

新华鑫盛灵活配置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：平安银行股份有限公司

清算报告公告日：2018年1月6日

一、 基金简介

1、 基本情况

新华鑫盛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【2016】2119号文《关于准予新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理股份有限公司作为管理人，平安银行股份有限公司作为托管人的契约型开放式混合型证券投资基金，存续期不设定。于2016年11月15日通过新华基金管理股份有限公司的直销中心和其他销售机构公开发售，发行期限为2016年11月15日至2016年12月15日。首次募集资金总额200,314,099.66元，其中募集资金产生利息55,330.20元，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2016]第01360087号验资报告予以验证。2016年12月22日办理基金备案手续，基金合同正式生效。

根据《新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华鑫盛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，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货、债券（国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金及到期日在一年以内的政府债券，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的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产净值的比例为0-95%，单只中小企业私募债券市值不超过基金资产净值的10%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%；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。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为： $60\% \times$ 沪深300指数收益率 $+40\% \times$ 上证国债指数收益率。

本基金从2017年11月13日起进入清算期，基金清算期自2017年11月13日起至2017年11月20日止，并由瑞华会计师事务所（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

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。法律法规另有规定时，从其规定。”

截至 2017 年 11 月 9 日，本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已触发基金合同中约定的基金合同终止条款。根据基金合同有关约定，本基金将依据基金财产清算程序进行财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会。

3、清算起始日

根据《新华基金管理股份有限公司关于新华鑫盛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》，本基金于 2017 年 11 月 13 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2017 年 11 月 13 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。自本基金报告截止日起，资产负债按清算价格计价，停牌股票的清算价格按报告截止日的公允价值计价。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。

三、财务报告

资产负债表

会计主体：新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 11 月 12 日

单位：人民币元

项目	报告截止日：2017 年 11 月 12 日
资产：	
银行存款	24,001,628.20
存出保证金	100,959.87
应收利息	25,373.63
交易性金融资产	1,432,524.00
其中：股票投资	1,432,524.00
买入返售金融资产	-
其他资产	-

资产总计	25,560,485.70
负债：	
应付管理人报酬	12,191.79
应付托管费	2,031.97
应付交易费用	448,638.49
应付利润	
应交税费	
其他负债	359,366.95
负债合计：	822,229.20
所有者权益：	
实收基金	24,956,548.56
未分配利润	-218,292.06
所有者权益合计	24,738,256.50
负债和所有者权益总计	25,560,485.70

注：报告截止日 2017 年 11 月 12 日，基金份额净值 0.9913 元，基金份额总额 24,956,548.56 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 2017 年 11 月 13 日 至 2017 年 11 月 20 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）	1,757.21
赎回费收入（注 2）	5,299.78
清算收入小计	7,056.99
二、清算费用	
银行间账户维护费	
银行划款手续费	
清算费用小计	
三、清算净收益	7,056.99

注 1：利息收入系以当前适用的利率计提的自 2017 年 11 月 13 日至 2017 年 11 月 20 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：赎回费收入系以当前适用的赎回费率计提的自 2017 年 11 月 13 日至 2017 年 11 月 20 日止清算期间的赎回费收入。

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、2017 年 11 月 12 日基金净资产	24,738,256.50
加：清算期间净收益	7,056.99
加：应付利润结转实收基金	0.00
减：到期日赎回转出款	21,198,919.68
二、2017 年 11 月 20 日基金净资产	3,546,393.81

4、停止运作后的清算损益情况说明

本基金于 2017 年 11 月 13 日起进入清算期，截至 2017 年 11 月 20 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 2,808,008.30 元，保证金 100,959.87 元，应收利息 27,130.84 元，股票投资 1,432,524.00 元，管理费、托管费、交易费用、预提费用（信息披露费用、审计费用）等负债 822,229.20 元，基金净资产 3,546,393.81 元。

其中保证金 100,959.87 元，将于 2017 年 12 月份变现；应收利息将于 12 月末结息变现，此后新产生的利息将在销户结息时变现。

其中交易性金融资产-股票投资 1,432,524.00 元，该金额为基金报告截止日仍然停牌而无法变现的股票“雷鸣科化（600985）”，该股票报告截止日估值金额为采用“指数收益法”计算的金额，具体详见基金管理人于 2017 年 9 月 14 日发布的《新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告（雷鸣科化）》，本基金报告截止日（2017 年 11 月 12 日）持有的停牌股票明细如下：

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600985	雷鸣科化	2017-07-31	重大事项	12.36	115,900.00	1,851,853.00	1,432,524.00	

截至本次清算期结束日（2017 年 11 月 20 日），本基金所持上述停牌股票未复牌。由于该股

票复牌可变现的时间尚不确定，因此待本基金所持该停牌股票复牌变现后，将实际变现金额按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。

根据本基金的《基金合同》约定以及《新华鑫盛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》，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，如因持有停牌证券暂时无法变现的，本基金将先以已变现基金资产为限进行分配，待停牌证券复牌并全部变现后进行再次分配。考虑到本基金清算的实际情况，在清算期间产生的律师费等清算费用，均由基金管理人承担。

本基金的银行存款应收利息均为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由管理人承担。

管理人：新华基金管理股份有限公司（签章） 托管人：平安银行股份有限公司（签章）

五、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告
- (2) 新华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算报告的法律意见书

2、存放地点

基金管理人、基金托管人处

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

新华基金管理股份有限公司基金财产清算小组

2018年1月6日