

信达澳银新征程定期开放灵活配置 混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年12月1日

清算报告公告日：2021年12月9日

一、 重要提示

信达澳银新征程定期开放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 2017 年 8 月 9 日《关于准予信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2017】1462 号)注册公开募集,自 2018 年 3 月 27 日起基金合同生效,基金管理人为信达澳银基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定,“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成,行使下列职权:(二)决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”;第八十条规定,“有下列情形之一的,基金合同终止:(二)基金份额持有人大会决定终止”。根据《信达澳银新征程定期开放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“二、《基金合同》的终止事由”中约定,“有下列情形之一的,在履行相关程序后,《基金合同》应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定,“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,基金管理人已于2021年10月19日刊登了《关于以通讯方式召开信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,并于2021年10月20日、2021年10月21日陆续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会于2021年11月22日表决通过了本次会议议案,本次大会决议自该日起生效,基金管理人于2021年11月24日刊登了《关于信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于 2021 年 11 月 25 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、 基金概况

| | |
|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金名称 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 005168 |
| 基金运作方式 | <p>契约型、定期开放式</p> <p>本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式运作。本基金自基金合同生效之日（含）起或自每一开放期结束之日次日（含）起 3 个月的期间封闭运作，封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。</p> <p>本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日（含）起进入开放期，期间可以办理申购与赎回等业务，每个开放期原则上不少于五个工作日、不超过二十个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。</p> |
| 基金合同生效日 | 2018 年 3 月 27 日 |
| 最后运作日基金份额总额 （2021 年 11 月 24 日） | 2,635,953.46 |
| 投资目标 | 本基金在有效控制风险的前提下，运用多种投资策略，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资范围 | 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（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、债券（包括国内依法发行和上市交易的 |

| | |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、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。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。</p> <p>本基金的投资组合比例为:</p> <p>封闭期内,股票资产占基金资产的比例为 0%—100%; 开放期内,股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。开放期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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%; 封闭期内,本基金不受上述 5% 的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金; 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,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。</p> |
| 投资策略 | <p>本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%</p> |

| | | |
|------------------|------------------------------------------------------------------|---------------------|
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 信达澳银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合 A | 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005168 | 006463 |
| 最后运作日下属分级基金的份额总额 | 2,475,195.32 | 160,758.14 |

三、基金运作情况

信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证监会证监许可【2017】1462号文《关于准予信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由信达澳银基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开募集，基金合同于2018年3月27日生效。首次设立募集规模为232,561,227.02份基金份额。

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》、《信达澳银新征程定期开放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》”)的有关规定，经本基金份额持有人大会2021年11月22日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于2021年11月24日刊登了《关于信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金的最后运作日为2021年11月24日，自2021年11月25日起进入清算期。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表(已经审计)

会计主体：信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年11月24日

单位：人民币元

| | 最后运作日 2021年11月24日 |
|---------------|----------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 3,954,102.28 |
| 结算备付金 | - |
| 存出保证金 | 10,745.80 |
| 交易性金融资产 | - |
| 其中：股票投资 | - |
| 债券投资 | - |
| 应收利息 | 4,089.91 |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 3,968,937.99 |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | - |
| 应付管理人报酬 | 1,718.17 |
| 应付托管费 | 286.37 |
| 应付销售服务费 | 82.75 |
| 应交税费 | 1.51 |
| 其他负债 | 6,200.00 |
| 负债合计 | 8,288.80 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 2,635,953.46 |
| 未分配利润 | 1,324,695.73 |
| 所有者权益合计 | 3,960,649.19 |
| 负债和所有者权益总计 | 3,968,937.99 |

注：基金最后运作日2021年11月24日，信达澳银新征程定期开放混合A基金份额净值1.5080元，基金份额总额2,475,195.32份；信达澳银新征程定期开放混合C基金份额净值1.4188元，基金份额总额160,758.14份。

五、清算情况

自2021年11月25日至2021年12月1日止的清算期间内，信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资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。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

1、资产清算情况

(1) 本基金最后运作日存出保证金为人民币10,745.80元,为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算保证金和存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算保证金。该款项预计将由基金管理人信达澳银基金管理有限公司以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

(2) 本基金最后运作日应收利息人民币4,089.91元,其中应收银行存款利息人民币4,057.06元、应收清算备付金利息人民币0.02元、应收存出保证金利息人民币32.83元,该款项预计将由基金管理人信达澳银基金管理有限公司以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,718.17元,该款项已于2021年11月26日安排支付;

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币286.37元,该款项已于2021年11月26日安排支付;

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币82.75元,该款项已于2021年11月26日安排支付;

(4) 本基金最后运作日应付税费为人民币1.51元,该款项已于2021年11月26日安排支付;

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币6,200.00元,全部为预提银行间账户维护费,其中预提上交所账户服务费人民币3,200.00元,该款项已于2021年11月26日支付,预提中债登账户服务费人民币3,000.00元,该款项已于2021年11月25日支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

| 项目 | 自2021年11月25日至 2021年12月1日止清算期间 |
|------------|----------------------------------|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入(注1) | 233.64 |
| 清算收入小计 | 233.64 |
| 二、清算费用 | |

| | |
|---------|--------|
| 1、其他费用 | 35.00 |
| 清算费用小计 | 35.00 |
| 三、清算净收益 | 198.64 |

注1：利息收入系计提的自2021年11月25日至2021年12月1日止清算期间的银行存款利息和存出保证金利息。支付清算款之日前未收到部分由基金管理人信达澳银基金管理有限公司以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

4、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2021年11月24日基金净资产 | 3,960,649.19 |
| 加：清算期间净收益 | 198.64 |
| 二、2021年12月1日基金净资产 | 3,960,847.83 |

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(本基金清算过程中发生的审计费、律师费由基金管理人承担)、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，具体方式如下：

2021年12月1日本基金剩余财产为人民币3,960,847.83元，其中剩余未变现的资产为人民币15,069.35元，包括存出保证金人民币10,745.80元，及应收银行存款、清算备付金、存出保证金利息人民币4,323.55元。支付清算款之日前未变现的部分，将由基金管理人信达澳银基金管理有限公司以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

自2021年12月1日至清算款划出日前一日的归属于持有人的银行存款、存出保证金孳生的利息归份额持有人所有。基金管理人信达澳银基金管理有限公司垫付的银行存款自有资金到账日起至托管户销户为止孳生的利息归基金管理人所有，在相关账户销户后向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

5、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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》

(2) 《关于信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》

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免费查阅。

信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2021年12月1日