

新华健康生活主题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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年10月19日

清算报告公告日：2018年11月30日

一、 基金简介

1、基本情况

新华健康生活主题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]726号文件批准，由新华基金管理股份有限公司作为发起人，于2016年5月10日至6月13日向社会公开募集，首次募集资金总额351,569,656.22元，其中募集资金产生利息44,379.64元，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2016]01360039号验资报告予以验证。2016年6月16日办理基金备案手续，基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期不限定，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华健康生活主题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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、债券资产（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、可交换债券、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、银行存款等、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相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0-95%，持有全部中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于20%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，投资于健康生活主题产业的证券资产不低于本基金非现金基金资产的80%。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：沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

本基金从2018年10月12日起进入清算期，基金清算期自2018年10月12日起至2018年10月19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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金基金合同生效后，连续60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，

基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

截至 2018 年 4 月 2 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，据此，基金管理人于 2018 年 8 月 30 日发布《新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会公告》，提议召开基金份额持有人大会终止本基金基金合同，并于 2018 年 10 月 9 日表决通过了《关于终止新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》，并于 2018 年 10 月 11 日发布《新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2018 年 10 月 11 日，自 2018 年 10 月 12 日起，本基金进入基金财产清算程序。

3、清算起始日

根据《新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2018 年 10 月 12 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2018 年 10 月 12 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：新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 10 月 11 日

单位：人民币元

项目	报告截止日：2018 年 10 月 11 日
资产：	
银行存款	2,699,288.76

结算备付金	22,105.26
存出保证金	8,366.27
应收利息	820.54
应收申购款	499.25
交易性金融资产	424,871.42
其中：股票投资	424,871.42
买入返售金融资产	-
其他资产	-
资产总计	3,155,951.50
负债：	
应付管理人报酬	1,391.68
应付托管费	231.95
应付交易费用	43,088.12
应付赎回款	1,688.21
应付赎回费	4.24
其他负债	315,669.56
负债合计：	362,073.76
所有者权益：	
实收基金	3,155,294.23
未分配利润	-361,416.49
所有者权益合计	2,793,877.74

注：报告截止日 2018 年 10 月 11 日，基金份额净值 0.885 元，基金份额总额 3,155,294.23 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 2018 年 10 月 12 日 至 2018 年 10 月 19 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）	441.29
清算收入小计	441.29
二、清算费用	
银行间账户维护费	12,400.00

汇划手续费	18.00
三、清算净收益	-11,976.71

注 1：利息收入系以当前适用的利率计提的自 2018 年 10 月 12 日至 2018 年 10 月 19 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。

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、2018 年 10 月 11 日基金净资产	2,793,877.74
加：清算期间净收益	-11,976.71
减：应付赎回款和应付赎回费	23,215.93
二、2018 年 10 月 19 日基金净资产	2,758,685.10

4、停止运作后的清算损益情况说明

本基金于 2018 年 10 月 12 日起进入清算期，截至 2018 年 10 月 19 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 2,674,861.63 元，保证金 30,471.53 元，应收利息 1,261.83 元，股票投资 424,871.42 元，管理费、托管费、交易费用、其他应付款（银行间账户维护费）、预提费用（信息披露费用、审计费用）等负债 372,781.31 元，基金净资产 2,785,685.10 元。

其中交易性金融资产-股票投资 424,871.42 元，该金额为基金报告截止日仍然停牌而无法变现的股票“信威集团（600485）、万达电影（002739）、世纪华通（002602）、”，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 10 月 11 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（信威集团）》、2018 年 3 月 27 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（万达电影）》，2018 年 10 月 13 日《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（世纪华通）》，本基金报告截止日（2018 年 10 月 11 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
600485	信威集团	2016-12-23	筹划重大事项	10.06	20,557.00	307,775.00	206,803.42	
002602	世纪华通	2018-06-	筹划重	24.82	1,000.00	34,316.36	24,820.00	

		11	大事项				
002739	万达电影	2017-07-03	筹划重大事项	19.52	9,900.00	357,127.00	193,248.00

截至本次清算期结束日（2018年10月19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。因上述三只股票复牌时间和变现金额存在不确定性，因而最终有可能无法按照清盘报告中净值予以清盘，实际清盘净值以所持股票全部复牌为准。

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，根据《关于终止新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》，对于清算期间未能变现的停牌股票，本基金将在停牌股票全部变现后按其变现金额二次分配给投资者。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。此外，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其他清算费用，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：中国工商银行股份有限公司（签章）

五、备查文件

1、备查文件目录

(1) 新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告

(2) 关于《新华健康生活主题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、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

新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018年10月19日