

新华家盈双利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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2019年12月13日

清算报告公告日期：2020年2月14日

一、 基金简介

1、基本情况

新华家盈双利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【2018】1015号文《关于准予新华家盈双利混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，由新华基金管理股份有限公司发起募集的契约型开放式混合型证券投资基金，存续期不设定。于2018年12月18日通过新华基金管理股份有限公司的直销中心和取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议代为办理基金销售业务的代销机构公开发售，发行期限：2018年12月18日至2019年02月28日。首次募集资金总额294,276,669.23元，其中募集资金产生利息23,547.06元，并经瑞华会计师事务所瑞华验字[2019]第01360006号验资报告予以验证。2019年03月05日办理基金备案手续，基金合同正式生效。申请发行基金募集份额不少于2亿份，本基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《新华家盈双利混合型证券投资基金招募说明书》及《新华家盈双利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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、（超）短期融资券）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款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的相关规定）。

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。

基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的60%；权证投资占基金资产净值的比例为0-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

本基金业绩比较标准为：上证国债指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×25%。

本基金从 2019 年 03 月 05 日起运作至 2019 年 11 月 29 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》的相关规定及《新华家盈双利混合型证券投资基金基金合同》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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

截至 2019 年 11 月 22 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，已触发本基金合同中约定的基金合同终止条款。根据基金合同有关约定，本基金将依据基金财产清算程序进行财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会审议。

3、清算起始日

根据《新华基金管理股份有限公司关于新华家盈双利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》，本基金于 2019 年 11 月 30 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2019 年 11 月 30 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，锁定期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：新华家盈双利混合型证券投资基金

报告截止日：2019年11月29日

单位：人民币元

项目	报告截止日：2019年11月29日
资产：	
银行存款	9,808,007.71
结算备付金	113,116.31
结算保证金	3,526.16
应收利息	2,540.09
应收申购款	
交易性金融资产	621,447.47
其中：股票投资	619,447.50
债券投资	1,999.97
买入返售金融资产	
证券清算款	10,205,113.05
资产总计	20,753,750.79
负债：	
应付管理人报酬	22,135.58
应付托管费	4,427.15
应付销售服务费	3,332.54
应付交易费用	9,569.93
应付赎回款	10,577,705.45
应付赎回费	6,866.35
应付税费	919.14
其他负债	28,676.94
负债合计：	10,653,633.08
所有者权益：	
实收基金	9,842,153.57
未分配利润	257,964.14

所有者权益合计	10,100,117.71
---------	---------------

注：报告截止日 2019 年 11 月 29 日，基金份额净值 A 类 1.0283 元，C 类 1.0230 元，基金份额 A 类 5,909,311.88 份，C 类 3,932,841.69 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 2019 年 11 月 30 日 至 2019 年 12 月 13 日止清算 期间
一、清算收入	
加：利息收入-银行存款利息收入 (注 1)	2,196.41
利息收入-债券利息收入	0.02
加：卖出债券收入(注 2)	259.84
加：赎回费收入	550.72
减：股息红利税	9,708.69
清算收入小计	-6,701.70
二、清算费用	
汇划手续费	0
三、清算净收益	-6,701.70

注 1：利息收入系以当前适用的利率计提的自 2019 年 11 月 30 日至 2019 年 12 月 13 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；

2:2019 年 12 月 02 日以 113.00 元/张价格卖出川投转债（债券代码 110061）20 张，共计 2260.00 元,确认净收益 259.84 元。

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、2019年11月29日基金净资产	10,100,117.71
加：清算期间净收益	-6,701.70
减：清算期间支付赎回款、转出款	2,666,076.44
二、2019年12月13日基金净资产	7,427,339.57

3、资产清算情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金余额113,116.31元，2019年12月03日划入托管户76,653.67元；

(2) 本基金最后运作日结算保证金余额3,526.16元，2019年12月03日划出托管户3,528.95元；

(3) 本基金最后运作日债券投资余额1,999.97元，应收利息0.17元，清算期间利息收入0.02元，2019年12月02日以113.00元/张价格卖出川投转债（债券代码110061）20张，共计清算款2260.00元，已于2019年12月03日划入托管户。

4、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理费余额22,135.58元，已于2019年12月03日从托管户划出；

(2) 本基金最后运作日应付托管费余额4,427.15元，已于2019年12月03日从托管户划出；

(3) 本基金最后运作日应付税费余额919.14元，已于2019年12月09日从托管户划出；

(4) 本基金最后运作日其他负债余额28,676.94元，其中银行汇划手续费595.38元，2019年第三季度上清结算费用1320.00元、上清查询费300.00元、上清账户维护费4500.00元已于2019年12月06日从托管户划出；

(5) 本基金最后运作日应付赎回款余额10,577,705.45元，其中9,063,216.19元已于2019年12月02日从托管户划出，其中1,514,489.26元已于2019年12月03日从托管户划出；

(6) 本基金最后运作日应付赎回费余额6,866.35元,其中6,023.09元已于2019年12月02日从托管户划出,其中843.26元已于2019年12月03日从托管户划出;

(7) 2019年12月02日确认的应付赎回费和应付赎回款2,666,076.44元,其中550.72元确认为赎回费收入,其余2,665,525.72元已于2019年12月04日从托管户划出。

5、停止运作后的清算损益情况说明

本基金于2019年11月30日起进入清算期,截至2019年12月13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6,791,169.48元,备付金36,462.64元,保证金7,055.11元,应收利息4,736.33元,股票投资619,447.50元。交易费用、预提费用(中债账户维护费、审计费用)、其他应付款(银行汇划手续费)等负债31,531.49元,基金净资产7,427,339.57元。

其中交易性金融资产-股票投资619,447.50元,该金额为本基金持有的报告截止日因新股中签处在锁定期而无法变现的股票“渝农商行(601077)”,渝农商行(601077)因处在锁定期,自2019年10月29日起按照流动性折扣估值,具体详见基金管理人于2017年12月22日发布的《关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告》,该股票从进入清算期至该股票卖出前,均以该基金最后一个交易日的锁定期限售价格估值,即6.21元/股。

本基金报告截止日(2019年11月29日)持有的流通受限股票明细如下:

股票代码	股票名称	锁定日期	锁定原因	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601077	渝农商行	2019-10-29	新股锁定期	6.21	99,750	734,160.00	619,447.50	

截至本次清算期结束日（2019年12月13日），本基金所持上述股票未解除锁定。由于该股票的限售期结束日为2020-04-28，因此待本基金所持该股票限售结束变现后，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。因上述股票变现金额存在不确定性，因而最终有可能无法按照清算报告中净值予以清盘，实际清盘净值以所持股票全部变现为准。

根据本基金的《基金合同》约定以及《新华家盈双利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》，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，如因持有停牌证券暂时无法变现的，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。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。

五、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 新华家盈双利混合型证券投资基金清算审计报告
- (2) 关于《新华家盈双利混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公住所

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

新华家盈双利混合型证券投资基金财产清算小组

2019年12月13日