**国联安鑫瑞混合型证券投资基金**

**清算报告**

**基金管理人：国联安基金管理有限公司**

**基金托管人：中国建设银行股份有限公司**

**报告送出日：二零一八年三月九日**

# **§1 重要提示**

国联安鑫瑞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”）《关于核准国联安鑫瑞混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2016]1817号文）批准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年9月9日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为808,730,517.32份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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》、《国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金合同》（以下简称 “《基金合同》”）的有关规定提议终止《基金合同》。本基金基金份额持有人大会已于2017年10月24日表决通过了《关于终止国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金基金合同有关事项的议案》，决定终止《基金合同》。

根据上述法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金财产清算小组于2017年10月25日成立。本基金基金财产清算小组由基金管理人国联安基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成。其中，基金管理人的授权代表为仲晓峰、林文卿；基金托管人的授权代表为孙颖、余胜潮； 毕马威华振会计师事务所会计师为王国蓓、张楠；上海市通力律师事务所律师为安冬、陆奇。

**§2 基金产品概况**

|  |  |
| --- | --- |
| 基金简称 | 国联安鑫瑞混合 |
| 基金主代码 | 003271 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年9月9日 |
| 报告期末(2017年10月24日)基金份额总额 | 494,508.57份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资风险和保持基金资产良好流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型证券投资基金，属于中等预期风险、中等预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

**§3基金运作情况概述**

国联安鑫瑞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”）《关于核准国联安鑫瑞混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2016]1817号文）批准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年9月9日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为808,730,517.32份基金份额。2016年9月9日至2017年10月24日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，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》、《国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金合同》（以下简称 “《基金合同》”）的有关规定提议终止《基金合同》。本基金基金份额持有人大会已于2017年10月24日表决通过了《关于终止国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金基金合同有关事项的议案》，决定终止《基金合同》。本基金自2017年10月25日起进入清算程序。

**§4财务报表**

**4.1 资产负债表**

会计主体：国联安鑫瑞混合型证券投资基金

报告截止日：2017年10月24日（基金最后运作日）

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 资产 | 最后运作日  2017年10月24日 |
| **资产 :** |  |
| 银行存款 | 287,707.88 |
| 结算备付金 |  |
| 存出保证金 | 494.06 |
| 交易性金融资产 | 429,742.00 |
| 其中：股票投资 |  |
| 债券投资 | 429,742.00 |
| 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 | 7,281.55 |
| 应收股利 |  |
| 应收申购款 |  |
| 其他资产 |  |
| 资产合计: | 725,225.49 |
| 负债和所有者权益 | 最后运作日  2017年10月24日 |
| **负债:** |  |
| 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 | 9.53 |
| 应付管理人报酬 | 895.38 |
| 应付托管费 | 149.25 |
| 应付销售服务费 | 3.00 |
| 应付交易费用 |  |
| 应付税费 |  |
| 应付利息 |  |
| 应付利润 |  |
| 其他负债 | 250,000.00 |
| 负债合计 | 251,057.16 |
| **所有者权益：** |  |
| 实收基金 | 494,508.57 |
| 未分配利润 | -20,340.24 |
| 所有者权益合计 | 474,168.33 |

**4.2利润表**

会计主体：国联安鑫瑞混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年10月24日（基金最后运作日）

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2017年1月1日至2017年10月24日（基金最后运作日） |
| **一、收入** | 11,901,183.61 |
| 1、利息收入 | 9,463,671.11 |
| 其中：存款利息收入 | 134,442.64 |
| 债券利息收入 | 9,253,520.71 |
| 资产支持证券利息收入 |  |
| 买入返售金融资产收入 | 75,707.76 |
| 2、投资收益（损失以"-"填列） | -3,787,084.10 |
| 其中：股票投资收益 | 4,978,787.27 |
| 债券投资收益 | -8,766,164.86 |
| 资产支持证券投资收益 |  |
| 基金投资收益 |  |
| 权证投资收益 |  |
| 衍生工具收益 |  |
| 股利收益 | 293.49 |
| 3、公允价值变动损益（损失以"-"填列） | 6,223,722.67 |
| 4、其他收入（损失以"-"填列） | 873.93 |
| **减：二、费用** | 2,775,652.59 |
| 1、管理人报酬 | 1,986,821.71 |
| 2、托管费 | 331,136.95 |
| 3、销售服务费 | 57.44 |
| 4、交易费用 | 111,723.52 |
| 5、利息支出 | 11,273.29 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 11,273.29 |
| 6、其他费用 | 334,639.68 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | 9,125,531.02 |
| 减：所得税费用 | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | 9,125,531.02 |

