

新华精选低波动股票型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日期：2019年3月22日

清算报告公告日期：2019年6月15日

一、 基金简介

1、基本情况

新华精选低波动股票型证券投资基金由新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型而成。

新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2014 年 4 月 2 日经中国证监会证监许可[2014]351 号文准予募集注册，基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。新华鑫安保本一号混合型证券投资基金自 2014 年 5 月 26 日至 2014 年 6 月 13 日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会机构部函[2014]552 号确认，《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 18 日生效。

根据《新华鑫安保本一号混合型证券投资基金基金合同》的约定，保本周期届满时，若新华鑫安保本一号混合型证券投资基金未能符合保本基金存续条件，则转型为非保本的股票型证券投资基金，基金名称相应变更为“新华精选低波动股票型证券投资基金”。新华鑫安保本一号混合型证券投资基金于 2018 年 1 月 26 日第三个保本周期到期不符合保本基金存续条件，2018 年 2 月 3 日起新华鑫安保本一号混合型证券投资基金转型为新华精选低波动股票型证券投资基金，《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》生效。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 80—95%，其中投资于本基金界定的低波动率股票的比例不低于非现金资产的 80%，债券投资占基金资产的比例范围为 0—20%；本基金保持现金或者到期日在 1 年以内的政府债券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。

本基金从 2019 年 03 月 16 日起进入清算期，基金清算期自 2019 年 03 月 16 日起至 2019 年 03 月 22 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

为保护基金份额持有人利益，根据市场环境的变化，本基金管理人依据《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《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，提议终止《新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同》，并召开持有人大会进行表决。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，新华精选低波动股票型证券投资基金基金份额持有人大会于2019年3月14日表决通过了《关于终止新华精选低波动股票型证券投资基金基金合同的议案》，本次大会决议自该日起生效。

3、清算起始日

根据持有人大会通过的议案及方案说明，本基金将从2019年3月16日起进入清算期，故本基金清算起始日为2019年03月16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。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：新华精选低波动股票型证券投资基金

报告截止日：2019年03月15日

单位：人民币元

项目	报告截止日：2019年03月15日
资产：	
银行存款	752,112.50
结算备付金	12,926.79
存出保证金	20,656.53

应收利息	3,228.70
应收申购款	12,247.45
交易性金融资产	600,614.00
其中：股票投资	600,614.00
买入返售金融资产	
证券清算款	664,999.78
资产总计	2,066,785.75
负债：	
应付管理人报酬	940.85
应付托管费	125.45
应付交易费用	318,198.15
应付赎回款	4,419.71
应付赎回费	0.49
其他负债	83,165.87
负债合计：	406,850.52
所有者权益：	
实收基金	1,551,061.20
未分配利润	108,874.03
所有者权益合计	1,659,935.23

注：报告截止日 2019 年 03 月 15 日，基金份额净值 0.8563 元，基金份额总额 1,938,415.82 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 03 月 16 日 至 2019 年 03 月 22 日止清算 期间
一、清算收入	8627.96
利息收入-银行存款利息收入(注 1)	205.51

投资收益	8189.58
公允价值变动损益	-2933.00
已计提无需支付的审计费	3165.87
二、清算费用	1102.64
交易费用	1102.64
三、清算净收益	7525.32

注1：利息收入系以当前适用的利率计提的自2019年03月16日至2019年03月22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、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03月15日基金净资产	1,659,935.23
加：清算期间净收益	7,525.32
应收申购款	22,396.43
减：应付赎回款	1558.63
二、2019年03月22日基金净资产	1,688,298.35

3、停止运作后的清算损益情况说明

本基金于2019年03月16日起进入清算期，截至2019年03月22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2,054,379.98元，备付金12,926.79元，保证金20,656.53元，应收利息42.60元。管理费、托管费、交易费用、预提费用（审计费用）等负债399,707.55元，基金净资产1,688,298.35元。

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。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) 新华精选低波动股票型证券投资基金清算审计报告
- (2) 关于《新华精选低波动股票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

新华精选低波动股票型证券投资基金基金财产清算小组

2019年3月22日