

中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金  
清算报告

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年 08月 21日

清算报告公告日：2018年 10月 20日

## 一、 重要提示

中海合鑫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”）2015年1月4日证监许可[2015]6号文准予募集注册，自2015年2月11日起基金合同生效，基金管理人为中海基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《中海合鑫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”）的有关约定，当基金合同生效3年后，本基金连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元时，基金合同自动终止，而无需经基金份额持有人大会审议。截至2018年5月17日日终，在基金合同生效满三年后，本基金基金资产净值已连续60个工作日低于人民币5000万元，触发上述基金合同终止情形。基金管理人已就该事项于2018年5月11日和2018年5月18日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站分别刊登了《中海基金管理有限公司关于中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告》和《中海基金管理有限公司关于中海合鑫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》。

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）和上海市通力律师事务所于2018年6月5日成立基金财产清算小组，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）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## 二、 基金概况

基金名称	中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中海合鑫混合
基金主代码	001005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月11日
基金管理人名称	中海基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会2015年1月4日证监许可[2015]6号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2015年1月26日至2015年2月6日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2015年2月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为684,119,263.95份（含募集期间利息结转的份额）。本基金自成立（2015年2月11日）至2018年6月4日期间，按基金合同约定正常运作。

根据基金合同的有关约定，当基金合同生效3年后，本基金连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元时，基金合同自动终止，而无需经基金份额持有人大会审议。为降低对于现有及潜在基金份额持有人的影响，本基金于2018年5月7日起暂停申购（含转换转入及定期定额投资）业务，但正常开放赎回业务。截至2018年5月17日日终，在基金合同生效满三年后，本基金基金资产净值已连续60个工作日低于人民币5000万元，触发上述基金合同终止情形，本基金自2018年6月5日起进入基金财产清算程序。由于本基金持有的流通受限股票无法确定变现时间，本基金将进行两次清算，其中第一次清算期间为2018年6月5日至2018年8月10日，第二次清算期间将根据流通受限股票的变现时间确定。

### 四、 财务会计报告

（一） 2018年06月04日（基金最后运作日）资产负债表（经审计）

（除特别注明外，金额单位为人民币

元）

	最后运作日 2018年6月4日
资产：	
银行存款	10,223,651.87
结算备付金	185,780.18
存出保证金	44,189.65
交易性金融资产	401,280.00
其中：股票投资	401,280.00
应收利息	14,618.32

资产总计	10,869,520.02
负 债:	
应付赎回款	2,155,109.55
应付赎回费	460.49
应付管理人报酬	39,978.40
应付托管费	6,663.04
应付交易费用	76,421.88
其他负债	5,000.00
负债合计	2,283,633.36
所有者权益:	
实收基金	14,439,469.69
未分配利润	(5,853,583.03)
所有者权益合计	8,585,886.66
负债和所有者权益总计	10,869,520.02

## 五、 清算情况

自2018年6月5日至2018年8月10日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行第一次清算，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

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。

为保护基金份额持有人利益，本基金清算期间的审计费用、律师费用由基金管理人承担，银行汇划费用等从基金财产中列支。

### 2、资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日存出保证金为人民币44,189.65元，截至2018年8月10日存出保证金余额为人民币30,463.40元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币185,780.18元，已于2018年7月3日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收银行存款利息人民币13,328.81元、应收结算备付金利息人民币1,113.94元、应收存出保证金利息人民币175.57元，共计人民币14,618.32元，以上款项已于2018年6月21日划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币401,280.00元，系因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票，其明细如下：

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	最后运作日估值单价	数量 (单位：股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
603501	韦尔股份	2018/5/15	重大资产重组	35.20	11,400	465,280.36	401,280.00

待停牌股票复牌后，基金管理人将及时变现停牌股票，并于第二次清算时再向基金份额持有人分配。于2018年8月10日，本基金持有停牌股票尚未复牌。

### 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39,978.40元，该款项已分别于2018年6月5日和2018年6月6日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币6,663.04元，该款项已分别于2018年6月5日和2018年6月6日支付。

(3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币2,155,109.55元，该款项已于2018年6月5日支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回费为人民币460.49元，该款项已于2018年6月5日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币5,000.00元，为应付中国证券报信息披露费，该款项已于2018年7月10日支付。

(6) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币76,421.88元，为应付兴业证券席位佣金，该款项已于2018年7月4日支付。

#### 4、清算期间的清算损益情况

项目	自2018年6月5日 至2018年8月10日 止清算期间
一、收益	
1、利息收入（注1）	8,021.50
2、股票投资收益（注2）	513.00
3、公允价值变动损益（注3）	(40,812.00)
收益小计	<u>(32,277.50)</u>
二、费用	
1、清算费用（注4）	737.83
费用小计	<u>737.83</u>
三、清算期间净收益	<u><u>(33,015.33)</u></u>

注1：利息收入系计提的自2018年6月5日至2018年8月10日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息、结算备付金利息收入。其中，银行存款利息人民

币1,842.84元、结算备付金利息人民币133.79元及存出保证金利息人民币32.04元已于2018年6月21日收回并划入本基金托管账户。

注2：股票投资收益系流通受限股票韦尔股份于2018年8月6日发布《上海韦尔半导体股份有限公司2017年年度权益分派实施公告》对股东分配2017年年度现金股利，每股派发现金红利人民币0.045元（含税），本基金共持有韦尔股份11,400股，股利合计人民币513.00元。

注3：本基金于2018年6月4日起将持有流通受限股票韦尔股份估值方法变更为指数收益法进行估值。公允价值变动损益系韦尔股份在第一次清算期间指数收益法估值导致（金额可能与实际股价存在差异）。

注4：本基金清算期间的审计费、律师费由基金管理人承担。本基金清算期间清算费用为人民币737.83元，系银行汇划费，已分别于2018年6月7日、2018年7月6日和2018年8月7日支付。

#### 四、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2018年6月4日基金净资产	8,585,886.66
加：自2018年6月5日至2018年8月10日止清算期间净收益	(33,015.33)
减：2018年6月5日确认的净赎回款	2,413,004.95
二、2018年8月10日基金净资产	6,139,866.38

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。

2018年8月10日本基金剩余财产为人民币6,139,866.38元，其中包括交易性金融资产人民币360,468.00元（该金额为停牌股票最后运作日估值金额，与停牌股票资产复牌后实际变现金额可能存在差异），存出保证金人民币30,463.40元，

2018年6月21日(最近结息日)至本基金第一次清算结束日的银行存



款、结算备付金及存出保证金产生的利息人民币6,012.83元。上述剩余未变现的资产将根据变现情况在第二次清算期间按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至清算款划出日前一日银行存款产生的利息，该期间利息亦属全体份额持有人所有，将与清算结束日净资产合计按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

截至2018年8月10日，本基金本次可向份额持有人划拨的清算款为人民币5,742,922.15元，将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。剩余未分配部分将根据变现及垫付情况在第二次清算期间按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 六、 备查文件

### （一） 备查文件目录

- 1、《中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金财务审计报告》；
- 2、《中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

### （二） 存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

### （三） 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇一八年十月二十日