

# 海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇一八年六月十二日

清算报告公告日期：二〇一八年七月二十一日

## §1 重要提示

海富通东财大数据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【2015】3083号《关于准予海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册募集。基金管理人为海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。本基金为契约型、开放式证券投资基金。《海富通东财大数据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”或“《基金合同》”)于2016年1月29日正式生效。截至2018年4月27日,本基金已经连续60个工作日基金资产净值低于5000万元。

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》、《基金合同》的有关规定,鉴于本基金出现了基金合同终止事由,为维护基金份额持有人利益,基金管理人与基金托管人协商一致后,决定终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序,此事项不需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于2018年5月2日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站刊登了《关于海富通东财大数据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》。本基金的最后运作日定为2018年5月10日,并于2018年5月11日进入清盘期。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2018年5月4日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(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报告出具法律意见。

## §2 基金产品概况

基金名称	海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金
------	-----------------------

基金简称	海富通东财大数据混合
基金主代码	519132
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月29日
基金最后运作日(2018年5月10日)基金份额总额	6,535,890.35
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过灵活有效的资产配置策略和个股精选策略，实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
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，属于中等风险水平的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### §3 基金运作情况概述

本基金经由中国证监会证监许可【2015】3083号《关于准予海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册募集，为契约型、开放式证券投资基金，基金简称为海富通东财大数据混合(基金代码：519132)。《海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年1月29日正式生效，共募集326,320,977.35份基金份额。截至2018年5月10日，本基金按基金合同正常运作。

依据《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《基金合同》的有关规定，截至2018年4月27日，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元触发基金合同终止的情形，本基金应根据基金合同的约定进行清算并终止，此事项不需召开基金份额

持有人大会。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，基金管理人与基金托管人协商一致后，决定终止本基金基金合同。本基金最后运作日为2018年5月10日，清算期间为2018年5月11日至2018年6月12日。

## §4 财务报告

### 4.1 资产负债表

会计主体：海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年05月10日

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日 2018年05月10日
<b>资 产：</b>	
银行存款	5,153,577.55
结算备付金	18,774.68
存出保证金	23,063.28
交易性金融资产	1,185,200.00
其中：股票投资	1,185,200.00
应收利息	5,899.66
资产总计	6,386,515.17
<b>负债和所有者权益</b>	<b>基金最后运作日 2018年05月10日</b>
<b>负 债：</b>	
应付赎回款	71,345.34
应付赎回费	18.34
应付管理人报酬	3,809.75
应付托管费	595.28
应付交易费用	12,826.03
其他负债	132,900.00
负债合计	221,494.74
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	6,535,890.35

未分配利润	-370,869.92
所有者权益合计	6,165,020.43
负债和所有者权益总计	6,386,515.17

注：本基金最后运作日2018年05月10日，基金份额净值0.943元，基金份额总额6,535,890.35份。

## 4.2 利润表

会计主体：海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金

报告期间：2018年01月01日至2018年05月10日(基金最后运作日)

项目	本期
	2018年01月01日至2018年05月10日(基金最后运作日)
<b>一、收入</b>	-815,385.95
利息收入	20,938.89
其中：存款利息收入	20,938.89
债券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
投资收益(损失以“-”填列)	389,635.07
其中：股票投资收益	359,635.07
债券投资收益	-
股利收益	30,000
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,503,050.19
其他收入(损失以“-”号填列)	277,090.28
<b>减：二、费用</b>	365,115.30
管理人报酬	113,703.14
托管费	17,766.15
交易费用	151,461.01
利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
其他费用	82,185.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	-1,180,501.25
减：所得税费用	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	-1,180,501.25

注：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师陈玲、都晓燕签字出具了普华永道中天特审字(2018)第2206号标准无保留意见的审计报告。

## §5 基金财产分配

本基金自 2018 年 05 月 11 日起进入清算程序，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 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金金额 18,774.68 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所最低结算备付金。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 2 个工作日对最低结算备付金进行调整，本基金已于 2018 年 6 月 4 日收回结算备付金 18,774.68 元。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 23,063.28 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 2 个工作日对存出保证金进行调整，本基金已于 2018 年 6 月 4 日收回存出保证金 23,063.28 元。

