

鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年3月5日

清算报告公告日：2024年3月14日

一、 重要提示

鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金（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[2018]991号文注册募集，于2018年11月14日成立并正式运作，本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效满3年后继续存续的，基金在存续期内连续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人民币5000万元的，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况的，本基金合同将终止并根据基金合同约定的程序进行清算，且无须召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应向中国证监会报告并履行相关信息披露程序。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

截至2024年2月26日日终，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，本基金满足基金合同终止条件，已于2024年2月27日进入基金财产清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见2024年2月27日刊登在证监会规定报刊和基金管理人网站（www.xyamc.com）的《关于鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

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）、上海源泰律师事务所于2024年2月27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，上海源泰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	鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金
基金简称	鑫元核心资产

基金主代码	006193	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年11月14日	
最后运作日基金份额总额	51,169,324.28份	
投资目标	本基金在秉承价值投资理念的前提下，把握市场发展趋势并严格控制投资组合风险，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金采用自上而下为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估中国A股、港股、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鑫元核心资产A	鑫元核心资产C
下属分级基金的交易代码	006193	006194
最后运作日下属分级基金的份额总额	50,615,165.09份	554,159.19份

三、 财务会计报告（经审计）

资产负债表

会计主体：鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年2月26日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期末 2024年2月26日 (本基金最后运作日)
资产：	
货币资金	3,292,010.05
结算备付金	94,659.38
存出保证金	39,964.00
应收清算款	3,245,185.65
交易性金融资产	37,418,553.51
资产总计：	44,090,372.59
负债：	
应付清算款	542.52
应付赎回款	769,584.35
应付管理人报酬	31,648.10
应付托管费	6,329.63
应付销售服务费	661.39
其他负债	58,419.83
负债合计：	867,185.82
净资产：	
实收资金	51,169,324.28
未分配利润	-7,946,137.51
净资产合计：	43,223,186.77
负债和净资产总计：	44,090,372.59

注：

- 1、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《资产管理产品相关会计处理规定》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，本清算报表无比较期间的数据列示。
- 2、报告截止日2024年2月26日（本基金最后运作日），本基金份额总额51,169,324.28份。其中下属A类基金份额净值人民币0.8450元，份额总额50,615,165.09份；下属C类基金份额净值人民币0.8156元，份额总额

554,159.19 份。

- 3、本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师蔺育化、张一帆签字出具了安永华明(2024)专字第 70074312_B02 号标准无保留意见的审计报告。

四、 清算情况

本基金的最后运作日为 2024 年 2 月 26 日。自 2024 年 2 月 27 日至 2024 年 3 月 5 日止为本基金清算期，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿、清算期间的清算损益及基金净资产分配等情况如下：

（一）清算费用

根据本基金的《基金合同》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。其中包括：律师费 15,000.00 元，审计费 15,000.00 元。

（二）资产处置情况

- 1、本基金最后运作日货币资金为人民币 3,292,010.05 元，其中托管户存款为人民币 3,288,661.25 元，应计银行存款利息为人民币 3,348.80 元，由于银行尚未结息，应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。
- 2、本基金最后运作日结算备付金为人民币 94,659.38 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金为人民币 60,558.05 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金为人民币 15,770.60 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司北京分公司的结算备付金为人民币 17,608.37 元；应计结算备付金利息为人民币 722.36 元，由于银行尚未结息，该部分利息与尚未划回基金托管账户的结算备付金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。
- 3、本基金最后运作日存出保证金为人民币 39,964.00 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币 8,945.06 元，存放于

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币 4,998.39 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司北京分公司的存出保证金为人民币 25,906.08 元；应计存出保证金利息为人民币 114.47 元，由于银行尚未结息，该部分利息与尚未划回基金托管账户的存出保证金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

4、本基金最后运作日共持有交易性金融资产 37,418,553.51 元。

(1) 其中交易性股票投资为 34,670,227.21 元。2024 年 2 月 27 日已将上述股票全部卖出，清算金额为 34,707,257.17 元，已全部划入基金托管户。

(2) 其中交易性债券投资为 2,748,326.30 元。2024 年 2 月 27 日已将上述债券全部卖出，清算金额为 2,748,300.95 元，已全部划入基金托管户。

5、本基金最后运作日应收清算款 3,245,185.65 元已于 2024 年 2 月 27 日划入基金托管户。

(三) 负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款 769,584.35 元，已于 2024 年 2 月 28 日前全部支付。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬 31,648.10 元、应付托管费 6,329.63 元、应付销售服务费 661.39 元，已于 2024 年 3 月 1 日支付。

3、本基金最后运作日其他负债为 58,419.83 元。其中包含已预提的信息披露费 8,000.00 元，以及清算费用审计费 15,000.00 元、律师费 15,000.00 元，应付交易佣金 20,419.83 元。除信息披露费外的其他负债已于 2024 年 3 月 1 日支付完毕，信息披露费将于收到缴费单或发票时支付。

4、本基金最后运作日应付清算款 542.52 元已于 2024 年 2 月 27 日支付。

(四) 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2024 年 2 月 27 日起至 2024 年 3 月 5 日止清算期间
一、清算收益	57,395.07

1. 利息收入[注 1]	3,192.59
其中：存款利息收入	3,192.59
2. 投资收益（损失以“-”填列） [注 2]	93,276.90
其中：股票投资收益	92,616.25
债券投资收益	660.65
3. 公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-39,074.42
二、清算费用	28,209.97
1. 交易费用[注 3]	28,156.25
2. 其他费用	53.72
其中：银行汇划费	53.00
深港通证券组合费	0.72
三、清算期间净损益	29,185.10

注 1：利息收入系自 2024 年 2 月 27 日至 2024 年 3 月 5 日止清算期间计提的银行存款利息收入、存出保证金利息收入及结算备付金利息收入。

注 2：投资收益系自 2024 年 2 月 27 日至 2024 年 3 月 5 日止清算期间处置交易性金融资产产生的差价收入、交易性股利收入和计提的交易性债券利息收入。

注 3：交易费用系自 2024 年 2 月 27 日至 2024 年 3 月 5 日止清算期间处置交易性金融资产产生的交易费用。

（五）本基金的剩余财产分配

单位：人民币元

项目	金额
一、本基金最后运作日（2024 年 2 月 26 日）基金净资产	43,223,186.77
加：清算期间（2024 年 2 月 27 日至 2024 年 3 月 5 日）净损益	29,185.10
减：清算期间（2024 年 2 月 27 日至 2024 年 3	3,983.21

月 5 日) 支付赎回款、赎回费	
二、2024 年 3 月 5 日基金净资产	43,248,388.66

资产处置及负债清偿后，于清算结束日 2024 年 3 月 5 日，本基金剩余财产为人民币 43,248,388.66 元。根据本基金的基金合同约定，基金财产清算小组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，按各类基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自本基金清算结束日次日（2024 年 3 月 6 日）至清算款项支付日前一日的银行存款利息、备付金利息及保证金利息亦属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，尚未结息的利息、尚未划回基金托管账户的结算备付金及存出保证金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。基金管理人自有资金垫款产生的利息归属基金管理人所有。

（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，在经会计师事务所出具清算审计报告、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。

五、 备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海源泰律师事务所关于鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见》

（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。

鑫元核心资产股票型发起式证券投资基金基金财产清算小组

清算报告出具日期：2024年3月5日

清算报告公告日期：2024年3月14日