注：本报告期的基金财务会计报告经毕马威华振会计师事务所审计，注册会计师王国蓓、张楠签字出具了毕马威华振审字第1702883号标准无保留意见的审计报告。

**§5基金财产分配**

根据本基金基金合同的约定，本基金于2017年10月25日进入清算期。

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。

自2017年10月25日至2017年11月28日止的清算期间，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：

**5.1资产处置情况**

5.1.1.本基金最后运作日银行存款余额为人民币287,707.88元，清算期间银行存款净流入人民币187,511.62元，于清算结束日银行存款余额为人民币475,219.50元。

5.1.2本基金最后运作日存出保证金为人民币494.06元，于清算结束日存出保证金余额为人民币697.89元，该款项由基金管理人国联安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于2017年11月28日划入托管账户。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。

5.1.3本基金最后运作日应收利息余额为人民币7,281.55元，于清算结束日应收利息余额为人民币870.09元，该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于2017年11月28日划入托管账户。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。

5.1.4.本基金最后运作日交易性金融资产为429,742.00元， 其中股票投资为0元,债券投资为429,742.00元,系基金合同对债券投资的持有比例要求而持有的债券明细如下:

5.1.4.1于2017年10月24日（基金最后运作日）本基金持有的债券投资列示如下：

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（％） |
| 019563 | 17国债09 | 4,300 | 429,742.00 | 90.63 |

截至清算结束日，债券投资资产余额为零。

**5.2负债清偿情况**

5.2.1本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币9.53元，均于清算期间支付，于清算结束日应付赎回款余额为零。

5.2.2本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币895.38元，均于清算期间支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为零。

5.2.3本基金最后运作日应付托管费为人民币149.25元，均于清算期间支付，于清算结束日应付托管费余额为零。

5.2.4本基金最后运作日应付销售服务费为人民币3.00元，均于清算期间支付，于清算结束日应付销售服务费余额为零。

5.2.5本基金最后运作日其他负债为人民币250,000.00元，均于清算期间支付，于清算结束日其他负债余额为零。

**5.3清算期间的清算损益情况**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 2017年10月25日(基金清算起始日)至2017年11月28日(基金清算结束日)止期间 |
| 一、资产处置损益 | 382.42 |
| 1.利息收入 | 511.42 |
| 其中：存款利息收入 | 394.09 |
|
| 债券利息收入 | 117.33 |
|
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -200.67 |
|
| 其中：债券投资收益 | -200.67 |
|
|
| 3.公允价值变动收益（损失以“允价号填列） | 71.67 |
|
| 二、清算费用 | 203.99 |
| 1．交易费用 | 0.44 |
|
| 2．利息支出 | 0 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 0 |
| 3．其他费用 | 203.55 |
|
| 三、清算净损益（净亏损以“-”号填列） | 178.43 |

**5.4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2017年10月24日基金净资产 | 474,168.33 |
| 加：清算期间净收益 | 178.43 |
| 减：因2017年10月24日交易份额产生的净值变动 | 9.53 |
| 二、2017年11月28日基金净资产 | 474,337.23 |

资产处置及负债清偿后，本基金截至2017年11月28日（清算结束日）止的剩余财产为人民币474,337,23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。

清算结束日2017年11月28日至清算款划出日前一日(预估为2018年2月28日)的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。截至2017年11月27日止的存出保证金余额为人民币697.89元，应收利息共计人民币870.09元，由基金管理人以自有资金垫付并已于2017年11月28日划入托管账户。自2017年11月28日起至2018年2月28日止期间的应收利息，以当前适用的年利率(0.72%)预估为人民币882.27元，由基金管理人以自有资金垫付并已于2017年11月28日划入托管账户。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。

截至2017年11月28日止，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计人民币475,219.50元，其中人民币1,567.98元系基金管理人代垫的截至2017年11月27日的上交所保证金及应收利息，人民币882.27元系基金管理人代垫的2017年11月28日起至2018年2月28日止期间以当前适用的年利率（0.72%）预估的银行存款利息收入。

**5.5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。

**§6备查文件**

**6.1备查文件目录**

　　 1、国联安鑫瑞混合型证券投资基金自2017年1月1日至2017年10月24日(基金最后运作日)止期间财务报表及审计报告

　　 2、《国联安鑫瑞混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

**6.2存放地点**

　　 基金管理人的办公场所。

**6.3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。

国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金财产清算小组

　　 2017年 11月28 日