

永赢量化混合型发起式证券投资基金 第二次清算报告

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

公告日期：2019 年 1 月 12 日

一、重要提示

1、清算原因

根据《永赢量化混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）第五部分“基金备案”第三条约定：“基金合同生效满3年之日（自基金合同生效之日起3年后的对应日，若该日为非工作日则顺延至下一工作日），若基金资产净值低于2亿元，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。”

本基金基金合同生效日为2015年8月6日，基金合同生效满3年之日为2018年8月6日。截至2018年8月6日日终，本基金基金资产净值低于人民币2亿元。根据本基金基金合同的约定，本基金管理人决定本基金最后运作日为2018年8月6日，自2018年8月7日进入清算期，无需召开基金份额持有人大会。

2、清算起始日

本基金于2018年8月7日起进入第一次清算期，清算期间为2018年8月7日至2018年8月15日。

本次清算为第二次暨最后一次清算，清算期间为2018年8月16日至2018年12月14日。

3、清算报表编制基础

本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。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。

二、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：永赢量化混合型发起式证券投资基金

单位：人民币元

	一次清算结束日 2018年8月15日	二次清算结束日 2018年12月14日
资 产：		
银行存款	14,444,153.79	919,719.28
结算备付金	863,636.38	-
存出保证金	21,997.91	-
交易性金融资产	5,511.00	-
其中：股票投资	5,511.00	-
应收利息	17,927.83	3,677.79
资产总计	15,353,226.91	923,397.07
负 债：		
应付交易费用	754.75	-
应付税费	8,949.78	-
预提费用	483,000.00	-
负债合计	492,704.53	-
所有者权益：		
实收基金	19,121,644.56	1,221,404.49
未分配利润	-4,261,122.18	-298,007.42
所有者权益合计	14,860,522.38	923,397.07
负债和所有者权益总计	15,353,226.91	923,397.07

注：1、于一次清算结束日 2018 年 8 月 15 日，永赢量化混合型发起式证券投资基金单位净值为 0.7772 元，份额为 19,121,644.56 份，资产净值为 14,860,522.38 元。于二次清算结束日 2018 年 12 月 14 日，永赢量化混合型发起式证券投资基金单位净值为 0.7560 元，份额为 1,221,404.49 份，资产净值为 923,397.07 元。

三、清算情况

自 2018 年 8 月 16 日至 2018 年 12 月 14 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、按照《永赢量化混合型发起式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。

2、资产处置情况

(1) 本基金于 2018 年 9 月 4 日收到调减结算保证金人民币 21,997.91 元和结算备付金人民币 863,636.38 元，共计人民币 885,634.29 元并已划入本基金托管账户；

(2) 本基金截止一次清算结束日(2018 年 8 月 15 日)交易性金融资产为人民币 5,511.00 元，为因暂时停牌而流通受限的股票资产。本次清算期间流通受限股票复牌及处置情况如下：

股票名称	股票代码	数量(股)	停牌价格(人民币元)	最后运作日(2018年8月6日)估值金额(人民币元)	复牌日期	变现日期	实际清算金额(人民币元)
永泰能源	600157	3,300	1.67	5,511.00	2018年12月10日	2018年12月11日	4,713.87

3、负债清偿情况

(1) 本基金于第一次清算结束日预提费用共计人民币 458,000.00 元，其中包括证券日报信息披露费 20,000.00 元、证券时报信息披露费 145,000.00 元、上证报信息披露费 13,000.00 元和中证报信息披露费 280,000.00 元；分别于 2018 年 8 月 29 日、2018 年 10 月 9 日、2018 年 10 月 10 日和 2018 年 10 月 10 日支付完毕。

(2) 本基金于第一次清算结束日计提的应付税费人民币 8,949.78 元、应付交易费用人民币 754.75 元，为截至第一次清算结束日生产的全部佣金及税费，分别于 2018 年 9 月 5 日、2018 年 10 月 12 日支付完毕。

(3) 本基金于第一次清算结束日计提的审计费用 15,000.00 元，律师费用 10,000.00 元，分别于收到费用发票当日即 2018 年 9 月 14 日、2018 年 10 月

9日支付完毕。

4、清算期的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2018年8月16日
	至2018年12月14日
一、收入	14,330.66
1、利息收入	15,122.66
其中：存款利息收入	14,359.17
清算备付金利息收入	738.53
结算保证金利息收入	18.88
期货备付金利息收入	6.08
2、投资收益（损失以“-”号填列）	-1,543.00
3、公允价值变动损益（损失以“-”号填列）	751.00
二、费用	-6.71
1、交易费用	-6.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	14,323.95

5、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、一次清算结束日2018年8月15日基金净资产	14,860,522.38
加：二次清算期间净收益（亏损以“-”号填列）	14,323.95
减：划付一次清算金额	-13,951,449.26
二、2018年12月14日基金净资产	923,397.07

本基金已于2018年9月28日划付了一次清算款项13,951,449.26元，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。二次清算期间资产处置及负债清偿后，于二次清算结束日2018年12月14日本基金剩余财产为人民币923,397.07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清算费用、缴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12月14日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份

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，差额由管理人承担），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。

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。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

永赢量化混合型发起式证券投资基金资产负债表及审计报告；

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可通过登录基金管理人网站查阅清算报告，基金管理人在网站登载清算报告视为履行了告知义务。基金管理人网站：www.maxwealthfund.com

永赢量化混合型发起式证券投资基金财产清算小组

2019年1月12日