

新华恒益量化灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日期：2021年12月31日

清算报告公告日期：2022年2月21日

一、基金简介

1、基本情况

新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]509号文件“关于准予新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于2017年7月31日至8月25日募集净认购资金金额298,526,457.70元,募集资金产生利息103,982.80元,并经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)瑞华验字[2017]第01360033号验资报告予以验证。2017年9月1日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、权证、股指期货、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款等,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:股票投资(含存托凭证)占基金资产的比例为0-95%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,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。

本基金的业绩比较基准为:65%×中证800指数收益率+35%×中证综合债券指数收益率。

本基金从2021年12月20日起进入清算期,基金清算期自2021年12月20日起至2021年12月31日止,并由致同会计师事务所(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

根据基金合同第五部分“基金备案”中：“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模，《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。法律法规另有规定时，从其规定。”

截至 2021 年 12 月 15 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《关于新华恒益量化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》，本基金于 2021 年 12 月 20 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2021 年 12 月 20 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：新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 19 日

单位：人民币元

项目	报告截止日：2021 年 12 月 19 日
资产：	
银行存款	1,334,509.31

结算备付金	48,395.34
存出保证金	18,193.04
交易性金融资产	1,303,593.18
应收证券清算款	8,820,061.10
应收利息	5,759.79
资产总计	11,530,511.76
负债：	
应付管理人报酬	8,889.31
应付托管费	1,481.56
应付赎回款	461,359.94
应付交易费用	210,972.72
其他负债	136,373.32
负债合计：	819,076.85
所有者权益：	
实收基金	10,548,402.03
未分配利润	163,032.88
所有者权益合计	10,711,434.91
负债和所有者权益总计	11,530,511.76

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 2021 年 12 月 20 日 至 2021 年 12 月 31 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）	2,431.31
投资收益（注 2）	-41,355.06
公允价值变动损益	39,142.99
清算收入小计	219.24
二、清算费用	
交易费用	2,370.30
汇划手续费	205.00
清算费用小计	2,575.30
三、清算净收益	-2,356.06

注 1：利息收入系以当前适用的利率计提的自 2021 年 12 月 20 日至 2021 年 12 月 31 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：投资收益为交易性金融资产投资差价收入扣除其估值减值、交易费用以及应缴的股息红利税所得。

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 2021 年 12 月 19 日基金净资产	10,711,434.91
加：清算期间净收益	-2,356.06
减：赎回转出款	-89,910.12
二、2021 年 12 月 31 日基金净资产	10,619,168.73

3、停止运作后的清算损益情况说明

本基金于 2021 年 12 月 20 日起进入清算期，截至 2021 年 12 月 31 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 10,686,431.49 元，结算备付金 48,395.34，交易保证金 18,193.04 元，应收利息 2,204.67 元，预提费用（信息披露费用、审计费用）等负债 136,055.81 元，基金净资产 10,619,168.73 元。

其中应收利息 2,204.67 元将于 2022 年 3 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。

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。自 2021 年 12 月 20 日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息属于基金份额持有人所有，按实际适用的利率计算。因还需划付本基金运作产生的各项费用（如管理费、托管费、交易费用、预提费用等）以及清算款，由此产生的银行汇划费从基金资产中支付，实际金额以托管行实际收取为准。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告
- (2) 关于《新华恒益量化灵活配置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

新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2021年12月31日