

关于中海中证高铁产业指数分级证券投资基金不定期份额折算业务期间暂停赎回的公告

根据《中海中证高铁产业指数分级证券投资基金合同》的有关规定,中海中证高铁产业指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)已于2018年10月19日办理不定期份额折算业务,中海中证高铁产业分级A类份额(场内简称:高铁A;场内代码502031)、中海中证高铁产业分级B类份额(场内简称:高铁B;场内代码502032)已于2018年10月22日暂停交易,并将于2018年10月23日开市恢复交易。

2018年10月23日中海中证高铁产业分级A类份额、中海中证高铁产业分级B类份额当日行情显示的收盘价均为中海中证高铁产业分级A类份额、中海中证高铁产业分级B类份额的基金份额参考净值(四舍五入至0.001元),2018年10月23日中海中证高铁产业分级A类份额、中海中证高铁产业分级B类份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。

上述安排如有调整,基金管理人将另行发布公告,具体详见基金管理人届时发布的相关公告。风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书等文件,敬请投资者注意投资风险。

特此公告。
中海基金管理有限公司
2018年10月20日

中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人:中海基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
清算报告出具日:2018年08月21日
清算报告公告日:2018年10月20日

中海合鑫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”)2015年1月4日证监许可[2015]6号文准予募集注册,由本基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2015年1月20日至2015年2月6日期间向社会公开发售,本基金合同于2015年2月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为684,119,263.96份,含募集期间利息结转的份额)。本基金自成立(2015年6月4日)至2018年6月4日期间,按基金合同约定正常运作。

根据基金合同的有关规定,当基金合同生效后,本基金连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元时,基金合同自动终止,而无须经基金份额持有人大会审议。为降低由于现有及潜在基金份额持有人影响,本基金于2018年6月7日起将基金份额(含转换转入及定期定额投资)业务,但正常开放赎回业务。截至2018年17月17日,在基金合同生效后三年后,本基金基金资产净值已连续60个工作日低于人民币5000万元,触发上述基金合同终止情形,基金管理人即就该项于2018年5月11日和2018年6月18日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站分别刊登了《中海基金管理有限公司关于中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金合同终止情形的提示性公告》和《中海基金管理有限公司关于中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金合同终止及基金财产清算的公告》。

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)和上海通力律师事务所于2018年6月5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,上海市通力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	中海合鑫灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中海合鑫混合
基金代码	001005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月1日
基金管理人名称	中海基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

三、基金运作情况
本基金经中国证监会2015年1月4日证监许可[2015]6号文准予募集注册,由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2015年1月20日至2015年2月6日期间向社会公开发售,本基金合同于2015年2月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为684,119,263.96份,含募集期间利息结转的份额)。本基金自成立(2015年6月4日)至2018年6月4日期间,按基金合同约定正常运作。

根据基金合同的有关规定,当基金合同生效后,本基金连续60个工作日基金资产净值低于人民币5000万元时,基金合同自动终止,而无须经基金份额持有人大会审议。为降低由于现有及潜在基金份额持有人影响,本基金于2018年6月7日起将基金份额(含转换转入及定期定额投资)业务,但正常开放赎回业务。截至2018年17月17日,在基金合同生效后三年后,本基金基金资产净值已连续60个工作日低于人民币5000万元,触发上述基金合同终止情形,基金自2018年6月5日起进入基金财产清算程序,由于本基金持有的流通受限股票无法确定变现时间,本基金将于两次清算,其中第一次清算期间为2018年6月5日至2018年6月10日,第二次清算期间将根据流通受限股票的变现时间确定。

四、财务会计报告

(一) 2018年06月04日(基金最后运作日)资产负债表(经审计)

除特别注明外,金额单位为人民币元	
资产:	最后运作日 2018年6月4日
银行存款	10,223,651.87
结算备付金	185,780.13
存出保证金	44,189.65
交易性金融资产	401,280.00
其中:股票投资	401,280.00
应收利息	14,618.32
资产总计	10,869,520.02
负债:	
应付赎回款	2,155,109.55
应付赎回费	469.49
应付管理人报酬	39,378.40
应付托管费	6,663.04
应付交易费用	76,421.88
其他负债	5,000.00
负债合计	2,283,633.36
所有者权益:	
实收基金	14,439,469.69
未分配利润	(6,583,583.03)
所有者权益合计	8,585,886.66
所有者权益总计	10,869,520.02

自2018年6月5日至2018年8月10日止清算期间,基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行第一次清算,全面清算工作按照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,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。
为保护基金份额持有人利益,本基金清算期间的审计费、律师费用由基金管理人承担,银行汇划费用等从基金财产中列支。

2.资产处置情况
(1) 本基金最后运作日存出保证金为人民币44,189.65元,截至2018年8月10日存出保证金余额为人民币30,463.40元,该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。
(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币185,780.13元,已于2018年7月3日划入托管账户。
(3) 本基金最后运作日应收银行存存款利息人民币13,328.81元,应收结算备付金利息人民币1,113.94元,应收存出保证金利息人民币176.57元,共计人民币14,618.32元,以上款项已于2018年6月21日划入托管账户。
(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币401,280.00元,系因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票,其明细如下:

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	最后运作日估值	数量(单位:股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
603501	韦尔股份	2018/5/15	重大资产重组	35.20	11,400	405,280.36	401,280.00

