 月 24 日
资产：	
银行存款	2,831,597.12
结算备付金	73,470.20
存出保证金	18,837.92
交易性金融资产	5,075,064.00
应收清算款	1,057,374.82
资产总计	9,056,344.06
负债：	
应付管理人报酬	23,603.12
应付托管费	3,933.87
应付赎回款	1,051,927.32

其他负债	755,496.71
负债合计：	1,834,961.02
所有者权益：	
实收基金	6,588,572.38
未分配利润	632,810.66
净资产合计	7,221,383.04
负债和净资产合计	9,056,344.06

注：报告截止日 2023 年 12 月 24 日，基金份额净值 1.0960 元，基金份额 6,588,572.38 份。

四、清算情况

1、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2023 年 12 月 25 日 至 2024 年 1 月 5 日止清算期间
一、清算收入	
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	348.73
投资收益（注 2）	-1,497,221.22
公允价值变动损益（注 3）	1,351,110.22
其他业务收入（注 4）	215.48
清算收入小计	-145,546.79
二、清算费用	
汇款费（注 5）	136.76
交易费用（注 6）	6,457.44
清算费用小计	6,594.20
三、清算净收益	-152,140.99

注 1：利息收入系以当前适用的利率计提的自 2023 年 12 月 25 日至 2024 年 1 月 5 日止清算期间的银行存款、结算备付金及交易保证金的利息。

注 2：投资收益系基金最后运作日持有的股票资产变现产生的收益。

注 3：公允价值变动损益系基金最后运作日持有的股票资产在变现前产生的公允价值变动损益。

注 4：其他业务收入为最后运作日基金赎回业务产生的赎回费收入。

注 5：汇款费系 2023 年 12 月 25 日至 2024 年 1 月 5 日止清算期间产生的银行汇划手续

费。

注 6：交易费用系基金最后运作日持有的股票资产变现产生的费用。

2、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 2023 年 12 月 24 日基金净资产	7,221,383.04
加：清算期间净收益	-152,140.99
减：应付赎回款	2,099,715.14
二、2024 年 1 月 5 日基金净资产	4,969,526.91

五、停止运作后的清算损益情况说明

本基金于 2023 年 12 月 25 日起进入清算期，截至 2024 年 1 月 5 日，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 4,986,005.94 元（含应计利息 452.31 元），结算备付金 73,509.92 元（含应计利息 52.96 元），交易保证金 11.05 元（含应计利息 11.05 元）。预提费用（审计费用、信息披露费）等负债 90,000.00 元，基金净资产 4,969,526.91 元。

本基金的银行存款应计利息均为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，支付时以银行实际结算金额为准。考虑到本基金清算的实际情况，在清算期间产生的律师费等清算费用，均由基金管理人承担。

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。自 2023 年 12 月 25 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属于基金份额持有人所有，按实际适用的利率计算。因还需划付本基金运作产生的各项费用（如管理费、托管费、交易费用、预提费用等）以及清算款，由此产生的银行汇划费从基金财产中支付，实际金额以基金托管人实际收取为准。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- （1）新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告
- （2）关于《新华鑫泰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

基金管理人的办公住所

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人新华基金管理股份有限公司

客服电话：400-819-8866

新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年1月5日