

国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）清算报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

公告日期：2023 年 8 月 14 日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是根据《国泰融信定增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》”或“基金合同”)的相关约定,由原国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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[2016]1477号《关于准予国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》负责公开募集,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币411,327,550.94元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第079号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《基金合同》于2017年3月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为411,534,726.85份基金份额,其中认购资金利息折合207,175.91份基金份额。原基金为契约型基金,存续期限不定。基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经上海证券交易所自律监管决定书[2017]145号核准,原基金25,730,020.00份基金份额于2017年6月1日在上海证券交易所挂牌交易。未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其跨系统转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

根据《基金合同》以及《关于国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF)的公告》,原基金的封闭期为18个月,自2017年3月2日起至2018年9月2日止,自2018年9月3日起转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”,即本基金,基金份额仍在上海证券交易所上市交易。转换完成后,《基金合同》中除仅适用于原基金的条款外,继续适用于本基金。本基金为契约型、上市开放式基金(LOF),存续期限不定。原基金于2018年9月2日(封闭期届满日)经审计的基金资产净值为413,328,363.44元,已于2018年9月3日(转型后首日)全部转为本基金的基金资产净值。

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”的约定:

“《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。”

截至2023年7月12日日终,本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5000万元,本基金

已触发基金合同终止的上述情形，本基金按照基金合同的约定进入清算程序并终止，并按规定申请办理本基金基金份额终止上市的相关事宜。

本基金的最后运作日为 2023 年 7 月 25 日，并于 2023 年 7 月 26 日进入清算程序，清算期为 2023 年 7 月 26 日至 2023 年 8 月 7 日。基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2023 年 7 月 26 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（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。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	4
2 基金概况	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）	6
3.1 资产负债表	6
3.2 利润表	8
3.3 净资产（基金净值）变动表	9
4 清盘事项说明	10
4.1 基金基本情况	10
4.2 清算原因	12
4.3 清算起始日	12
4.4 清算报表编制基础	12
5 清算情况	12
5.1 清算费用	12
5.2 资产处置情况	12
5.3 负债清偿情况	13
5.4 清算期间的清算损益情况	13
5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况	13
5.6 基金财产清算报告的告知安排	13
6 备查文件目录	14
6.1 备查文件目录	14
6.2 存放地点	14
6.3 查阅方式	14

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	国泰融信灵活配置混合（LOF）
场内简称	国泰融信
基金主代码	501027
交易代码	501027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 2 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
2023 年 7 月 25 日（基金最后运作日）基金份额总额	2,245,459.84 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017 年 6 月 1 日

2.2 基金产品说明

投资目标	深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上精选具有估值优势的公司股票进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	在有效控制风险的前提下，深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的投资机会，在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上精选具有估值优势的公司股票进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益。 本基金主要投资策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、固定收益类投资工具投资策略；5、股指期货交易策略；6、中小企业私募债投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、权证投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%

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和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	许俊
	联系电话	021-31081600转	010-66596688
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95566
传真		021-31081800	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200082	100818
法定代表人		邱军	葛海蛟

3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

3.1 资产负债表

会计主体：国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023年7月25日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2023年7月25日 (基金最后运作日)	上年度末 2022年12月31日
资 产:		
银行存款	2,692,453.62	14,723,044.65
结算备付金	2,447.09	343,955.41
存出保证金	11,420.19	115,311.26
交易性金融资产	1,100.04	42,828,264.55

其中：股票投资	-	17,267,911.26
基金投资	-	-
债券投资	1,100.04	25,560,353.29
资产支持证券投资		-
贵金属投资	-	-
其他投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	35,008,950.02
应收清算款	-	-
应收股利	-	-
应收申购款	1.57	11.05
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,707,422.51	93,019,536.94
负债和净资产	本期末 2023年7月25日 (基金最后运作日)	上年度末 2022年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付清算款	20.79	793,899.50
应付赎回款	124,772.17	-
应付管理人报酬	1,991.13	80,190.73
应付托管费	553.11	22,275.18
应付销售服务费	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	-	3,842.07
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	105,827.08	347,749.09
负债合计	233,164.28	1,247,956.57
净资产：		
实收基金	2,245,459.84	79,060,573.90
其他综合收益	-	-
未分配利润	228,798.39	12,711,006.47
净资产合计	2,474,258.23	91,771,580.37
负债和净资产总计	2,707,422.51	93,019,536.94

注：（1）报告截止日2023年7月25日（基金最后运作日），基金份额净值1.1019元，基金份额总额2,245,459.84份。

（2）本财务报表的实际编制期间为2023年1月1日至2023年7月25日（基金最后运作日）止

期间。

3.2 利润表

会计主体：国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 25 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 25 日（基金最后运作 日）止期间	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日止期间
一、营业总收入	536,727.73	-20,181,287.00
1.利息收入	44,361.21	218,059.24
其中：存款利息收入	27,338.83	183,078.00
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	17,022.38	34,981.24
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-50,154.99	-9,760,847.61
其中：股票投资收益	-212,978.69	-23,006,485.79
基金投资收益	-	-
债券投资收益	151,071.27	11,762,345.56
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	11,752.43	1,483,292.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	485,649.16	-11,240,598.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	56,872.35	602,100.22
减：二、营业总支出	417,766.49	7,643,925.60
1. 管理人报酬	219,837.76	5,741,415.07
2. 托管费	61,066.02	1,594,837.47
3. 销售服务费	-	-
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出	-	17,193.70
其中：卖出回购金融资产支出	-	17,193.70
6. 信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	1,102.73	49,110.80
8. 其他费用	135,759.98	241,368.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	118,961.24	-27,825,212.60
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	118,961.24	-27,825,212.60

