

方正富邦优选灵活配置混合型证券投资 基金二次清算报告

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告出具日期：二〇一九年二月二十一日

报告公告日期：二〇一九年四月二日

一、重要提示

1、重要提示

方正富邦优选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] 1053号《关于核准方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》批准,由基金管理人方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《方正富邦优选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”)发起,于2015年6月25日募集成立。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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》和基金合同等有关规定,基金合同生效后,连续60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人民币5000万元的,基金合同终止并按照基金合同的约定进入清算程序,无须召开基金份额持有人大会。截至2018年9月7日,本基金资产净值合计为人民币924万元,基金资产净值连续60个工作日低于人民币5,000万元,触发基金合同终止情形,基金合同自动终止。

本基金管理人已于2018年9月10日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》和基金管理人网站(www.founderff.com)上刊登了《方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦优选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》。

本基金自2018年9月8日起进入财产清算期,由本基金管理人方正富邦基金管理有限公司、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海通力律师事务所指定人员组成的基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

第一次清算的清算期间为2018年9月8日(清算开始日)至2018年10月10日(清算结束日)止。本基金管理人向中国证监会报送基金清算报告等备案文件,并于2018年12月18日取得中国证监会《关于方正富邦优选灵活配置混合型证

券投资基金清算备案的回函》。

2018年12月21日本基金管理人发布了《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金清算报告》，并于2018年12月25日将第一次清算款从本基金托管账户划至登记机构清算账户，登记机构于当日从登记机构清算账户将清算款划至各销售机构。

截至2019年2月12日，本基金已将持有的停牌股票全部变现。本基金于2018年10月11日起进入第二次清算期，第二次清算的清算期间为2018年10月11日（二次清算开始日）至2019年2月21日（二次清算结束日）。

二、基金产品概况

1、基金基本情况

基金名称	方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	方正富邦优选灵活配置混合
基金代码	A类：001431；C类：002297
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月25日
基金管理人名称	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人名称	中国邮政储蓄银行股份有限公司
公告依据	《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等

2、基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求稳健的绝对回报。
投资策略	在类别资产的配置上，本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平，进而对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整。 (1) 宏观经济因素。主要分析对证券市场的基本面产生普遍影响的宏观经济指标。包括：GDP增长率、工业增加值、CPI、PPI水平及其变化趋势、市场利率水平及其变化趋势、M1、M2值及其增加量等；

	<p>(2) 市场估值因素。包含纵向比较股票市场的整体估值水平、横向比较股票、债券之间的相对收益水平、上市公司盈利水平及其盈利预期、市场资金供求关系变化等；</p> <p>(3) 政策因素，研究与证券市场紧密相关的各种宏观调控政策，包括产业发展政策、区域发展政策、货币政策、财政政策、房地产调控政策等；</p> <p>(4) 市场情绪因素，包含新开户数、股票换手率、市场成交量、开放式基金股票持仓比例变化等。综合上述因素的分析结果，本基金给出股票、债券和货币市场工具等资产的最佳配置比例并实时进行调整。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中债总指数收益率×30%
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，属于中等风险水平的投资品种。

3、基金运作情况说明

方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金(“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] 1053 号《关于核准方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》批准，由基金管理人方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起，于 2015 年 6 月 25 日募集成立。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金募集期为 2015 年 6 月 15 日至 2015 年 6 月 19 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。截至 2015 年 6 月 24 日止，募集资金总额为人民币 213,198,862.49 元，有效认购户数为 830 户。其中，扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 213,188,652.56 元，认购资金在募集期间产生的利息为人民币 10,209.93 元。本基金募集资金经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证，于 2015 年 6 月 24 日出具普华永道中天验字(2015)第 800 号验资报告。自 2015 年 6 月 24 日至 2018 年 9 月 7 日期间，本基金按基金合同正常运作。

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》和基金合同等有关规定，基金合同生效后，连续 60 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人民币 5000 万元的，基金合同终止并按照基金合同的约定进入清算程序，无须召开基金份额持有人大会。截至 2018 年 9 月 7 日，本基金资产净值合计为人民币 924 万元，基金资产净值连续 60 个工作日低于人民币 5,000 万元，触发基金合同终止情形，基金合同自动终

止。本基金管理人已于 2018 年 9 月 10 日公布《方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦优选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》（“公告”）。根据公告，本基金从 2018 年 9 月 8 日（清算开始日）起进入清算期，基金管理人按照基金合同约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。第一次清算的清算期间为 2018 年 9 月 8 日（清算开始日）至 2018 年 10 月 10 日（清算结束日）止。本基金管理人向中国证监会报送基金清算报告等备案文件，并于 2018 年 12 月 18 日取得中国证监会《关于方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金清算备案的回函》。2018 年 12 月 21 日本基金管理人发布了《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金清算报告》，并于 2018 年 12 月 25 日将第一次清算款从本基金托管账户划至登记机构清算账户，登记机构于当日从登记机构清算账户将清算款划至各销售机构。

