**国联安鑫禧灵活配置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：二零一九年三月十一日**

# **§1 重要提示**

国联安鑫禧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”）《关于准予国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1809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《国联安鑫禧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》”）发售，基金合同于2016年2月3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236,601,133.48份（包括利息结转的份额）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》、《基金合同》的有关规定，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12月10日起，本基金进入基金财产清算程序。

根据上述法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金基金财产清算小组于2018年12月10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、丁瑶希；基金托管人的授权代表为金虹、胡波；毕马威华振会计师事务所会计师为王国蓓、钱茹雯；上海市通力律师事务所律师为陆奇、程杨。

**§2 基金产品概况**

|  |  |
| --- | --- |
| 基金简称 | 国联安鑫禧混合 |
| 基金主代码 | 002365 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年2月3日 |
| 报告期末（2018年12月9日）基金份额总额 | 8,043,999.92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×50%+上证国债指数×50% |
| 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**

本基金经中国证监会《关于准予国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1809号文）批准，由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《基金合同》发售，基金合同于2016年2月3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236,601,133.48份（包括利息结转的份额）基金份额。2016年2月3日至2018年12月9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》、《基金合同》的有关规定，本基金出现了基金合同终止事由。根据《基金合同》的约定，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12月10日起，本基金进入基金财产清算程序。

**§4财务报表**

**4.1 资产负债表**

会计主体：国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月9日（基金最后运作日）

单位：人民币元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 资产 | 金额 | 负债和所有者权益 | 金额 |
|  |  |  |  |
| **资 产 :** |  | **负债:** |  |
| 银行存款 | 341,860.75 | 短期借款 |  |
| 结算备付金 | 3,821.55 | 交易性金融负债 |  |
| 存出保证金 | 4,499.32 | 衍生金融负债 |  |
| 交易性金融资产 | 702,690.00 | 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 | 702,690.00 | 应付赎回款 | 847,291.61 |
| 资产支持证券投资 |  | 应付管理人报酬 | 1,565.53 |
| 基金投资 |  | 应付托管费 | 260.92 |
| 衍生金融资产 |  | 应付销售服务费 | 1,262.32 |
| 买入返售金融资产 |  | 应付交易费用 |  |
| 应收证券清算款 | 8,310,394.30 | 应付税费 | 5.65 |
| 应收利息 | 16,724.23 | 应付利息 |  |
| 应收股利 |  | 应付利润 |  |
| 应收申购款 |  | 其他负债 | 314,398.34 |
| 其他资产 |  | **负债合计** | 1,164,784.37 |
|  |  | **所有者权益：** |  |
|  |  | 实收基金 | 8,043,999.92 |
|  |  | 未分配利润 | 171,205.86 |
|  |  | **所有者权益合计** | 8,215,205.78 |
|  |  |  |  |
| **资产合计:** | 9,379,990.15 | **负债与持有人权益总计：** | 9,379,990.15 |

**4.2利润表**

会计主体：国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年12月9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12月9日（基金最后运作日） |
| 一、收入 | -1,892,883.87 |
| 1、利息收入 | 1,015,730.68 |
| 其中：存款利息收入 | 275,005.39 |
| 债券利息收入 | 730,213.18 |
| 资产支持证券利息收入 |  |
| 买入返售金融资产收入 | 10,512.11 |
| 2、投资收益（损失以"-"填列） | -15,410,734.33 |
| 其中：股票投资收益 | 5,899,917.09 |
| 债券投资收益 | -21,492,812.02 |
| 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 | 182,160.60 |
| 3、公允价值变动损益（损失以"-"填列） | 12,434,119.39 |
| 4.其他收入（损失以“-”号填列） | 68,000.39 |
| **减：二、费用** | 737,899.17 |
| 1、管理人报酬 | 242,205.56 |
| 2、托管费 | 40,367.55 |
| 3、销售服务费 | 61,743.40 |
| 4、交易费用 | 33,579.40 |
| 5、利息支出 | 5,085.72 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 5,085.72 |
| 6、其他费用 | 354,917.54 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | -2,630,783.04 |
| 减：所得税费用 |  |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | -2,630,783.04 |

