

# 中欧睿选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：中欧基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日期：2019年11月1日

报告公告日期：2019年12月13日

## 一、重要提示

中欧睿选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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2054号文《关于准予中欧睿选定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批准,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧睿选定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集202,018,108.05元。经向中国证监会备案,《中欧睿选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》”)于2018年8月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为202,069,871.02份基金份额,包含认购资金利息结转的份额51,762.97份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“在任一开放期的最后一日日终,如发生以下情形之一的,则无须召开基金份额持有人大会,本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止:(1)基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于5000万元。(2)基金份额持有人人数少于200人。”

截至最近一次开放期的最后一日日终(2019年9月6日),基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于5000万元,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,无须召开基金份额持有人大

会, 本基金管理人应当依法履行基金财产清算程序并终止基金合同。本基金的最后运作日 2019 年 9 月 6 日, 基金管理人自 2019 年 9 月 9 日起根据相关法律法规、基金合同的规定履行基金财产清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见刊登在 2019 年 9 月 7 日《证券日报》、基金管理人网站和中国证监会基金电子披露网站上的《中欧基金管理有限公司关于中欧睿选定期开放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》。

本基金从 2019 年 9 月 9 日起进入清算期, 由本基金管理人中欧基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师和上海市通力律师事务所律师组成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。

## 二、基金概况

1、基金名称: 中欧睿选定期开放灵活配置混合型证券投资基金。基金简称: 中欧睿选定期开放灵活配置混合。基金代码: 005484

2、基金运作方式: 契约型开放式。

本基金以定期开放方式运作, 即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。

3、基金合同生效日: 2018 年 8 月 10 日

4、基金运作终止日: 2019 年 9 月 6 日。基金份额净值 1.0391 元, 基金份额总额 21,596,608.15 份。

5、投资目标: 在严格控制投资组合风险的前提下, 通过积极主动的资产配置, 力争获得超越业绩比较基准的收益。

6、投资策略:

本基金将灵活运用多种投资策略, 在考虑基金流动性及封闭期限的基础上, 充分挖掘和利用市场中潜在的债券及权益类投资机会, 力争为基金份额持有人创造长期稳定的投资回报。

7、业绩比较基准: 沪深 300 指数收益率  $\times$  30%+中债综合指数收益率  $\times$  70%

8、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，属于中等预期收益风险水平的投资品种。

9、基金管理人：中欧基金管理有限公司

10、基金托管人：招商银行股份有限公司

### 三、基金最后运作日财务会计报告（经审计）

#### 1、资产负债表

会计主体：中欧睿选定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年10月17日

单位：人民币元

	最后运作日 2019年9月6日
<b>资 产：</b>	
银行存款	12,935,025.76
结算备付金	13,643.76
存出保证金	7,694.33
交易性金融资产	9,996,000.00
应收利息	94,675.71
<b>资产总计</b>	<b>23,047,039.56</b>
<b>负 债：</b>	
应付赎回款	474,254.09
应付管理人报酬	7,605.66
应付托管费	1,267.62
应付交易费用	12,117.28
其他负债	110,319.98
<b>负债合计</b>	<b>605,564.63</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	21,596,608.15
未分配利润	844,866.78
<b>所有者权益合计</b>	<b>22,441,474.93</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>23,047,039.56</b>

### 四、清盘事项说明

#### 1、清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“在任一开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止：（1）基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元。（2）基金份额持有人人数少于 200 人。”

截至最近一次开放期的最后一日日终（2019 年 9 月 6 日），基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，不需召开基金份额持有人大会，本基金管理人应当依法履行基金财产清算程序并终止基金合同。

基金管理人于 2019 年 9 月 7 日公告的《关于中欧睿选定期开放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》约定：“五、相关业务办理情况：本基金自最后运作日的下一自然日（2019 年 9 月 7 日）起，停止收取基金管理费、基金托管费。自 2019 年 9 月 9 日起，本基金进入清算程序，停止办理申购、赎回等业务，并且之后不再恢复。本基金进入清算程序前，本基金仍按照《基金合同》的约定进行运作。”