截至 2019 年 2 月 12 日，本基金已将持有的停牌股票全部变现。本基金于 2018 年 10 月 11 日起进入第二次清算期，第二次清算的清算期间为 2018 年 10 月 11 日（二次清算开始日）至 2019 年 2 月 21 日（二次清算结束日）。

4、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

1、清算资产负债表（已审计）

单位：人民币元

项目	2018年10月10日 (一次清算结束日)	2019年2月21日 (二次清算结束日)
资产：		
银行存款	6,740,208.75	2,370,127.64
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,815,064.62	-
应收利息	2,761.41	1,158.62
应收申购款	-	-
资产总计	9,558,034.78	2,371,286.26
负债：		
应付赎回款	-	-
应付赎回费	-	-
应付管理费	-	-
应付托管费	-	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
其他负债	162,469.69	81,600.00
负债合计	162,469.69	81,600.00
所有者权益：		
实收基金	11,351,664.45	3,094,857.77
未分配利润	(1,956,099.36)	(805,171.51)
所有者权益合计	9,395,565.09	2,289,686.26
负债和所有者权益总计	9,558,034.78	2,371,286.26

2、清算损益表（已审计）

单位：人民币元

项目	2018年10月11日至 2019年2月21日(本次清算期间)
收益	(436,399.78)
1、利息收入	10,728.76
2、投资收益	(883,875.65)
3、公允价值变动损益	436,747.11
2、其他收入	-
费用	91,739.99
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、交易费用	4,309.68
4、清算费用	-
5、其他费用	87,430.31
收益(损失)总额	(528,139.77)
减：所得税费用	
净收益(损失)	(528,139.77)

注：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2018年10月11日至2019年2月21日止清算期间的银行存款利息。

四、清算情况

1、资产负债清算情况

2018年10月11日(二次清算起始日)至2019年2月21日(二次清算结束日)止为本次清算期间，基金财产清算小组对本基金的基金财产进行清算，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：

截至本次清算期结束日（2019年2月21日），各项资产负债清算情况如下：

（1）本基金一次清算结束日（2018年10月10日）股票投资为人民币2,815,064.62元，全部为流通受限股票资产，明细如下：

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	数量（单位：股）	最后运作日估值金额	变现日期	实际清算金额
603156	养元饮品	2018-2-2	2019-2-11	老股转让流通受限	52,804	2,484,956.24	2019-2-12	2,109,353.90
300713	英可瑞	2017-10-23	2018-1-1	老股转让流通受限	12,614	330,108.38	2019-2-12	256,004.16

截至本基金本次清算结束日（2019年2月21日）已完成全部股票变现。

(2) 本基金本次清算结束日应收利息为人民币 1,158.62 元。

(3) 本基金于 2019 年 02 月 13 日支付交易费用人民币 4,309.68 元。

(4) 本基金于 2018 年 12 月 18 日支付清算审计费人民币 15,000.00 元, 2018 年 12 月 25 日支付律师费人民币 20,000.00 元。

(5) 本基金本次清算结束日其他负债为人民币 81,600.00 元, 其中应付信息披露费为人民币 66,600.00 元, 该款项将于收到信息披露费发票后支付; 其中审计费用人民币 15,000.00 元, 该款项将于收到审计费发票后支付。

2、截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排

项目	金额/份额
一、2018 年 10 月 10 日（一次清算结束日）基金净资产（单位：元）	9,395,565.09
加：清算期间净收益	(528,139.77)
减：基金净赎回金额	6,577,739.06
二、2019 年 2 月 21 日基金净值产（单位：元）	2,289,686.26
其中：归属于 A 类基金份额的基金净值产	2,272,101.49
其中：归属于 C 类基金份额的基金净值产	17,584.77
三、2019 年 2 月 21 日基金总份额（单位：份）	3,094,857.77
其中：A 类基金份额数量	3,075,642.67
其中：C 类基金份额数量	19,215.10

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占该类基金份额总份额的比例进行分配。

截至本次清算期结束日 2019 年 02 月 21 日, 本基金剩余财产为人民币 2,289,686.26 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清算费用、缴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。

2019 年 02 月 21 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益, 加快清盘速度, 基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项 (该金额可能与实际结息金额存在略微差异, 差额由管理人承担), 供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

3、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。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金清算报告》

《关于方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金清算备案的回函》（机构部函〔2018〕2979号）

《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告》

《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见书

2、存放地点

基金管理人、基金托管人处

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方正富邦基金管理有限公司。

客服电话：400-818-0990

方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一九年四月二日