

新华阿鑫二号保本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：平安银行股份有限公司

清算报告公告日：2018年2月9日

一、基金简介

1、基本情况

新华阿鑫二号保本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

【2015】1918号文《关于准予新华阿鑫二号保本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作为管理人，发平安银行股份有限公司作为托管人的契约型开放式混合型证券投资基金，存续期不限定。于2015年11月11日通过新华基金管理股份有限公司的直销中心公开发售，发行期限为2015年11月11日至2015年11月17日。首次募集资金总额1,146,566,354.54元，其中募集资金产生利息74,354.54元，并经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）瑞华验字[2015]第01360024号验资报告予以验证。2015年11月19日办理基金备案手续，基金合同正式生效。

根据《新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金招募说明书》及《新华阿鑫二号保本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债券、股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证、资产支持证券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）。本基金将依照投资组合保本策略将基金资产配置于固定收益资产与风险资产：固定收益资产为国内依法发行交易的债券（包括国债、央行票据和政策性金融债、企业债、中小企业私募债券、可转换公司债（含分离交易的可转换公司债券）、短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具和银行存款等固定收益资产；风险资产为股票、权证等权益类资产。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。

本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；债券、货币市场工具等固定收益资产占基金资产的比例不低于60%，在每个开放期间的前3个月、开放期间及开放期的后3个月不受前述投资组合比例的限制。在开放期，本基金持有现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，在保本周期内（保本周期到期日除外），本基金不受该比例的限制。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。本基金业绩比较基准为（一年期银行定期存款税后收益率+1%）*1.5。

本基金为保本基金，保本周期为24个月，本基金保本周期自2015年11月19日起至2017年11月20日止，担保人由瀚华担保股份有限公司担任。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》、《关于避险策略

基金的指导意见》（以下简称《指导意见》）及监管机构的相关规定及《新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）的约定，本基金不再满足保本基金的存续条件。本基金于保本周期到期后终止并依法对基金财产进行清算。本基金从 2017 年 11 月 21 日起进入清算期，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

本基金不满足《指导意见》规定和《基金合同》约定的存续要求，根据《基金合同》的约定，本基金将终止并进入清算程序。

3、清算起始日

根据《新华阿鑫二号保本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 2017 年 11 月 21 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2017 年 11 月 21 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。

三、财务报告

资产负债表

会计主体：新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 11 月 20 日

单位：人民币元

项目 最后运作日：2017 年 11 月 20 日

资产：

银行存款 1,259,775,216.49

结算备付金 22,551.18

存出保证金 36,931.47

应收利息 86,485.07

交易性金融资产 -

买入返售金融资产 -

其他资产 -

资产总计 1,259,921,184.21

负债：

应付管理人报酬 551,344.11

应付托管费 68,918.01

应付销售服务费 68,918.01

应付交易费用 225,402.13

应付利润

应交税费

其他负债 363,313.16

负债合计: 1,277,895.42

所有者权益:

实收基金 1,146,566,354.54

未分配利润 112,076,934.25

所有者权益合计 1,258,643,288.79

负债和所有者权益总计 1,259,921,184.21

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 2017 年 11 月 21 日

至 2017 年 11 月 27 日止清算期间

一、清算收入

利息收入-银行存款利息收入(注 1) 25,345.30

四舍五入尾差补足款(注 2) 35,000.00

清算收入小计 60,345.30

二、清算费用

银行间账户维护费

银行划款手续费

清算费用小计

三、清算净收益 60,345.30

注 1: 利息收入系以当前适用的利率计提的自 2017 年 11 月 21 日至 2017 年 11 月 27 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。

注 2：根据《关于新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金提高份额净值精度的公告》，为精确体现持有人利益，基金管理人与托管行协商一致，决定自 2017 年 11 月 20 日起提高本基金份额净值精度至小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。由于提高份额净值精度导致 2017 年 11 月 27 日基金资产小于负债，管理人于 2017 年 11 月 24 日补足资金 35,000.00 元用于后续清偿基金债务，若待基金清偿完所有债务后仍有剩余则返还至管理人。

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、最后运作日 2017 年 11 月 20 日基金净资产 1,258,643,288.79

加：清算期间净收益 60,345.30

加：应付利润结转实收基金 0.00

减：保本到期日赎回转出款（注：1） 1,258,700,551.27

二、2017 年 11 月 27 日基金净资产 3,082.82

注 1：根据《新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》、《关于新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第一次提示性公告》和《关于新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第二次提示性公告》，本基金的开放期为保本周期到期日，即 2017 年 11 月 20 日为开放期。本公司于 2017 年 11 月 21 日对份额持有人 2017 年 11 月 20 日的赎回申请进行了确认，共计赎回份额 1,146,566,354.54 份，并于 2017 年 11 月 21 日支付赎回款共计 1,258,700,551.27 元。

3、停止运作后的清算损益情况说明

本基金于 2017 年 11 月 21 日起进入清算期，截至 2017 年 11 月 27 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 1,109,665.22 元，结算备付金 22,551.18，存出保证金 36,931.47 元，应收利息 111,830.37 元，管理费、托管费、销售服务费、交易费用、预提费用（上清中债账户维护费、信息披露费用、审计费用）等负债 1,277,895.42 元，基金净资产 3,082.82 元。其中存出保证金 36,931.47 元，将于 2017 年 12 月份变现；应收利息将于 1 月末结息变现，此后新产生的利息将在销户结息时变现。

考虑到本基金清算的实际情况，在清算期间产生的事务所律师费等其他清算费用，均由基金管理人承担，具体金额以缴费通知为准。

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、备查文件目录

1、备查文件目录

(1) 新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金清算审计报告

(2) 通力律师事务所关于《新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

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

新华阿鑫二号保本混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018年2月9日