

新华灵活主题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：中信银行股份有限公司

清算报告出具日期：2023年11月10日

清算报告公告日期：2023年11月30日

一、 基金简介

1、基本情况

新华灵活主题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【2011】798号文件“关于核准新华灵活主题股票型证券投资基金募集的批复”批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于2011年6月1日至7月8日向社会公开募集,募集期间净认购金额为530,360,314.99元,认购资金在募集期间产生的利息为85,388.20元,并经国富浩华会计师事务所国号验字(2011)第65号验资报告予以验证。2011年7月13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,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《新华灵活主题混合型证券投资基金招募说明书》及《新华灵活主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于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、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券、资产支持证券、权证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)。本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例范围为60—95%,债券投资占基金资产的比例范围为0—40%,资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为0—20%,权证投资占基金资产净值的比例范围为0—3%,现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金从2023年10月28日起进入清算期,基金清算期自2023年10月28日起至2023年11月10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

为保护基金份额持有人利益,根据市场环境的变化,本基金管理人依据《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《新华灵活主题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,经与基金托管人中国中信银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议《关于终止新华灵活主题混合型证券投资基金基金合同的议案》,大会表决投票时间自2023年9月19日起至2023年10月25日17:00止,权益登记日为2023年9月18日,2023年

10月26日计票表决通过了上述议案，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。

3、清算起始日

根据持有人大会通过的议案及方案说明，本基金将从2023年10月28日起进入清算期，故本基金清算起始日为2023年10月28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：新华灵活主题混合型证券投资基金

报告截止日：2023年10月27日

单位：人民币元

| 项目 | 报告截止日：2023年10月27日 (基金最后运作日) |
|---------------|--------------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 511,816.43 |
| 结算备付金 | 2,726,163.74 |
| 存出保证金 | - |
| 交易性金融资产 | 6,434,949.25 |
| 资产总计 | 9,672,929.42 |
| 负债： | |
| 应付管理人报酬 | 8,810.33 |
| 应付托管费 | 1,468.39 |
| 应付赎回款 | 65.60 |
| 应付赎回费 | 0.05 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应付交易费用 | 144,560.44 |
| 预提费用 | 41,097.00 |
| 负债合计： | 196,001.81 |
| 所有者权益： | |

| | |
|------------|---------------------|
| 实收基金 | 6,510,107.32 |
| 未分配利润 | 2,966,820.29 |
| 所有者权益合计 | 9,476,927.61 |
| 负债和所有者权益总计 | 9,672,929.42 |

注：报告截止日 2023 年 10 月 27 日，基金份额净值 1.4557 元，基金份额 6,510,107.32 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 10 月 28 日 至 2023 年 11 月 10 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） | 2,045.23 |
| 投资收益（注 2） | -467,542.68 |
| 公允价值变动损益（注 3） | 447,619.16 |
| 其他业务收入（注 4） | 127.88 |
| 清算收入小计 | -17,750.41 |
| 二、清算费用 | |
| 银行汇划手续费 | 28.50 |
| 存托服务费 | 0.01 |
| 交易费用 | 8,372.98 |
| 预提审计费（注 5） | -31,097.00 |
| 预提银行汇划手续费（注 6） | 23.50 |
| 清算费用小计 | -22,672.01 |
| 三、清算净收益 | 4,921.60 |

注 1：利息收入系以当前适用的利率计提的自 2023 年 10 月 28 日至 2023 年 11 月 10 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和补差费收入。

注 5：截止 2023 年 10 月 27 日，本基金已预提年度审计费 41,097.00 元，会计师事务所

所对此次清盘审计收取人民币 10,000.00 元，多计提部分 31,097.00 元于 2023 年 10 月 31 日予以冲减。

注 6：预提银行汇划手续费系银行定期对划付各种款项收取的银行汇划手续费的预估金额。

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 10 月 27 日基金净资产 | 9,476,927.61 |
| 加：清算期间净收益 | 4,921.60 |
| 减：2023 年 10 月 30 日确认赎回对价 | 535,776.96 |
| 二、2023 年 11 月 10 日基金净资产 | 8,946,072.25 |

截至本基金清算报告期结束日（2023 年 11 月 10 日），本基金剩余财产为人民币 8,946,072.25 元。自清算报告期结束日次日（2023 年 11 月 11 日）至本次清算款划出前一日的银行存款、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。

五、停止运作后的清算损益情况说明

本基金于 2023 年 10 月 28 日起进入清算期，截至 2023 年 11 月 10 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 8,954,582.21 元（含应计利息 2,820.86 元），结算备付金应计利息 1,513.54 元。预提费用等负债 10,023.50 元，基金净资产 8,946,072.25 元。

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。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。

截至清算报告期结束日（2023 年 11 月 10 日），本基金最后运作日部分资产尚未收回。为了提高清算效率，本基金管理人将未收到发票的费用和基金管理费等未支付的资金先行垫支向基金份额持有人分配剩余财产，尚未收回的结算备付金应计利息、存出保证金及其应计利息、银行存款应计利息，以上资金将于收回款项、结息后支付给基金管理人和相关费用收款方，由此产生的孳息或亏损由基金管理人承担。

六、其他需要说明的事项

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后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》等规定及时进行剩余财产分配。

七、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 新华灵活主题混合型证券投资基金清算审计报告
- (2) 关于《新华灵活主题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

新华灵活主题混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023年11月10日