**国联安鑫盛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：二零一八年七月六日**

# **§1 重要提示**

国联安鑫盛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”）《关于准予国联安鑫盛混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2568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《国联安鑫盛混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年11月30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200,022,429.91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《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》、《国联安鑫盛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，国联安鑫盛混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）出现了基金合同终止事由。根据基金合同的约定，国联安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）应当在上述事由出现后依法对基金财产进行清算，此事项不需召开基金份额持有人大会。自2018年5月9日起，本基金进入财产清算程序。

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5月9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 | 国联安鑫盛混合 |
| 基金主代码 | 003772 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年11月30日 |
| 报告期末(2018年5月8日)基金份额总额 | 1,495,341.09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，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |

**§3基金运作情况概述**

国联安鑫盛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”）《关于准予国联安鑫盛混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2568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《国联安鑫盛混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年11月30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200,022,429.91份基金份额。2016年11月30日至2018年5月8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》、《国联安鑫盛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，国联安鑫盛混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）出现了基金合同终止事由。根据基金合同的约定，国联安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）应当在上述事由出现后依法对基金财产进行清算，此事项不需召开基金份额持有人大会。自2018年5月9日起，本基金进入财产清算程序。

**§4财务报表**

## 4.1 资产负债表

会计主体：国联安鑫盛混合型证券投资基金

报告截止日：2018年5月8日（基金最后运作日）

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| **资产** | **最后运作日**  **2018年5月8日** |
| 资产 : |  |
| 银行存款 | 212,795.68 |
| 结算备付金 | 7,026.63 |
| 存出保证金 | 83,654.16 |
| 交易性金融资产 | 1,264,788.00 |
| 其中：股票投资 |  |
| 债券投资 | 1,264,788.00 |
| 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 | 5,468.57 |
| 应收股利 |  |
| 应收申购款 |  |
| 其他资产 |  |
| 资产合计: | 1,573,733.04 |
| **负债和所有者权益** | **最后运作日**  **2018年5月8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 | 9.93 |
| 应付管理人报酬 | 224.73 |
| 应付托管费 | 37.46 |
| 应付销售服务费 | 0.27 |
| 应付交易费用 |  |
| 应付税费 |  |
| 应付利息 |  |
| 应付利润 |  |
| 其他负债 | 54,200.00 |
| 负债合计 | 54,472.39 |
| **所有者权益：** |  |
| 实收基金 | 1,495,341.09 |
| 未分配利润 | 23,919.56 |
| 所有者权益合计 | 1,519,260.65 |

4.2利润表

会计主体：国联安鑫盛混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年5月8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5月8日（基金最后运作日） |
| 一、收入 | 82,384.40 |
| 1、利息收入 | 1,275,556.81 |
| 其中：存款利息收入 | 54,526.06 |
| 债券利息收入 | 1,207,968.42 |
| 资产支持证券利息收入 | 13,062.33 |
| 买入返售金融资产收入 |  |
| 2、投资收益（损失以"-"填列） | -1,574,244.10 |
| 其中：股票投资收益 | 1,245,775.47 |
| 债券投资收益 | -2,815,285.09 |
| 资产支持证券投资收益 | -4,734.48 |
| 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） | 381,065.64 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） |  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.05 |
| **减：二、费用** | 352,927.52 |
| 1、管理人报酬 | 108,075.25 |
| 2、托管费 | 18,012.53 |
| 3、销售服务费 | 3.87 |
| 4、交易费用 | 25,789.68 |
| 5、利息支出 | 122,643.07 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 122,643.07 |
| 6、其他费用 | 78,403.12 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | -270,543.12 |
| 减：所得税费用 |  |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | -270,543.12 |

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1802903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5月9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5月9日至2018年5月25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212,795.68元，清算期间银行存款净流入人民币1,313,450.71元，于清算结束日银行存款余额为人民币1,526,246.39元。

5.1.2本基金最后运作日最低备付金余额为人民币7,026.63元，于清算结束日仍未收回至托管账户,该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于清算结束日(2018年5月25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本基金最后运作日存出保证金余额为人民币83,654.16元，于清算结束日仍未收回至托管账户,该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于清算结束日(2018年5月25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本基金最后运作日债券投资余额为人民币1,264,788.00元, 清算期间相关债券资产已全部变现，于清算结束日债券投资余额为零。

5.1.5本基金最后运作日应收利息余额为人民币5,468.57元，清算期间应收债券利息人民币4,306.09元已全部变现，清算期间计提应收银行存款利息人民币1,046.96元、应收最低备付金利息人民币5.44元、应收交易保证金利息人民币64.09元，于清算结束日应收利息余额为人民币2,278.97元，该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于清算结束日（2018年5月25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9.93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224.73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37.46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0.27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54,200.00元，于清算期间支付54,000.00元，预提的200.00元为预估金额且根据付款通知书确认无需支付已回冲，公司垫资款99,179.79元于清算结束日划入托管账户，于清算结束日其他负债余额为99,179.79元。

**5.3清算期间的清算损益情况**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 2018年5月9日(基金开始清算日)至2018年5月25日(基金结束清算日)止期间 |
| 一、资产处置损益 | 616.98 |
| 1.利息收入 | 1,246.98 |
| 其中：存款利息收入 | 1,116.49 |
| 债券利息收入 | 130.49 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 1,956.00 |
| 其中：债券投资收益 | 1,956.00 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -2,586.00 |
| 4.其他收入（损失以“-”号填列） | - |
| 二、清算费用 | -148.73 |
| 1．交易费用 | 1.27 |
| 2．利息支出 |  |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  |
| 3．其他费用 | -150.00 |
| 三、清算净损益（净亏损以**“-”**号填列） | 765.71 |

**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5月8日基金净资产 | 1,519,260.65 |
| 加：清算期间净收益 | 765.71 |
| 二、2018年5月25日基金净资产 | 1,520,026.36 |

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1,520,026.36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。本基金清算费中的律师费由国联安基金管理有限公司承担。

清算结束日2018年5月25日至清算款划出日前一日(预估为2018年8月24日)的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。截至2018年5月24日止的应收利息共计人民币2,206.20元，为应收银行存款利息、应收最低备付金利息、应收交易保证金利息，由基金管理人以自有资金垫付并已于2018年5月25日划入托管账户。自2018年5月25日起至2018年8月24日止期间的应收利息，以当前适用的利率预估为人民币6,292.80元，由基金管理人以自有资金垫付并已于2018年5月25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5月25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1,526,246.39元，其中人民币92,886.99元系基金管理人代垫的截至2018年5月24日的应收利息、最低备付金以及交易保证金，人民币6,292.80元系基金管理人代垫的2018年5月25日起至2018年8月24日止期间以当前适用的利率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、国联安鑫盛混合型证券投资基金自2018年1月1日至2018年5月8日(基金最后运作日)止期间财务报表及审计报告

　　 2、《国联安鑫盛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。

国联安鑫盛混合型证券投资基金基金财产清算小组

　　 2018年5月25日