

中金新安灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告出具日期：2019年8月23日

报告公告日期：2019年9月19日

1 重要提示

中金新安灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]1516号文注册，于2017年2月

8日经中国证监会证监许可[2017]307号批复准予延期募集，2017年3月29日基金合同生效。本基金的基

金管理人为中金基金管理有限公司，本基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”

的约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不超过200人或者基金资产净

值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现基金资产净值低

于5000万元情形的，本基金基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会；连续60个工作日出现基

金份额持有人数量不满200人情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案，并召开

基金份额持有人大会进行表决。”

截至2019年7月29日日终，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，触发

《基金合同》中约定的基金合同终止条款。本基金将根据《基金合同》的约定进入基金财产的清算程序

并终止，无须召开基金份额持有人大会。

本基金自2019年7月30日起进入清算期，由基金管理人中金基金管理有限公司、基金托管人中国建

设银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财

产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（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 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称 中金新安灵活配置混合型证券投资基金

基金简称 中金新安

基金主代码 004385

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2017年3月29日

基金管理人 中金基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

最后运作日（2019年7月29日）

基金份额总额 7,739,237.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标 在风险可控的前提下，力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。

投资策略

本基金的投资策略主要包括大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、权益类资产投资策略以及期货投资策略。

（一）大类资产配置策略。

本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较债券市场、股票市场、及现金类资产的收益风险特征，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。

（二）固定收益资产投资策略。

本基金投资组合在进行固定收益类资产的投资时，主要通过分析宏观经济形势、货币政策、财政政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。

（三）权益类资产投资策略

本基金将重点投资于具备内生性增长基础或具备外延式扩张能力的价值创造型企业，并重点关注相关个股的安全边际及绝对收益机会。在股票选择方面，充分发挥“自下而上”的主动选股能力，结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司内生性增长动力的判断，结合财务与估值分析，深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司，构建股票投资组合。同时将根据行业、公司状况的变化，基于估值水平的波动，动态优化股票投资组合。

（四）期货投资策略

本基金的期货策略主要为对冲策略。本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。本基金将按照现货头寸和股票特性，使用量化方法剥离并测算整体的市场风险，进而动态调整期货对冲的数量，以达到对冲市场风险。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

风险收益特征 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资基金和货币市场基金。

3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

资产负债表

会计主体：中金新安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年7月29日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产 本期末 2019年7月29日

(基金最后运作日)

资产： -

银行存款 28,866,662.35

结算备付金 1,676,703.64

存出保证金 17,237.61

交易性金融资产 5,057,628.96

其中：股票投资 5,057,628.96
基金投资 -
债券投资 -
资产支持证券投资 -
贵金属投资 -
衍生金融资产 -
买入返售金融资产 -
应收证券清算款 7,445,562.08
应收利息 5,843.84
应收股利 -
应收申购款 1,996.12
递延所得税资产 -
其他资产 -
资产总计 43,071,634.6

负债和所有者权益 本期末 2019 年 7 月 29 日
(基金最后运作日)

负债： -
短期借款 -
交易性金融负债 -
衍生金融负债 -
卖出回购金融资产款 -
应付证券清算款 -
应付赎回款 33,795,461.16
应付管理人报酬 23,324.91
应付托管费 4,998.17
应付交易费用 44,988.51
应交税费 -
应付利息 -
应付利润 -
递延所得税负债 -
其他负债 35597.32
负债合计 33,904,370.07
所有者权益： -

实收基金 7,739,237.09
未分配利润 1,428,027.44
所有者权益合计 9,167,264.53

负债和所有者权益总计 43,071,634.60

注：报告截止日 2019 年 7 月 29 日(基金最后运作日)，中金新安份额净值 1.185 元，基金份额 7,739,237.09 份。

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

中金新安灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以

下简称“中国证监会”)于2015年7月6日证监许可[2015]1516号《关于准予中金新安灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金新安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《中金新安灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金的基金管理人为中金基金,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

本基金通过中金基金直销中心、中国中投证券有限责任公司(以下简称“中投证券”)、平安证券有限责任公司、北京汇成基金销售有限公司等共同发售,募集期为2017年3月20日至2017年3月27日。经向中国证监会备案,《中金新安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月29日正式生效,合同生效日基金实收份额为412,253,948.92份,发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中金新安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中金新安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债券)、次级债、短期融资券、中期票据等)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

根据《基金合同》的规定以及中金基金发布的《关于中金新安灵活配置混合型证券投资基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金自2019年7月30日进入清算程序。中金基金和建设银行按照《基金合同》的规定对本基金进行终止清算,清算工作于2019年8月1日完成。中金新安基金的清算期间为自2019年7月30日“(清算起始日)”开始至2019年8月1日“(清算结束日)”止期间。

4.2 清算原因

根据《基金合同》“第五部分基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”

的约定：

“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不超过 200 人或者基金资产净值

低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现基金资产净值低于

5000 万元情形的，本基金基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会；连续 60 个工作日出现基金

份额持有人数量不满 200 人情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案，并召开基

金份额持有人大会进行表决。”

截至 2019 年 7 月 29 日日终，本基金已连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元，触发基金合

