

中欧睿诚定期开放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：2020年12月30日

报告公告日期：2021年1月15日

一、重要提示

中欧睿诚定期开放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[2016]1552号文《关于准予中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金注册的批复》注册，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《中欧睿诚定期开放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1,201,553,328.48元。经向中国证监会备案，《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,202,296,399.58份，包含认购资金利息结转的份额743,071.10份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金合同》“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净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。法律法规另有规定时，从其规定。”

截至本次开放期的最后一日日终（2020年12月14日），基金资产净值加上当日净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《中欧睿诚定期开

放混合型证券投资基金基金合同》中约定的基金合同终止条款。根据《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金合同》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为 2020 年 12 月 14 日，基金管理人自 2020 年 12 月 15 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 2020 年 12 月 16 日《中国证券报》及基金管理人网站上的《中欧基金管理有限公司关于中欧睿诚定期开放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 2020 年 12 月 15 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、普华永道中天会计师事务所（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，并由普华永道中天会计师事务所（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：中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金。基金简称：中欧睿诚定期开放混合 A，中欧睿诚定期开放混合 C。基金代码：003150、003151。

2、基金运作方式：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。

本基金每 3 个月开放一次，每次开放期原则上不少于 3 个工作日且最长不超过 10 个工作日。每个开放期的首日为基金合同生效日的每 3 个月月度对日，若该日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。

本基金的首个封闭期为自基金合同生效日起至第一个开放期的首日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

3、基金合同生效日：2016 年 12 月 1 日

4、基金运作终止日：2020 年 12 月 14 日。基金份额总额 42,406,093.64 份。其中 A 类基金份额净值 1.1171 元，基金份额总额 36,639,856.97 份；C 类基金份额净值 1.0996 元，基金份额总额 5,766,236.67 份。

5、投资目标：本基金在力求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的收益。

6、业绩比较基准：中债综合指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%

7、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。

8、基金管理人：中欧基金管理有限公司

9、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：中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 14 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2020 年 12 月 14 日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	47,638,477.22
结算备付金	529,523.81
存出保证金	10,853.18
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	-
应收利息	11,953.99
资产总计	48,190,808.20
负债和所有者权益	
负 债：	
应付证券清算款	-
应付赎回款	723,466.82
应付管理人报酬	31,220.79
应付托管费	3,122.06
应付销售服务费	1,052.04
应付交易费用	280.80
应交税费	-
其他负债	162,392.68

负债合计	921,535.19
所有者权益：	
实收基金	42,406,093.64
未分配利润	4,863,179.37
所有者权益合计	47,269,273.01
负债和所有者权益总计	48,190,808.20

四、清盘事项说明

1、清算原因

《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金基金合同》“第五部分 基金备案”中约定“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净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。法律法规另有规定时，从其规定。”

截至开放期的最后一日日终（2020 年 12 月 14 日），基金资产净值加上当日净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 2020 年 12 月 16 日公告的《中欧基金管理有限公司关于中欧睿诚定期开放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 自 2020 年 12 月 15 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后，停止收取基金管理费、基金托管费。”

2、清算起始日

本基金于 2020 年 12 月 15 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2020 年 12 月 15 日。

3、清算报表编制基础

本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。本基金已将账面价值高于预计可

收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。

五、清算情况

自2020年12月15日至2020年12月30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) 本基金最后运作日应收利息为人民币11,953.99元，其中应收活期存款利息9,320.25元，应收结算备付金利息2,571.95元，其他利息61.79元已于2020年12月21日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币529,523.81元，将于2021年1月5日划入托管账户。存出保证金为人民币10,853.18元，存出保证金将于2021年1月5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0.00元，应收债券利息为人民币0.00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31,220.79元，该款项将于2021年1月5日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币3,122.06元，该款项将于2021年1月5日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币1,052.04元，该款项将于2021年1月5日支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币723,466.82元，该款项已于2020年12月15日支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币0元。

(6) 本基金最后运作日应付交易费用280.80元。其中应付券商佣金55.80

元，该款项将于2021年1月12日支付。应付银行间交易费用225.00元，该款项已于2020年12月28日支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债为人民币162,392.68元，包括应付审计费用人民币47,676.89元、应付信息披露费人民币114,426.63元，应付划款手续费289.16元。其中2020年审计费和信披费已于2020年12月17日支付，划款手续费将于2021年1月8日支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2020 年 12 月 15 日 至 2020 年 12 月 30 日 止清算期间
一、清算收益	
利息收入	6,204.61
处置交易性金融资产产生的收益	-
公允价值变动损益	-
赎回手续费收入	447.49
清算收入小计	6,652.10
二、清算费用	
清算费用小计	-
三、清算净收益	6,652.10

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
一、最后运作日 2020 年 12 月 14 日基金净资产	47,269,273.01
加：自 2020 年 12 月 15 日至 2020 年 12 月 30 日止清算期间净收益	6,652.10
减：清算期间确认的净赎回、转出款	10,021,850.37
二、2020 年 12 月 30 日基金净资产	37,254,074.74

资产处置及负债清偿后，于 2020 年 12 月 30 日本基金剩余财产为人民币 37,254,074.74 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。

清算起始日 2020 年 12 月 15 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，该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) 《中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 14 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《中欧睿诚定期开放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。

中欧睿诚定期开放混合型证券投资基金财产清算小组

二〇二一年一月十五日