

中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：2018年12月10日

报告公告日期：2019年3月2日

一、重要提示

中欧优势行业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”)证监许可[2017]1735号《关于准予中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集208,824,437.45元。经向中国证监会备案,《中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年6月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为208,828,410.48份基金份额,包含认购资金利息结转的份额3,973.03份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

基金管理人根据《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》和《中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定于2018年10月16日至2018年11月9日期间以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,大会表决时间于2018年11月9日17:00截止,审议了《关于终止中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于2018年11月13日表决通过了《关于终止中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。基金管理人于2018年11月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站刊登了《关于中欧优势行业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公告》。

本基金从2018年11月15日起进入清算程序,由本基金管理人中欧基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师和上海市通力律师事务所律师组成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。

二、基金概况

1、基金名称：中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金。基金简称：中欧优势行业灵活配置混合。基金代码：005278

2、基金运作方式：契约型、开放式

3、基金合同生效日：2018年6月13日

4、基金运作终止日：2018年11月14日。基金份额总额：497,499.45份，基金份额净值为人民币1.0615元。

5、投资目标：本基金以对经济周期、产业周期判断为基础，深入研究经济周期与产业周期发展与变化趋势，投资于那些在产业周期变化和发展趋势上具有相对优势、具有持续增长潜力的优质上市公司，在严格控制投资组合风险的前提下，通过灵活的资产配置，力争实现资产的持续稳健增长。

6、投资策略：资本市场是经济的晴雨表，本基金综合分析宏观经济环境、政策形势、市场情绪等因素，判断经济周期与趋势，并据此主动判断市场方向，进行相应资产配置。本基金将在宏观经济衰退末期、复苏和繁荣周期阶段，积极增加权益类资产投资比例；在宏观经济衰退阶段，主动降低权益类资产投资比例，降低组合的风险暴露度，稳健运作。

7、业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

8、风险收益特征：本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

9、基金管理人：中欧基金管理有限公司

10、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

三、基金最后运作日财务会计报告（经审计）

1、资产负债表

会计主体：中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年11月14日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产 2018年11月14日
(基金最后运作日)

资产：

银行存款 527,789.35

交易性金融资产 -

其中：债券投资 -

买入返售金融资产 -
应收利息 657.23
资产总计 528,446.58
负债和所有者权益
负债：
应付管理人报酬 305.90
应付托管费 51.00
应付销售服务费 -
应付交易费用 -
其他负债 -
负债合计 356.90
所有者权益：
实收基金 497,499.45
未分配利润 30,390.23
所有者权益合计 528,089.68
负债和所有者权益总计 528,446.58

四、清盘事项说明

1、清算原因

本基金基金份额持有人大会通过《关于终止中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》。

2、清算起始日

本基金于 2018 年 11 月 15 日起进入清算期，清算期为 2018 年 11 月 15 日至 2018 年 11 月 21 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。

五、清算情况

自 2018 年 11 月 15 日至 2018 年 11 月 21 日清算期间，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、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，根据基金合同的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用由基金管理人代为支付。

2、资产清算情况

(1) 本基金最后运作日应收活期存款人民币 527,789.35 元，结算备付金和存出保证金余额为 0。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币 657.23 元，均为银行存款利息，以上利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，于清算款划出日前划入托管账户，垫付资金待结息款到账后将返还给管理人。

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 305.90 元，该款项已于 2018 年 12 月 4 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 51.00 元，该款项已于 2018 年 12 月 4 日支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目 自 2018 年 11 月 15 日
至 2018 年 11 月 21 日清算期间止

一、清算收益

利息收入 24.18

处置交易性金融资产产生的收益

赎回费收入 1,037.94

清算收入小计 1,062.12

二、清算费用

清算费用小计

三、清算净收益 1,062.12

表中相关项目具体说明如下：

(1) 利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2018 年 11 月 15 日至 2018 年 11 月 21 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息及债券投资利息（包括基金管理人垫付资金本金产生的利息）。

(2) 赎回费收入系 2018 年 11 月 14 日投资者赎回申请产生的归入基金资产的赎回费部分。

5、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2018 年 11 月 14 日基金净资产 528,089.68

加：清算期间净收益 1,062.12

减：基金赎回金额 415,173.33

二、2018 年 11 月 21 日基金净资产 113,978.47

截至本次清算期结束日 2018 年 11 月 21 日，本基金剩余财产为人民币 113,978.47 元。清算起始日 2018 年 11 月 15 日至清算款划出日前一日的存款利息亦属份额持有人所有，该部分利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

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

(1) 《中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2018 年 11 月 14 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

(2) 通力律师事务所关于《中欧优势行业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

本基金管理人中欧基金管理有限公司办公地点——中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 5 层。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

中欧优势行业灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

二〇一九年三月二日