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、钱茹雯签字出具了毕马威华振审字第1900021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12月10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12月10日至2018年12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341,860.75元，清算期间银行存款净流入人民币7,892,394.19元，于清算结束日银行存款余额为人民币8,234,254.94元。

5.1.2本基金最后运作日存出保证金余额为人民币4,499.32元，于清算结束日存出保证金余额为人民币4,499.32元。

5.1.3本基金最后运作日结算备付金余额为人民币3,821.55元，于清算结束日结算备付金余额为人民币3,821.55元。

5.1.4本基金最后运作日债券投资余额为人民币702,690.00元，所有债券投资于清算期间处置变现，变现资金于2018年12月11日划入托管账户。

5.1.5本基金最后运作日应收利息余额为人民币16,724.23元，清算期间计提应收银行存款利息人民币7,210.32元、计提应收交易保证金利息人民币3.80元，计提应收清算备付金利息人民币3.23元、计提应收债券利息人民币53.97元；清算期间因收到银行存款结息结转应收银行存款利息人民币7,986.30元、因收到交易保证金结息结转应收交易保证金人民币34.52元、因收到清算备付金结息结转应收清算备付金人民币34.89元、因收到债券利息结转应收债券利息人民币12,921.91元，结息金额均已转入托管户。清算结束日应收利息余额为人民币3,017.93元，该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于2018年12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。

5.1.6本基金最后运作日证券清算款余额为人民币8,310,394.30元，该款项于2018年12月10日转入托管户，于清算结束日证券清算款余额为零元。

**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847,291.61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赎回费余额为人民币98.34元，均于清算期间支付，于清算结束日应付赎回费余额为零。

5.2.3本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,565.53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。

5.2.4本基金最后运作日应付托管费为人民币260.92元，均于清算期间支付，于清算结束日应付托管费余额为零。

5.2.5本基金最后运作日应付销售服务费为人民币1.262.32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314,305.65元，均于清算期间支付，于清算结束日计提其他应付款人民币25,948.83元，为应付管理人代垫款，于清算结束日其他负债余额为25,948.83元。

**5.3清算期间的清算损益情况**

单位：人民币元

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 2018年12月10日(基金开始清算日)至2018年12月28日(基金结束清算日)止期间 |
| 一、资产处置损益 | 4,552.56 |
| 1.利息收入 | 7,271.05 |
| 其中：存款利息收入 | 7,210.34 |
| 备付金利息收入 | 3.11 |
| 存出保证金利息收入 | 3.69 |
| 债券利息收入 | 53.91 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 13,039.42 |
| 其中：债券投资收益 | 13,039.42 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -15,757.91 |
| 4.其他收入（损失以“-”号填列） |  |
| 二、清算费用 | 113.43 |
| 1．交易费用 | 8.43 |
| 2．利息支出 |  |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |  |
| 3．其他费用 | 105.00 |
| 三、清算净损益（净亏损以“-”号填列） | 4,439.13 |

注：1、此处的其他费用为银行划款手续费。

2、此处的利息收入为清算期间确认的利息收入。

**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12月9日基金净资产 | 8,215,205.78 |
| 加：清算期间净收益 | 4,439.13 |
| 减：因交易份额产生的净值变动 |  |
| 二、2018年12月28日基金净资产 | 8,219,644.91 |

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8,219,644.91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。本基金清算费包括律师费由国联安基金管理有限公司承担。

清算结束日2018年12月28日至清算款划出日前一日(预估为2019年2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12月27日止的应收银行存款利息、应收交易保证金及清算备付金利息共计人民币2,647.02元，与基金管理人预估的自2018年12月28日起至2019年2月28日止期间所有资产的应收利息，均由基金管理人以自有资金垫付并已于2018年12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2018年12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、结算备付金、存出保证金共计人民币8,242,575.81元，其中人民币25,948.83元系基金管理人代垫的截至2019年2月28日预估的应收利息。

**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、国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金自2018年1月1日至2018年12月9日（基金最后运作日）止期间财务报表及审计报告

　　 2、《国联安鑫禧灵活配置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

国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

　　 2018年12月28日