

# 华安全球稳健配置证券投资基金 清算报告

基金管理人：华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

报告送出日期：2021年11月18日

## §1 重要提示

华安全球稳健配置证券投资基金（以下简称“本基金”），系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（2016）868号《关于准予华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》及证监许可[2017]2110号《关于准予华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2018年6月29日生效。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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》和《华安全球稳健配置证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，经与基金托管人协商一致终止《基金合同》。本基金管理人决定本基金最后运作日为2021年9月29日，自2021年9月30日进入清算期。

基金管理人华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、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2021年9月30日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## §2 基金产品概况

基金简称	华安全球稳健配置
基金主代码	005440
交易代码	005440
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月29日
报告期末(2021年9月29日)基金份额总额	16,163,619.26份
投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理，实现组合资产的分散化投资，严格遵守投资纪律，力争实现投资组合的风险收益交换效率最大化，并追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资于股票与债券两大类资产，建仓完成后股债两类资产配置的目标比例为50%/50%，偏离误差控

	<p>制在±10%，并定期进行回顾和再平衡调整。在实际投资过程中，由于受全球宏观经济发展、资本市场变化等因素影响，基金管理人可适时对股债大类资产配置比例进行调整。当全球资本市场正常运行时，本基金维持50%/50%的股债配比；当全球资本市场处于非正常状态，尤其是股票市场大幅动荡时，本基金将适当降低股票资产的配置比例，适当提高债券资产和现金的配置比例。</p> <p>本基金将全球股票市场分为成熟市场和新兴市场两类，将全球债券市场分为美国市场、非美成熟市场和新兴市场三类。本基金将根据全球宏观经济走势、各区域和各主要经济体发展水平，并结合对各细分市场的深入分析，采用全球资产配置量化模型，确定各类资产项下的具体市场配置比例并进行定期调整，争取构建具备中长期发展潜力的资产组合。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准（经汇率调整）：明晟 MSCI 世界指数收益率×25% + 明晟 MSCI 新兴市场指数收益率×25% + 彭博巴克莱全球综合债券指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为基金中基金，预期风险与收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于全球股票型基金。本基金投资于境外市场证券，因此面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
基金管理人	华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

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[2016]868号《关于准予华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》及证监许可[2017]2110号《关于准予华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2018年6月29日生效。首次设立募集规模为296,372,424.79份基金份额。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。根据《华安全球稳健配置证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、《基金合同》约定的其他情形；4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

根据基金管理人于2021年9月30日发布的《华安基金管理有限公司关于华安全球稳健配置证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金基金份额持有人大会于2021年9月29日表决通过了《关于终止华安全球稳健配置证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金份额持有人大会决议自该日起生效。

## §4 财务报告

### 4.1 资产负债表

会计主体：华安全球稳健配置证券投资基金

报告截止日：2021年09月29日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2021年9月29日
<b>资产：</b>	
银行存款	17,951,169.34
应收股利	8,311.07
应收利息	28.31
应收申购款	1,904.95
<b>资产总计</b>	<b>17,961,413.67</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>最后运作日 2021年9月29日</b>
<b>负债：</b>	
应付赎回款	7,930.26
应付管理人报酬	22,911.79
应付托管费	5,011.99
应付销售服务费	121.17
应交税费	36,954.77

其他负债	37,270.63
<b>负债合计</b>	<b>110,200.61</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	16,163,619.26
未分配利润	1,687,593.80
<b>所有者权益合计</b>	<b>17,851,213.06</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>17,961,413.67</b>

注 1：本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安全球稳健配置证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于基金最后运作日，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。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。

注 2：本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师陈胜、张旭颖签字出具了安永华明（2021）专字第 60971571\_B08 号标准无保留意见的审计报告。

## §5 清算情况

自 2021 年 9 月 30 日起至 2021 年 11 月 9 日止清算期间，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 本基金最后运作日应收股利为美元 1,285.31 元，折合人民币 8,311.07 元（折算汇率为当日中国外汇交易中心公告的人民币汇率中间价），该款项已于 2021 年 10 月 29 日划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日应收利息为人民币 28.31 元，其中人民币存款利息为人民币 23.40 元，美元存款利息为美元 0.76 元，折合人民币 4.91 元（折算汇率为

当日中国外汇交易中心公告的人民币汇率中间价)。上述款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付,基金管理人垫付资金已于2021年11月9日划入托管账户,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申购款为人民币1,904.95元,该款项已于2021年9月30日和2021年10月8日划入托管账户。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币7,930.26元,该款项已于2021年9月30日、2021年10月8日、2021年10月13日和2021年10月15日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币22,911.79元,应付托管费为人民币5,011.99元,应付销售服务费为人民币121.17元,上述款项已于2021年10月12日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应交税费为人民币36,954.77元,为应交增值税及附加税,该款项已于2021年10月14日支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债为人民币37,270.63元,其中应付赎回费人民币9.35元,预提审计费人民币37,261.28元。应付赎回费已于2021年9月30日支付,预提审计费将于本基金年度财务报表审计报告出具后支付,若因本基金终止运作未出具年度财务报表审计报告,冲回该项预提费用产生的收益将按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2021年9月30日至2021年11月9日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	7,124.11
2、汇兑损益	7,304.19
3、其他收入(注2)	27.87

清算收益小计	14,456.17
二、清算费用	
1、其他费用（注3）	60,035.00
清算费用小计	60,035.00
三、清算期间净收益（损失以“-”号填列）	-45,578.83

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2021年9月30日至2021年11月9日止清算期间的银行存款利息。其中预提的银行存款利息由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于2021年11月9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。

注2：其他收入系清算期间确认的最后运作日投资者赎回申请所产生的基金赎回费收入。

注3：其他费用系基金份额持有人大会公证费及律师费和清算期间所产生的银行手续费、清算律师费及审计费。

#### 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2021年9月29日基金净资产	17,851,213.06
加：清算期间净收益（损失以“-”号填列）	-45,578.83
加：基金净申购转入金额 （于清算期间确认的最后运作日投资者申购转入申请）	880.89
减：基金净赎回转出金额 （于清算期间确认的最后运作日投资者赎回转出申请）	7,430.93
二、2021年11月9日基金净资产	17,799,084.19

根据本基金的基金合同及《华安基金管理有限公司关于华安全球稳健配置证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2021年11月9日止的剩余财产净额为人民币17,799,084.19元。

截至2021年11月9日止，经本基金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人民币17,849,193.10元，其中人民币20,000.00元系基金管理

人代垫资金。

## 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。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

## §6 备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

- 1、华安全球稳健配置证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、关于华安全球稳健配置证券投资基金清算报告的法律意见

### 6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 (<http://www.huaan.com.cn>)、中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)，清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

### 6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安全球稳健配置证券投资基金  
基金财产清算小组

二〇二一年十一月九日（清算报告出具日）