

国金基金管理有限公司
国金鑫安保本混合型证券投资基金
清算报告

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

信息披露时间：二零一八年二月二日

一、重要提示

国金鑫安保本混合型证券投资基金（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[2014]716号文核准募集，于2014年8月27日正式运作，基金管理人为国金基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国光大银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”或“光大银行”）。

根据2017年1月24日中国证监会发布的《关于避险策略基金的指导意见》有关规定，对于《关于避险策略基金的指导意见》施行前已经成立的保本基金，如不符合《关于避险策略基金的指导意见》的有关规定，应在保本周期到期后对法律文件予以修订并变更注册为避险策略基金，未按照《关于避险策略基金的指导意见》的要求进行修订的，应当转为其他类型的基金或予以清算。

本基金保本周期为一年，本基金第三个保本周期自2016年11月7日起至2017年11月7日止。结合市场情况，本基金第三个保本周期到期，根据《关于避险策略基金的指导意见》关于避险策略基金的运作机制进行调整存在一定困难。为了更好地保护投资者利益，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》和《国金鑫安保本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，基金管理人经与基金托管人协商一致，遵守《基金合同》对于本基金保本周期到期后基金存续形式的约定，终止《基金合同》并进入清算程序。

二、基金概况

（一）基金名称：

国金鑫安保本混合型证券投资基金（基金简称：国金鑫安保本，基金代码：000749）

（二）基金运作方式：

契约型开放式

（三）基金合同生效日：

2014年8月27日

（四）第三个保本周期起始日

2016年11月7日

(五) 第三个保本周期到期日

2017年11月7日

(六) 投资目标:

本基金在保证客户本金的基础上, 力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

(七) 投资策略:

本基金通过固定比例投资组合保险(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)策略和时间不变性投资组合保险(TIPP, Time Invariant Portfolio Protection)策略, 在保本周期中, 对资产配置严格按照公司开发的保本模型进行优化动态调整, 确保投资者的投资本金的安全性。同时, 本基金通过积极稳健的收益资产投资策略, 竭力为基金资产获取更高的增值回报。

本基金的投资策略主要由五部分组成: 资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略。

(八) 业绩比较基准:

一年期银行定期存款税后收益率。

(九) 风险收益特征:

本基金为保本混合型基金, 属于证券投资基金中的中低风险品种, 其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金, 高于货币市场基金和债券型基金。

(十) 基金管理人:

国金基金管理有限公司

(十一) 基金托管人:

中国光大银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表(经审计)

会计主体: 国金鑫安保本混合型证券投资基金

报告截止日: 2017年11月14日

单位: 人民币元

	最后运作日 2017年11月14日
资产:	

银行存款	17,451,129.38
结算备付金	2,659,046.09
存出保证金	2,753.19
应收利息	26,747.82
资产总计	20,139,676.48
负债和所有者权益	
负 债:	
应付赎回款	8,327,168.07
应付管理人报酬	20,541.69
应付托管费	2,738.89
应付销售服务费	11,632.28
应付交易费用	148,732.11
其他负债	334,443.65
负债合计	8,845,256.69
所有者权益:	
实收基金	10,223,445.29
未分配利润	1,070,974.50
所有者权益合计	11,294,419.79
负债和所有者权益总计	20,139,676.48

四、清盘事项说明

(一) 基本情况

本基金系经中国证监会证监许可[2014]716号文《关于核准国金通用鑫安保本混合型证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人于2014年7月31日至2014年8月22日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2014）验字第61004823_A03号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。《基金合同》于2014年8月27日正式生效，首次设立募集规模为人民币1,442,871,559.51元，折合1,442,871,559.51份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司。本基金保本周期为一年，本基金第三个保本周期自2016年11月7日起至2017年11月7日止。

本基金的投资范围为国内依法公开发行的各类具有良好流动性的金融工具，包括现金、银行存款（包括活期存款、定期存款和协议存款等）、同业存单、债券（包括国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券、中小企业私募债、央行票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证，以及中国证监会允许

基金投资的其他金融工具。

本基金根据投资策略对安全资产（包括现金、银行存款、同业存单、债券、资产支持证券、债券回购等）及风险资产（股票、股指期货、权证等）两类资产的投资比例进行动态调整。其中，股票、股指期货、权证等风险资产占基金资产净值的比例不高于 60%；现金、银行存款、债券、资产支持证券、债券回购等安全资产占基金资产净值的比例不低于 40%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款税后收益率。

