**国联安鑫富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：上海浦东发展银行股份有限公司**

**报告送出日：二零一八年六月二十一日**

# **§1 重要提示**

国联安鑫富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”）《关于核准国联安鑫富混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2015]585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《国联安鑫富混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年5月13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1,970,939,715.03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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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》、《国联安鑫富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2018年3月15日表决通过了《关于终止国联安鑫富混合型证券投资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2018年3月16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、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、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金虹、朱萍；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 | 国联安鑫富混合 |
| 基金主代码 | 001221 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年5月13日 |
| 报告期末(2018年3月15日)基金份额总额 | 5,175,629.22份 |
| 投资目标 | 通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司来获得长期稳定的收益。 |
| 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×25%+上证国债指数×75% |
| 风险收益特征 | 本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |

**§3基金运作情况概述**

国联安鑫富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”）《关于核准国联安鑫富混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2015]585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《国联安鑫富混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年5月13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1,970,939,715.03份基金份额。2015年5月13日至2018年3月15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》、《国联安鑫富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2018年3月15日表决通过了《关于终止国联安鑫富混合型证券投资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2018年3月16日起进入清算程序。

**§4财务报表**

**4.1 资产负债表**

会计主体：国联安鑫富混合型证券投资基金

报告截止日：2018年3月15日（基金最后运作日）

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **资 产 :** |  | **负债:** |  |
| 银行存款 | 6,961,896.50 | 短期借款 |  |
| 结算备付金 |  | 交易性金融负债 |  |
| 存出保证金 | 376.54 | 衍生金融负债 |  |
| 交易性金融资产 |  | 卖出回购金融资产款 |  |
| 其中：股票投资 |  | 应付证券清算款 |  |
| 债券投资 |  | 应付赎回款 | 228,258.39 |
| 资产支持证券投资 |  | 应付管理人报酬 | 2,715.98 |
| 基金投资 |  | 应付托管费 | 603.54 |
| 衍生金融资产 |  | 应付销售服务费 | 545.91 |
| 买入返售金融资产 |  | 应付交易费用 | 317.13 |
| 应收证券清算款 |  | 应付税费 |  |
| 应收利息 | 16,254.09 | 应付利息 |  |
| 应收股利 |  | 应付利润 |  |
| 应收申购款 |  | 其他负债 | 109,300.22 |
| 其他资产 |  | **负债合计** | 341,741.17 |
|  |  | **所有者权益：** |  |
|  |  | 实收基金 | 5,175,629.22 |
|  |  | 未分配利润 | 1,461,156.74 |
|  |  | **所有者权益合计** | 6,636,785.96 |
|  |  |  |  |
| **资产合计:** | 6,978,527.13 | **负债与持有人权益总计：** | 6,978,527.13 |

**4.2利润表**

会计主体：国联安鑫富混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年3月15日（基金最后运作日）

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期  2018年1月1日至2018年3月15日（基金最后运作日） |
| 一、收入 | 27,315.68 |
| 1、利息收入 | 13,504.34 |
| 其中：存款利息收入 | 13,504.34 |
| 债券利息收入 |  |
| 资产支持证券利息收入 |  |
| 买入返售金融资产收入 |  |
| 2、投资收益（损失以"-"填列） | 260,181.39 |
| 其中：股票投资收益 | 260,181.39 |
| 债券投资收益 |  |
| 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 |  |
| 3、公允价值变动损益（损失以"-"填列） | -265,986.06 |
| 4.其他收入（损失以“-”号填列） | 19,616.01 |
| **减：二、费用** | 63,845.04 |
| 1、管理人报酬 | 6,819.60 |
| 2、托管费 | 1,515.47 |
| 3、销售服务费 | 785.60 |
| 4、交易费用 | 687.92 |
| 5、利息支出 |  |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  |
| 6、其他费用 | 54,036.45 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | -36,529.36 |
| 减：所得税费用 | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | -36,529.36 |

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1802902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2018年3月16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2018年3月16日至2018年4月26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6,961,896.50元，清算期间银行存款净流出人民币285,120.51元，于清算结束日银行存款余额为人民币6,676,775.99元。

5.1.2本基金最后运作日存出保证金余额为人民币376.54元，该款项于2018年4月3日调回至托管账户，于清算结束日存出保证金余额为零。

5.1.3本基金最后运作日应收利息余额为人民币16,254.09元，清算期间计提应收银行存款利息人民币12,419.60元、应收交易保证金利息人民币0.36元，于清算结束日应收利息余额为人民币10,883.10元，该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于2018年4月26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。

**5.2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228,258.39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2,715.98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603.54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545.91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本基金最后运作日应付交易费用为人民币317.13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。

5.2.6本基金最后运作日其他负债为人民币109,300.22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 | 2018年3月16日(基金开始清算日)至2018年4月26日(基金结束清算日)止期间 |
| 一、资产处置损益 | 12,468.68 |
| 1.利息收入 | 12,419.96 |
| 其中：存款利息收入 | 12,419.96 |
| 债券利息收入 |  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |  |
| 其中：债券投资收益 |  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |  |
| 4.其他收入（损失以“-”号填列） | 48.72 |
| 二、清算费用 | -215.00 |
| 1．交易费用 |  |
| 2．利息支出 |  |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  |
| 3．其他费用 | -215.00 |
| 三、清算净损益（净亏损以“-”号填列） | 12,683.68 |

注：此处的其他收入为赎回费收入。

**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2018年3月15日基金净资产 | 6,636,785.96 |
| 加：清算期间净收益 | 12,683.68 |
| 减：因2018年3月15日交易份额产的净值变动 | 9,744.35 |
| 二、2018年4月26日基金净资产 | 6,639,725.29 |

资产处置及负债清偿后，本基金截止至清算结束日本基金剩余财产为人民币6,639,725.29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。本基金清算费包括持有人大会费用、律师费等由国联安基金管理有限公司承担。

清算结束日2018年4月26日至清算款划出日前一日(预估为2018年8月27日)的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。截至清算结束日前一日2018年4月25日止的应收银行存款利息及应收交易保证金利息共计人民币10,883.10元，与基金管理人预估的自2018年4月26日起至2018年8月27日止期间的应收利息，均由基金管理人以自有资金垫付并已于2018年4月26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2018年4月26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6,676,775.99元，其中人民币47,933.80元系基金管理人代垫的截至2018年8月27日预估的银行存款及交易保证金应收利息。

**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、国联安鑫富混合型证券投资基金自2018年1月1日至2018年3月15日(基金最后运作日)止期间财务报表及审计报告

　　 2、《国联安鑫富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

国联安鑫富混合型证券投资基金基金财产清算小组

　　 2018年4月26日