五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	118,961.24	-27,825,212.60

3.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 25 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 25 日（基金最后运作日）止期间		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	79,060,573.90	12,711,006.47	91,771,580.37
二、本期期初净资产（基金净值）	79,060,573.90	12,711,006.47	91,771,580.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-76,815,114.06	-12,482,208.08	-89,297,322.14
（一）、综合收益总额	-	118,961.24	118,961.24
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-76,815,114.06	-12,601,169.32	-89,416,283.38
其中：1.基金申购款	93,097.64	13,791.46	106,889.10
2.基金赎回款	-76,908,211.70	-12,614,960.78	-89,523,172.48
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,245,459.84	228,798.39	2,474,258.23
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	851,199,475.40	170,563,243.22	1,021,762,718.62
二、本期期初净资产	851,199,475.40	170,563,243.22	1,021,762,718.62

产（基金净值）			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-772,138,901.50	-157,852,236.75	-929,991,138.25
（一）、综合收益总额	-	-27,825,212.60	-27,825,212.60
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-772,138,901.50	-130,027,024.15	-902,165,925.65
其中：1.基金申购款	1,627,751.62	281,683.56	1,909,435.18
2.基金赎回款	-773,766,653.12	-130,308,707.71	-904,075,360.83
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	79,060,573.90	12,711,006.47	91,771,580.37

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是根据《国泰融信定增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》”或“基金合同”)的相关约定,由原国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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[2016]1477号《关于准予国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》负责公开募集,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 411,327,550.94 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 079 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《基金合同》于 2017 年 3 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 411,534,726.85 份基金份额,其中认购资金利息折合 207,175.91 份基金份额。原基金为契约型基金,存续期限不定。基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经上海证券交易所自律监管决定书[2017]145 号核准，原基金 25,730,020.00 份基金份额于 2017 年 6 月 1 日在上海证券交易所挂牌交易。未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

根据《基金合同》以及《关于国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF)的公告》，原基金的封闭期为 18 月，自 2017 年 3 月 2 日起至 2018 年 9 月 2 日止，自 2018 年 9 月 3 日起转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，即本基金，基金份额仍在上海证券交易所上市交易。转换完成后，《基金合同》中除仅适用于原基金的条款外，继续适用于本基金。本基金为契约型、上市开放式基金(LOF)，存续期限不定。原基金于 2018 年 9 月 2 日(封闭期届满日)经审计的基金资产净值为 413,328,363.44 元，已于 2018 年 9 月 3 日(转型后首日)全部转为本基金的基金资产净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、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、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、央行票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类金融工具，股指期货、权证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相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 0%-95%；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%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%。

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”的约定：

“《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。”

截至 2023 年 7 月 12 日日终，本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5,000 万元，本基金已触发基金合同终止的上述情形，本基金按照基金合同的约定进入清算程序并终止，并按规定申请办理本基金基金份额终止上市的相关事宜。

本基金的最后运作日为 2023 年 7 月 25 日，并于 2023 年 7 月 26 日进入清算程序，清算期为 2023 年 7 月 26 日至 2023 年 8 月 7 日。基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司

限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2023 年 7 月 26 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（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。

4.2 清算原因

本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5,000 万元，触发《基金合同》约定的终止情形。

4.3 清算起始日

本基金于2023年7月26日起进入清算程序，清算期为2023年7月26日至2023年8月7日。

4.4 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。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。

5 清算情况

自 2023 年 7 月 26 日至 2023 年 8 月 7 日清算期间，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：

5.1 清算费用

按照《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。

5.2 资产处置情况

截至本次清算期结束日（2023 年 8 月 7 日），各项资产清算情况如下：

（1）本基金最后运作日活期存款本息合计人民币 2,692,453.62 元，存保证金本息合计人民币 11,420.19 元，结算备付金本息合计人民币 2,447.09 元。截至清算结束日 2023 年 8 月 7 日，活期存款本息合计人民币 2,538,449.28 元，其中基金管理人垫资款 100,000.00 元，存出保证金本息合计人民币 17,863.16 元，结算备付金本息合计人民币 2,448.52 元。

（2）本基金最后运作日交易性金融资产为债券投资，金额 1,100.04 元。截至清算结束日已全部变现。

（3）本基金最后运作日应收申购款余额人民币 1.57 元，为应计申购款利息。截至清算结束日

该金额尚未收回，将由基金管理人资金先行垫付。

5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付赎回款人民币124,772.17元，应付赎回费人民币125.40元，应付管理费人民币1,991.13元，应付托管费人民币553.11元，应付券商佣金人民币701.68元，应付清算款人民币20.79元，预提审计费人民币40,000.00元，预提信息披露费人民币65,000.00元，截至清算结束日2023年8月7日，以上应付款及预提费用已全部支付完毕。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年7月26日（基金清算起始日）至2023 年8月7日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	
1.利息收入	330.54
其中：存款利息收入	330.54
债券利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	184.91
其中：股票投资收益	-
债券投资收益	184.91
基金投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4.其他收入（损失以“-”号填列）	22.65
二、清算费用	55.00
1.其他费用	55.00
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	483.10

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

资产处置及负债清偿后，截至本基金清算期结束日2023年8月7日，本基金剩余财产为人民币2,458,762.53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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。2023年8月8日至最终清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算。

5.6 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。

6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1、《国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 25 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》

2、上海市通力律师事务所关于《国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

6.3 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。

国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)财产清算小组

二〇二三年八月七日