5.1.3 本基金最后运作日交易型金融资产市值为 1,185,200.00 元。其中包括如下停牌股票资产：

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价 (单位:人民币元)	数量 (单位:股)	期末 成本总额	期末 估值总额	估值方法
600309	万华化学	2017/12/05	重大资产重组	35.35	20,00	730,698.21	707,000.00	指数收益法
002384	东山精密	2018/01/23	重大资产重组	23.91	20,00	605,023.97	478,200.00	指数收益法
合计						<b>1,335,722.18</b>	<b>1,185,200.00</b>	

截至 2018 年 6 月 12 日（本次清算期结束日），上述停牌股票已全部变现，变现总金额 1,443,882.33 元。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为 5,899.66 元。其中应收活期银行存款利息为 5,436.09 元，应收备付金利息为 408.99 元，应收保证金利息金额为 54.58 元。上述利息将于 6 月 21 日结息时收回。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款 71,345.34 元，该款项分别于 2018 年 05 月 11 日、2018 年 05 月 14 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付赎回费 18.34 元，该款项分别于 2018 年 05 月 11 日、2018 年 05 月 14 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付管理人报酬 3,809.75 元，该款项于 2018 年 06 月 05 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付托管费 595.28 元，该款项于 2018 年 06 月 05 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付交易费用 12,826.03 元，将于 2018 年 7 月支付二季度交易费用时支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债 132,900.00 元，其中包括：

5.2.6.1 应付审计费 60,000.00 元，其中 30,000.00 元已于 2018 年 05 月 16 日支付，剩余 30,000.00 元将在收到会计师事务所审计费发票后支付。

5.2.6.2 应付信息披露费 71,400.00 元，将在收到报社发票后支付。

5.2.6.3 应付银行间账户维护费 1,500.00 元，收到付费通知后，已于 2018 年 05 月 11 日支付。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2018年05月11日至2018年06月12日（本次清算期截止日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	3,709.10
2、股票变现损益	257,256.00
3、其他收入（注2）	1.81
清算收入小计	260,966.91
二、清算费用	
1、交易费用（注3）	2,909.86

2、银行汇划手续费	35.00
清算费用小计	2,944.86
三、清算净收益	258,022.05

注：

(1) 利息收入金额 3,709.10 元，系以当前适用的利率计提的自 2018 年 5 月 11 日至 2018 年 6 月 12 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。

(2) 其他收入为赎回费收入。

(3) 交易费用为本次清算期间股票资产变现所产生的交易费用。

#### 5.4 清算费用

根据本基金合同及相关法律规定，本基金上述交易费用与银行汇划手续费共计 2,944.86 元，由基金财产清算小组从基金财产中支付，其他清算费用由管理人代为支付。

#### 5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

项目	金额
一、最后运作日2018年05月10日基金净资产	6,165,020.43
加：清算期间净收益	258,022.05
加：清算期间基金份额交易产生的净值影响（注）	-21,347.11
二、2018年06月12日基金剩余资产净值	6,401,695.37

注：本基金最后运作日为 2018 年 05 月 10 日，最后运作日交易申请的确认为 2018 年 05 月 11 日。

截至本次清算期结束日 2018 年 06 月 12 日，本基金剩余财产为人民币 6,401,695.37 元。自本次清算期结束日次日(2018 年 06 月 13 日)至托管账户销户之日的银行存款产生的利息亦归基金份额持有人所有。管理人将于收到中国证券监督管理委员会关于清算备案的回函后，先将本基金托管账户内现金资产支



付给基金份额持有人，待托管账户销户后，再将本基金剩余资产全部分配给基金份额持有人。

本基金所有剩余财产将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将根据法律法规及本基金的基金合同约定及时行分配。待基金托管账户销户后，基金管理人将对剩余资产再次进行分配，届时将不再另行出具公告。

# §6 备查文件

## 6.1 备查文件目录

- 1、海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 05 月 10 日（最后运作日）资产负债表及审计报告
- 2、《海富通东财大数据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。

海富通东财大数据灵活配置混合型证券投资基金  
基金财产清算小组

二〇一八年六月十二日

