

中海中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：宁波银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年11月2日

清算报告公告日：2019年1月23日

## 一、 重要提示

中海中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11月12日证监许可

**【2015】2593号文**准予募集注册，自2015年11月23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”），基金托管人为宁波银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《中海中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，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人情形或连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的，本基金将根据基金合同的约定进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会。截至2018年9月26日日终，本基金基金资产净值已连续60个工作日低于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9月14日和2018年9月27日在《中国证券报》、《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中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中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10月9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    | 中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称    | 中海中鑫混合            |
| 基金主代码   | 002110            |
| 基金运作方式  | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日 | 2015年11月23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 | 宁波银行股份有限公司        |

## 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会2015年11月12日证监许可【2015】2593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11月18日至2015年11月18日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2015年11月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为804,209,589.43份（含募集期间利息结转的份额）。本基金自成立（2015年11月23日）至2018年10月8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，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人情形或连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的，本基金将根据基金合同的约定进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会。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9月19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9月26日日终，本基金基金资产净值已连续60个工作日低于5000万元，触发上述基金合同终止情形，本基金自2018年10月9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10月9日至2018年11月2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10月8日(基金最后运作日)资产负债表(经审计)

单位: 人民币元

|               | 最后运作日<br>2018年10月8日 |
|---------------|---------------------|
| <b>资产:</b>    |                     |
| 银行存款          | 2,627,374.68        |
| 存出保证金         | 71,886.90           |
| 交易性金融资产       | 2,821,040.68        |
| 其中: 股票投资      | 2,821,040.68        |
| 应收利息          | 1,292.17            |
| 资产总计          | 5,521,594.43        |
| <b>负债:</b>    |                     |
| 应付赎回款         | 113,649.55          |
| 应付管理人报酬       | 917.32              |
| 应付托管费         | 183.46              |
| 应付销售服务费       | 183.46              |
| 应付交易费用        | 45,296.21           |
| 其他负债          | 22,300.00           |
| 负债合计          | 182,530.00          |
| <b>所有者权益:</b> |                     |
| 实收基金          | 5,631,846.51        |
| 未分配利润         | (292,782.08)        |
| 所有者权益合计       | 5,339,064.43        |
| 负债和所有者权益总计    | 5,521,594.43        |

## 五、 清算情况

自2018年10月9日至2018年11月2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余额为人民币71,886.90元，截至2018年11月2日存出保证金余额为人民币23,760.85元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(2) 本基金最后运作日应收银行存款利息人民币1,237.26元及应收存出保证金利息人民币54.91元，共计人民币1,292.17元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币2,821,040.68元，两只股票均系承诺12个月限售期（老股转让部分）的网下投资者配售（以下简称“老股配售”）所得，尚处于12个月锁定期中而未能变现，明细如下：

金额单位：人民币元

| 证券代码   | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日      | 流通受限类型 | 认购价格  | 最后运作日估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 最后运作日成本总额    | 最后运作日估值总额    |
|--------|------|------------|-----------|--------|-------|-----------|--------------|--------------|--------------|
| 300713 | 英可瑞  | 2017/10/23 | 2018/11/1 | 老股配售受限 | 40.29 | 24.76     | 12,614       | 282,352.32   | 312,322.64   |
| 603156 | 养元饮品 | 2018/2/2   | 2019/2/1  | 老股配售受限 | 78.73 | 47.51     | 52,804       | 2,969,459.41 | 2,508,718.04 |

本基金持有的英可瑞股票已于2018年11月1日可流通日当日处置变现，处置价款为人民币317,966.80元，扣除交易费用人民币346.10元，实际收到的清算价款为人民币317,620.70元；待持有的养元饮品股票可流通之后，基金管理人将及时变现，并于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

### 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917.32元，该款项已于2018年11月1日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币183.46元，该款项已于2018年11月1日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币183.46元，该款项已于2018年11月1日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币113,649.55元，该款项已于2018年10月9日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币22,300.00元，包括应付上清所账户维护费人民币6,000.00元，上清所查询服务费人民币300.00元和中债登账户维护费人民币6,000.00元，以上款项已于2018年10月19日支付；应付中国证券报信息披露费人民币5,000.00元和应付深圳证券时报信息披露费人民币5,000.00元，以上款项已于2018年10月26日支付。
- (6) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币45,296.21元，包括应付东方证券席位佣金人民币45,133.71元，该款项已于2018年10月16日支付；应付外汇交易中心费人民币12.50元，该款项已于2018年10月17日支付；应付中债登现券交易手续费人民币150.00元，该款项已于2018年10月19日支付。

### 4、清算期间的清算损益情况

| 项目             | 自2018年10月9日<br>至2018年11月2日<br>止清算期间 |
|----------------|-------------------------------------|
| 一、收益           |                                     |
| 1、利息收入（注1）     | 1,773.08                            |
| 2、处置价差投资收益（注2） | 35,614.48                           |
| 3、公允价值变动损益（注3） | (361,051.40)                        |
| 收益小计           | <u>(323,663.84)</u>                 |
| 二、费用           |                                     |
| 1、清算费用（注4）     | 678.62                              |
| 费用小计           | <u>678.62</u>                       |
| 三、清算期间净收益      | <u>(324,342.46)</u>                 |

注1：利息收入系计提的自2018年10月9日至2018年11月2日止清算期间的银行存款利息收入人民币1,720.89元和存出保证金利息收入人民币52.19元。

注2：处置价差投资收益系本基金持有的英可瑞股票于2018年11月1日处置变现后的投资收益金额。

注3：本基金通过老股配售获得的股票采用基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引》中的估值公式进行估值。公允价值变动损益系流通受限股票在第一次清算期间采用该指引的估值方法估值导致（金额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678.62元，系上清所查询服务费和卖出证券交易费用，已分别于2018年10月19日，2018年11月1日和2018年11月2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10月8日基金净资产           | 5,339,064.43 |
| 加：自2018年10月9日至2018年11月2日止清算期间净收益 | (324,342.46) |
| 二、2018年11月2日基金净资产                | 5,014,721.97 |

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。

截止2018年11月2日，本基金剩余财产为人民币5,014,721.97元，其中未变现的资产包括交易性金融资产人民币2,177,636.96元（该金额为流通受限股票于本基金第一次清算结束日估值金额，与流通受限股票可流通后的实际变现金额可能存在差异），存出保证金人民币23,760.85元，银行存款及存出保证金产生的利息人民币3,065.25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11月2日，本基金本次可向份额持有人划拨的清算款为人民币2,810,258.91元，将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。剩余未分配的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、《中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《中海中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。

### （二） 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组  
二〇一九年一月二十三日