同中约定的基金终止条款。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》有关约定，本基金将根据《基

金合同》约定进入清算程序并终止，且无需召开基金份额持有人大会。

4.3 清算起始日

本基金于 2019 年 7 月 30 日起进入清算期，清算期为 2019 年 7 月 30 日至 2019 年 8 月 1 日。

4.4 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。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。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。

5 清算情况

自 2019 年 7 月 30 日至 2019 年 8 月 1 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：

5.1 清算费用

按照《中金新安灵活配置混合型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”的规定，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。

5.2 资产处置情况

(1) 银行存款、备付金、保证金及应收款项资产处置情况

序号 项目 运作终止日账面价值 清算金额 清算期末账面价值

1 银行存款 28,866,662.35 -25,412,487.21 3,454,175.14

2 结算备付金（注 1） 1,676,703.64 0.00 1,676,703.64

3 存出保证金（注 1） 17,237.61 0.00 17,237.61

4 应收证券清算款 7,445,562.08 -7,445,562.08 0.00

5 应收利息（注 1） 5,843.84 729.49 6,573.33

6 应收申购款 1,996.12 -1,996.12 0

注 1：结算备付金、存出保证金、应收利息由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付

至本基金托

管账户，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。

(2) 金融资产处置情况

序

号 项目

运作终止

日账面价

值

运作终

止日数

量(股

/份/张)

清算期

内最后

处置日

清算金额

清算期期

末账面价

值(注

2)

清算期

期末数

量(股

/份/张)

1 股票投资 5,057,628.96 116,130.00 2019/7/31 5,025,889.35 65,583.72 7,792.00

注 2: 本基金清算期截止日(2019 年 8 月 1 日)持有的全部股票明细如下:

序号 股票代码 股票名称 股票数量(股) 价格

(人民币元)

最后运作日估值金额

(人民币元)

1 603613 国联股份 332 26.37 8,754.84

2 603530 神马电力 941 5.94 5,589.54

3 002966 苏州银行 6,519 7.86 51,239.34

合计 65,583.72

注 3: 本基金于 2019 年 7 月 17 日对小熊电器(002959)进行询价,将于 2019 年 8 月 16 日进行缴款。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 33,795,461.16 元,该款项已于 2019 年 8 月 1 日支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 23,324.91 元,该款项已于 2019 年 7 月 31 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,998.17 元,该款项已于 2019 年 7 月 31 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 44,988.51, 待剩余资产变现后与剩余资产变现产生交易费用一并由基金管理人在清算款划出前扣除。

(5) 本基金最后运作日其他负债人民币 35,597.32 元, 其中应付赎回费 1,117.74, 款项已于 2019 年 8 月 1 日支付, 其中预提信息披露费 11,505.9 元, 预提审计费 20,136.9 元, 预提银行间账户维护费 2,836.78, 另 136.9 元审计费于 2019 年 7 月 30 日进行回冲, 相关费用将由基金管理人在清算款划出前扣除。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目

本期

2019 年 7 月 30 日(基金清算起始日)至 2019 年 8 月 1 日
(基金清算结束日)止期间

一、资产处置损益 29,691.14

1. 利息收入 729.49

其中: 存款利息收入 729.49

债券利息收入 -

买入返售金融资产收入 -

2. 投资收益(损失以“-”填列) 758,410.26

其中: 股票投资收益 769,044.92

债券投资收益 -

股利收益 -10,634.66

3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) -729,723.13

4. 其他收入(损失以“-”号填列) 274.52

二、清算费用 34,283.42

1. 交易费用 9,157.10

2. 其他费用 25,126.32

三、清算净损益(净亏损以“-”号填列) -4,592.28

注: 其他费用包括本清算报告出具法律意见的律师费用、回冲的审计费用及银行间账户费用。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位: 人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2019 年 7 月 29 日基金净资产

加: 清算期间净收益

9,167,264.53

-4,592.28

减: 基金净赎回金额(于 2019 年 7 月 30 日
确认的投资者申购赎回转出申请) 4,049,072.64

二、2019 年 8 月 1 日基金净资产 5,113,599.61

资产处置及负债清偿后, 于 2019 年 8 月 1 日本基金剩余财产为人民币 5,113,599.61 元, 其中截至 8 月

1 日剩余财产未包含于 2019 年 8 月 16 日缴款的小熊电器，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（含小熊电器）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。清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息归份额持有人所有。于清算划款日的应收利息余额、备付金、保证金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。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。除清算划款产生的银行汇划费从基金资产中支付外，其他与本次清算相关产生的银行汇划费由基金管理人承担。由于截止 2019 年 8 月 1 日的基金净资产中包含了备付金、保证金、应收利息、股票等，截止 2019 年 8 月 1 日股票持仓明细详见 5.2 章节注 2，将在划付本次清算金额（含费用）后对基金剩余财产进行后续清算，直至全部基金财产清算完毕。

5.6 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。

6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- （1）中金新安灵活配置混合型证券投资基金资产负债表及审计报告
- （2）《中金新安灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 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。

中金新安灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

二〇一九年九月十九日