

国金基金管理有限公司
国金鑫运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：中国光大银行股份有限公司

信息披露时间：二零一六年五月二十四日

一、重要提示

国金鑫运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证监许可[2015]1015号文核准募集，于2015年6月24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”），基金托管人为中国光大银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”或“光大银行”）。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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《国金鑫运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，提议终止《基金合同》。本基金基金份额持有人大会已于2015年11月12日至2015年12月11日期间以通讯方式召开，会议审议并于2015年12月14日通过了《关于终止国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，决定终止本基金《基金合同》。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见2015年12月15日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站（www.gfund.com）上的《国金基金管理有限公司关于国金鑫运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》。

本基金从2015年12月14日（结算后）起进入清算期，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2015年12月14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，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

（一）基金名称：

国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：国金鑫运灵活配置，基金代码：001465）

（二）基金运作方式：

契约型开放式

(三) 基金合同生效日:

2015年6月24日

(四) 2015年12月14日基金份额总额:

812,342.21 份

(五) 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。

(六) 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,本基金将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。

(七) 业绩比较基准:

一年期银行定期存款利率(税后)+3%

(八) 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。

(九) 基金管理人:

国金基金管理有限公司

(十) 基金托管人:

中国光大银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表(经审计)

会计主体:国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月14日

单位:人民币元

| | |
|------|----------------------|
| | 最后运作日 2015年12月14日 |
| 资产: | |
| 银行存款 | 1,217,596.65 |

| | |
|------------|--------------|
| 存出保证金 | 185,329.74 |
| 应收利息 | 3,043.76 |
| 交易性金融资产 | 68,850.00 |
| 资产总计 | 1,474,820.15 |
| 负债和所有者权益 | |
| 负 债: | |
| 应付管理人报酬 | 462.65 |
| 应付托管费 | 38.57 |
| 应付交易费用 | 285,018.69 |
| 负债合计 | 285,519.91 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 812,342.21 |
| 未分配利润 | 376,958.03 |
| 所有者权益合计 | 1,189,300.24 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,474,820.15 |

四、清盘事项说明

(一) 基本情况

国金鑫运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[2015]1015 号文《关于核准国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由国金基金管理有限公司于 2015 年 6 月 12 日至 2015 年 6 月 18 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2015）验字第 61004823_A04 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 2015 年 6 月 24 日正式生效，首次设立募集规模为人民币 2,544,931,816.38 元，折合 2,544,931,816.38 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）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)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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不低于基金资产的 5%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%；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以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%。

本基金基金份额持有人大会于 2015 年 12 月 14 日以通讯方式表决通过了《关于终止国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会议案自 2015 年 12 月 14 日起生效。根据持有人大会通过的议案及议案说明，本基金从 2015 年 12 月 14 日（结算后）起进入清算期。

（二）清算原因

本基金基金份额持有人大会通过《关于终止国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

（三）清算起始日

根据 2015 年 12 月 14 日本基金份额持有人大会通过的议案及议案说明，本基金于 2015 年 12 月 14 日（结算后）起进入清算期。

（四）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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自 2015 年 12 月 14 日（结算后）至 2016 年 2 月 25 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，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

按照《国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金合同》第二十一部分“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财产中支付。

(二) 资产处置情况

1、本基金最后运作日存出保证金为人民币 185,329.74 元，该款项已于 2016 年 1 月 5 日分别从上海及深圳的结算保证金账户划入托管账户。

2、本基金最后运作日应收利息为人民币 3,043.76 元，该款项已于 2015 年 12 月 21 日银行结息时划入托管账户。

3、本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 68,850.00 元，系因重大资产重组停牌而未能变现的流通受限股票，明细如下：

单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 终止日成本总额 | 终止日估值总额 |
|--------|------|-----------|--------|-----------|-----------|
| 000839 | 中信国安 | 2015-6-29 | 重大资产重组 | 91,137.96 | 68,850.00 |

中信国安于2015年12月28日处置变现，处置价格为人民币77,180.00元，扣除交易所收取的交易费用人民币84.02元，实际清算价格为人民币77,095.98元，该款项已于2015年12月29日划入托管账户。另外，因卖出股票所产生的补缴股息红利税人民币34.00元已于2015年12月30日支付，股票交易产生应支付的佣金人民币56.44元已于2016年1月6日支付。

(三) 负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 462.65 元，该款项已于 2015 年 12 月 30 日支付。

2、本基金最后运作日应付托管费为人民币 38.57 元，该款项已于 2015 年 12 月 30 日支付。

3、本基金最后运作日应付交易费用为人民币 285,018.69 元，该款项已于 2015 年 12 月 30 日支付。

(四) 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 自 2015 年 12 月 14 日 (结算后) 至 2016 年 2 月 25 日 止清算期间 |
|--------|---|
| 一、清算收益 | |

| | |
|-----------------------|------------|
| 1、利息收入（注 1） | 1,822.80 |
| 2、处置交易性金融资产产生的收益（注 2） | 8,296.00 |
| 清算收入小计 | 10,118.80 |
| 二、清算费用 | |
| 1、股票交易费用 | 140.46 |
| 2、审计费 | 15,000.00 |
| 3、律师费 | 60,000.00 |
| 4、公证费 | 12,000.00 |
| 清算费用小计 | 87,140.46 |
| 三、清算净收益 | -77,021.66 |

注1：利息收入系收到及计提的自2015年12月14日（结算后）至2016年2月25日止清算期间的银行存款利息及存出保证金利息。

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金额与最后运作日估值金额以及因卖出股票所产生的补缴股息红利税金额的差额。

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 2015 年 12 月 14 日基金净资产 | 1,189,300.24 |
| 加：清算期间净收益 | -77,021.66 |
| 二、2016 年 2 月 25 日基金净资产 | 1,112,278.58 |

资产处置及负债清偿后，于2016年2月25日本基金剩余财产为人民币1,112,278.58元，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，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。

清算起始日 2015 年 12 月 14 日（结算后）至清算款划出日前一日的应收利息亦属份额持有人所有。以上利息均按实际适用的利率计算，由基金管理人以自有资金垫付并已于清算终止前划入托管账户。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。

截至 2016 年 2 月 25 日止，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 1,114,632.84 元，其中人民币 3,980.64 元系基金管理人代垫的应收利息。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到帐日起孳生的利息将

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

（一）备查文件目录

1、《国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金 2015 年 12 月 14 日资产负债表及审计报告》

2、《〈国金鑫运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。

国金鑫运灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2016 年 5 月 24 日