（二）清算原因

根据2017年1月24日中国证监会发布的《关于避险策略基金的指导意见》有关规定，对于《关于避险策略基金的指导意见》施行前已经成立的保本基金，如不符合《关于避险策略基金的指导意见》的有关规定，应在保本周期到期后对法律文件予以修订并变更注册为避险策略基金，未按照《关于避险策略基金的指导意见》的要求进行修订的，应当转为其他类型的基金或予以清算。

结合市场情况，本基金第三个保本周期到期时，根据《关于避险策略基金的指导意见》关于避险策略基金的运作机制进行调整存在一定困难。为了更好地保护投资者利益，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》和《基金合同》的有关规定，基金管理人经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，遵守《基金合同》对于本基金保本周期到期后基金存续形式的约定，终止《基金合同》并进入清算程序。

（三）清算起始日

本基金第三个保本周期到期期间为 2017 年 11 月 7 日（含）至 2017 年 11 月 14 日（含）。自本基金第三个保本周期到期期间结束下一工作日即 2017 年 11 月 15 日起，本基金进入清算程序。

（四）清算报表编制基础

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。

五、清算情况

自 2017 年 11 月 15 日起至 2017 年 12 月 4 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：

（一）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，本基金《基金合同》约定清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。为保护投资者利益，本基金清算费用将由基金管理人代为承担。

（二）资产处置情况

1、本基金最后运作日结算备付金为人民币 2,659,046.09 元，其中，人民币 2,386,318.82 元已于 2017 年 12 月 4 日从上海结算备付金账户划入托管账户；该款项剩余人民币 272,727.27 元由基金管理人于 2017 年 12 月 4 日以自有资金垫付至托管账户。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。

2、本基金最后运作日存出保证金为人民币 2,753.19 元，该款项已于 2017 年 12 月 4 日分别从上海及深圳的结算保证金账户划入托管账户。

3、本基金最后运作日应收利息为人民币 26,747.82 元，该款项由基金管理人于 2017 年 12 月 4 日以自有资金垫付至托管账户。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。

（三）负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 8,327,168.07 元，该款项已分别于 2017 年 11 月 15 日、2017 年 11 月 16 日支付。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 20,541.69 元，该款项已于 2017 年 11 月 28 日支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,738.89 元，该款项已于 2017 年 11 月 28 日支付。

4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 11,632.28 元，该款项已于 2017 年 11 月 28 日支付。

5、本基金最后运作日应付交易费用为人民币 148,732.11 元，该款项已分别于 2017 年 11 月 20 日和 2017 年 11 月 28 日支付。

6、本基金最后运作日其他负债为人民币 334,443.65 元，其中人民币 46.74 元为指数使用费，已分别于 2017 年 11 月 27 日和 2017 年 11 月 28 日支付；人民币 334,396.91 元为信息披露费，已于 2017 年 11 月 27 日支付人民币 334,396.53 元，剩余人民币 0.38 元转入其他收入。

(四) 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2017 年 11 月 15 日 至 2017 年 12 月 04 日 止清算期间
一、清算收益（损失）	
1、利息收入（注 1）	5021.41
2、其他收入（注 2）	0.38
清算收益小计	5021.79
二、清算费用	
清算费用小计（注 3）	-
三、清算净收益	5021.79

注1：利息收入系计提的自2017年11月15日至2017年12月4日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息。

注2：其他收入系本基金账面应付信息披露费金额与开票金额的差额。

注3：清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，本基金《国金鑫安保本混合型证券投资基金基金合同》约定清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。为保护投资者利益，本基金清算费用将由基金管理人代为承担。

(五) 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 11 月 14 日基金净资产	11,294,419.79
加：清算期间净收益	5,021.79
减：基金净赎回金额（于 2017 年 11 月 14 日申请并于 2017 年 11 月 15 日确认的投资者赎回申请）	2,632,967.31
二、2017 年 12 月 4 日基金净资产	8,666,474.27

资产处置及负债清偿后，于 2017 年 12 月 4 日本基金剩余财产为人民币

8,666,474.27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并清偿基金债务后,将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。其中,基金财产清算费用由基金管理人代为承担。

清算起始日2017年11月15日至清算款划出日前一日的应收利息亦属份额持有人所有。以上利息均按实际适用的利率计算,由基金管理人以自有资金垫付并将于清算款划出前划入托管账户。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12月4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人民币8,671,862.42元,其中人民币37,157.38元系基金管理人代垫的应收利息,人民币272,727.27元系基金管理人代垫的结算备付金,基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

(六) 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。

六、备查文件

(一) 备查文件目录

1、《国金鑫安保本混合型证券投资基金2017年11月15日资产负债表及审计报告》

2、《〈国金鑫安保本混合型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

(二) 存放地点

基金管理人的办公场所。

(三) 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。

国金鑫安保本混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018年2月2日