待停牌股票复牌后,基金管理人将及时变现停牌股票,并于第二次清算时再向基金份额持有人分配。于2018年8月10日,本基金持有停牌股票尚未复牌。

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39,397.40元,该款项已分别于2018年6月6日和2018年6月6日支付。
(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币6,663.04元,该款项已分别于2018年6月5日和2018年6月6日支付。
(3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币2,155,109.55元,该款项已于2018年6月6日支付。
(4) 本基金最后运作日应付赎回费为人民币469.49元,该款项已于2018年6月5日支付。
(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币5,000.00元,为应付中国证券登记结算费,该款项已于2018年7月10日支付。
(6) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币76,421.88元,为应付兴业证券席位佣金,该款项已于2018年7月4日支付。

4.清算期间的清算损益情况

项目	自2018年6月5日至2018年8月10日止清算期间
一、收益	
1.利息收入(注1)	8,021.50
2.股利投资收益(注2)	513.00
3.公允价值变动损益(注3)	(40,812.00)
收益小计	(32,277.50)

注1:利息收入系计提的自2018年6月5日至2018年8月10日止清算期间的银行存款利息,存出保证金利息、结算备付金利息收入。其中,银行存款利息人民币1,842.84元,结算备付金利息人民币133.79元及存出保证金利息人民币320.64元已于2018年6月21日收回并划入本基金托管账户。注2:股利投资收益系流通受限股票韦尔股份于2018年8月16日在《上海证券报》等媒体刊登《2017年度权益分派实施公告》,对股东分配2017年度现金股利,每股发放现金红利人民币0.045元(含税),本基金共持有韦尔股份11,400股,应收合计人民币513.00元。

注3:本基金于2018年6月4日起将流通受限股票韦尔股份估值方法变更为指数收益法进行估值。公允价值变动损益系韦尔股份在第一次清算期间指数收益法估值导致(金额可能与实际价值存在差异)。
注4:本基金清算期间的审计费、律师费等由基金管理人承担。本基金清算期间清算费用为人民币737.83元,系银行汇划费用,已于2018年6月7日、2018年7月6日和2018年8月7日支付。

单位:人民币元	
资产:	期末余额
银行存款	1,777,869.94
结算备付金	
存出保证金	34,564.8
交易性金融资产	
其中:股票投资	
债券投资	
资产支持证券投资	
基金投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	3,545.46
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	1,815,980.20

单位:人民币元	
负债:	期末余额
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	
应付赎回款	29,996.38
应付管理人报酬	824.45
应付托管费	164.88
衍生金融负债	
买入返售金融负债	
应付交易费用	1,721.77
应付利息	
应付股利	
其他负债	161,497.34
负债合计	194,234.67
所有者权益:	
实收基金	1,322,887.2
未分配利润	298,858.33
所有者权益合计	1,621,745.53
所有者权益总计	1,815,980.20

注:本基金最后运作日2018年6月22日,大成景福灵活配置混合A类单位净值为1.2267,份额为1,240,498.04份,资产净值为1,620,860.16元;大成景福灵活配置混合C类单位净值为1.224元,份额为82,389.16份,资产净值为100,885.37元。

注:本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币28,245元,该款项已于2018年9月4日支付。
注:本基金最后运作日应付托管费为人民币164.88元,该款项已于2018年9月4日支付。
注:本基金最后运作日应付赎回费为人民币3085.5元,该款项已于2018年9月4日支付。
(4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币29,996.38元,该款项已于2018年8月23日支付。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。
注:本基金最后运作日应付利息为人民币164,885.37元,已于2018年8月23日确认。

大成景福灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
清算报告出具日:2018年9月5日
清算报告公告日:2018年10月20日

大成景福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]688号《关于核准大成景福灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由大成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《大成景福灵活配置混合型证券投资基金合同》依法公开募集。于2015年9月4日成立并正式运作,本基金的基金管理人是大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据《基金合同》第十九条“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中第二条“《基金合同》的终止事由”约定:“基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元,基金合同自动终止(不需召开基金份额持有人大会审议)”。截至2018年8月22日,本基金已出现基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情形,已触发基金合同终止条款。本基金将根据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止,无须召开基金份额持有人大会审议。本基金管理人于2018年9月23日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.dcfund.com.cn)发布了《大成基金管理有限公司关于大成景福灵活配置混合型证券投资基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自2018年8月23日起进入清算期,由基金管理人大成基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和中国北京市金杜律师事务所于2018年8月27日成立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,北京市金杜律师事务所对清算报告出具法律意见。

一、重要提示
大成景福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]688号《关于核准大成景福灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由大成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《大成景福灵活配置混合型证券投资基金合同》依法公开募集。于2015年9月4日成立并正式运作,本基金的基金管理人是大成基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

根据《基金合同》第十九条“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中第二条“《基金合同》的终止事由”约定:“基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元,基金合同自动终止(不需召开基金份额持有人大会审议)”。截至2018年8月22日,本基金已出现基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情形,已触发基金合同终止条款。本基金将根据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止,无须召开基金份额持有人大会审议。本基金管理人于2018年9月23日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站(www.dcfund.com.cn)发布了《大成基金管理有限公司关于大成景福灵活配置混合型证券投资基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自2018年8月23日起进入清算期,由基金管理人大成基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和中国北京市金杜律师事务所于2018年8月27日成立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,北京市金杜律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况
1.基金基本情况
基金名称:大成景福灵活配置混合型证券投资基金
基金简称:大成景福灵活配置混合
基金代码:001263
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2015年9月4日
基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金份额总额:1,322,887.20份
基金份额总额:1,322,887.20份

基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份

基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份

基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,887.20份
基金最后运作日(2018年8月22日)基金份额总额:1,322,88