## 2、清算起始日

本基金于 2019 年 9 月 9 日起进入清算期，清算期为 2019 年 9 月 9 日至 2019 年 10 月 17 日。

## 3、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。

## 五、清算情况

自 2019 年 9 月 9 日至 2019 年 10 月 17 日清算期间,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:

### 1、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,根据基金合同的规定,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 2、资产清算情况

(1) 本基金最后运作日清算备付金余额为人民币13,643.76元,该款项已于2019年10月9日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币7,694.33元,该款项已于2019年10月9日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币9,996,000.00元,全部为债券投资,应收利息合计为人民币86,311.48元,以上全部交易性金融资产已于清算期间完成处置变现,发生交易费用共计人民币175.00元,清算期债券利息收入为2,950.82元。变现实际收到的证券清算款共计人民币10,086,352.30元,其中包含债券利息人民币89,262.30元,已于2019年9月11日划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收银行存款利息人民币8,246.70元,该款项已于2019年9月21日划入托管账户。应收结算备付金利息人民币88.74元及应收存出保证金利息人民币28.79元,上述款项已于2019年9月23日划入托管账户。应收债券利息86,311.48元,该款项已于2019年9月11日划入托管账户。共计人民币94,675.71元。

### 3、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7,605.66元,该款项已于2019年10月9日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,267.62元,该款项已于2019年10月9日支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币12,117.28元,包括应付国都证券佣金人民币11,107.28元,应付银行债券结算服务费人民币750.00元;应付

上清所回购结算服务费人民币120.00元；应付银行间债券交易手续费人民币125.00元，应付银行间回购交易手续费人民币15.00元。该款项中人民币11,107.28元已于2019年10月16日支付，剩余应付交易费用人民币1,010.00元于2019年10月17日支付。

(4)本基金最后运作日应付赎回款为人民币474,254.09元，该款项已于2019年9月9日支付。

(5)本基金最后运作日其他负债为人民币110,319.98元，包括应付审计费用人民币30,000.00元已于2019年10月17日支付，应付赎回费人民币904.03元已于2019年9月9日支付，应付信息披露费人民币79,415.95元已于2019年10月31日支付。

#### 4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2019 年 9 月 9 日 至 2019 年 10 月 17 日 止清算期间
<b>一、收益</b>	
1、利息收入（注1）	20,317.56
2、交易性金融资产公允价值变动	6,510.00
3、处置交易性金融资产产生的收益	(5,420.00)
4、赎回、转换手续费收入	306.62
<b>收益小计</b>	<b>21,714.18</b>
<b>二、费用</b>	
1、交易费用	175.00
2、银行汇划费	330.00
<b>费用小计</b>	<b>505.00</b>
<b>三、清算期间净收益</b>	<b>21,209.18</b>

注1：利息收入系计提的自本基金最后运作日的下一自然日（2019年9月7日）起至2019年10月17日止期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入及存出保证金利息收入。

#### 5、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
<b>一、最后运作日2019年9月6日基金净资产</b>	<b>22,441,474.93</b>

加：清算期间净损益	21,209.18
减：清算期间确认的净赎回、转出款	490,570.12
<b>二、2019年10月17日基金净资产</b>	<b>21,972,113.99</b>

资产处置及负债清偿后，于2019年10月17日本基金剩余财产为人民币21,972,113.99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。

本基金最后运作日的下一自然日（2019年9月7日）至清算款划出日前一日的存款利息亦属基金份额持有人所有。其中银行存款利息人民币5,417.19元，已于结息日2019年9月21日划入托管账户，清算备付金利息人民币8.54元及存出保证金利息人民币4.90元，已于结息日2019年9月23日划入托管账户，剩余部分利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

#### 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，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

(1) 《中欧睿选定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 9 月 6 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

(2) 上海市通力律师事务所关于《中欧睿选定期开放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

本基金管理人中欧基金管理有限公司办公地点——中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 5 层。

### 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。

中欧睿选定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一九年十一月一日