

摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型
证券投资基金清算报告

基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二零一七年六月一日

一、重要提示

摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]第 1684 号《关于准予摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由摩根士丹利华鑫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《摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集,本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

依据《摩根士丹利华鑫沪港深新价值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》”)约定,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,本基金将根据基金合同约定进行基金合同的终止及基金财产的清算,而无需召开基金份额持有人大会。截至 2017 年 4 月 27 日,本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元,满足基金合同约定的前述终止条件,并于 2017 年 4 月 28 日起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刊登在 2017 年 4 月 28 日《证券时报》和基金管理人网站(<http://www.msfn.com.cn>)

上的《关于摩根士丹利华鑫沪港深新价值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》。

本基金清算期自 2017 年 4 月 28 日起至 2017 年 5 月 12 日止，由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、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。

二、基金概况

1、基金名称：摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金

2、基金简称：大摩沪港深新价值混合

3、基金代码：001737

4、基金运作方式：契约型开放式

5、基金合同生效日：2016 年 2 月 3 日

6、基金管理人：摩根士丹利华鑫基金管理有限公司

7、基金托管人：交通银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年4月27日

单位：人民币元

资 产	2017年4月27日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	17,874,953.32
结算备付金	950,731.21
存出保证金	26,007.78
应收利息	25,280.15
应收申购款	497.02
资产总计	18,877,469.48
负 债：	
应付赎回款	85,857.29
应付管理人报酬	14,521.16
应付托管费	3,630.31
其他负债	86,179.15
负债合计	190,187.91
所有者权益：	
实收基金	18,314,054.92
未分配利润	373,226.65
所有者权益合计	18,687,281.57
负债和所有者权益总计	18,877,469.48

注：报告截止日 2017 年 4 月 27 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.020 元，基金份额总额 18,314,054.92 份。

四、清盘事项说明

1、基本情况

摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]第 1684 号《关于准予摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由摩根士丹利华鑫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《摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

向社会公开募集。本基金基金合同于 2016 年 2 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 272,945,460.49 份基金份额（含募集期间认购资金利息结转份额）。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金的基金管理人为摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根士丹利华鑫沪港深新价值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，包括国内依法上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、及资产支持证券）、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（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（包含投资于国内依法发行上市的股票、及投资于港股通标的股票的总和）资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后，本基金持有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%。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 40% + 中证综合债券指数收益率

×40%+恒生综合指数收益率×20%。

根据《摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定，自基金合同生效日起，出现如下情形之一的，本基金将根据基金合同的约定进行基金合同的终止及基金财产的清算，而无需召开基金份额持有人大会：

- 1) 连续 60 个工作日，基金资产净值低于 5000 万元；
- 2) 连续 60 个工作日，基金份额持有人数量少于 200 人。

2、清算原因

截至 2017 年 4 月 27 日，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，符合基金合同终止条件，根据基金合同规定进入基金财产清算程序。

3、清算起始日

根据基金合同规定及《关于摩根士丹利华鑫沪港深新价值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》，本基金清算起始日为 2017 年 4 月 28 日。

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》的有关规定编制的。于 2017 年 4 月 27 日(基金最后运作日)，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。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 2017 年 4 月 28 日至 2017 年 5 月 12 日止清算期间，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：

1、清算费用

按照《摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》第十九部分“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。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人承担。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币 950,731.21 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管，其中 780,754.26 元于 2017 年 5 月 4 日根据《结算备付金管理办法》相关规定调整划入托管户，另 169,976.95 元由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2017 年 5 月 12 日划入托管账户。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。

(2) 本基金最后运作日结算保证金人民币 26,007.78 元，该款项已于 2017 年 5 月 4 日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收利息人民币 25,280.15 元, 该款项由基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司以自有资金垫付, 并已于 2017 年 5 月 12 日划入托管账户。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。

(4) 本基金最后运作日应收申购款人民币 497.02 元, 该款项已于 2017 年 4 月 28 日划入托管账户。

3、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 14,521.16 元, 该款项已于 2017 年 5 月 4 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,630.31 元, 该款项已于 2017 年 5 月 4 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 85,857.29 元, 该款项已于 2017 年 4 月 28 日及 2017 年 5 月 3 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回费为人民币 32.19 元, 该款项已于 2017 年 4 月 28 日及 2017 年 5 月 3 日支付。

(5) 本基金最后运作日预提费用为人民币 86,146.96 元, 为预提审计费用、信息披露费和债券账户维护费。预提的审计费用 52,822.03 元, 其中预提 2016 年度审计费用 40,000.00 元于清算款划出日进行支付, 预提 2017 年度预提审计费用 12,822.03 元于 2017 年 4 月 28 日做其他收入处理, 不由基金资产承担。预提的信息披露费 32,054.49 元于清算款划出日进行支付。预提的债券账户维护费 1,270.44 元于清算款划出日进行支付。

4、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、2017年4月27日所有者权益	18,687,281.57
加：清算期间净收益	18,441.25
减：基金净赎回金额 (于2017年4月28日确认的投资者赎回申请)	953,800.58
二、2017年5月12日所有者权益	17,751,922.24

资产处置及负债清偿后，于2017年5月12日本基金剩余财产为人民币17,751,922.24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。

2017年5月13日至清算款划出日前一日的银行存款及结算备付金产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司将以自有资金先行垫付该笔款项(该金额可能与实际结息金额存在略微差异)，供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5、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

1、备查文件目录

(1) 摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金
2017年1月1日至2017年4月27日(基金最后运作日)止期间的财
务报表及审计报告

(2) 关于《摩根士丹利华鑫沪港深新价值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

基金管理人的办公场所。

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。

摩根士丹利华鑫沪港深新价值灵活配置混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2017年5月12日