

# 国联安鑫瑞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：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日：二零一八年三月九日

## § 1 重要提示

国联安鑫瑞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”）《关于核准国联安鑫瑞混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2016]1817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《国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年9月9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808,730,517.32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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》、《国联安鑫瑞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2017年10月24日表决通过了《关于终止国联安鑫瑞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2017年10月25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、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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孙颖、余胜潮；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	国联安鑫瑞混合
基金主代码	003271
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月9日
报告期末(2017年10月24日)基金份额总额	494,508.57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,力求实现基金资产的长期稳定增值。
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	中国建设银行股份有限公司

## § 3 基金运作情况概述

国联安鑫瑞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”)《关于核准国联安鑫瑞混合型证券投资基金募集的批复》(证监许

可[2016]1817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《国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2016年9月9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808,730,517.32份基金份额。2016年9月9日至2017年10月24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》、《国联安鑫瑞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2017年10月24日表决通过了《关于终止国联安鑫瑞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2017年10月25日起进入清算程序。

## § 4 财务报表

### 4.1 资产负债表

会计主体:国联安鑫瑞混合型证券投资基金

报告截止日:2017年10月24日(基金最后运作日)

单位:人民币元

资产	最后运作日 2017年10月24日
<b>资产:</b>	
银行存款	287,707.88
结算备付金	
存出保证金	494.06
交易性金融资产	429,742.00
其中:股票投资	
债券投资	429,742.00
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	7,281.55

应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产合计:	725,225.49
负债和所有者权益	最后运作日 2017年10月24日
<b>负债:</b>	
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	9.53
应付管理人报酬	895.38
应付托管费	149.25
应付销售服务费	3.00
应付交易费用	
应付税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	250,000.00
负债合计	251,057.16
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	494,508.57
未分配利润	-20,340.24
所有者权益合计	474,168.33

#### 4.2 利润表

会计主体：国联安鑫瑞混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年10月24日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 10月24日（基金最后运作 日）
<b>一、收入</b>	<b>11,901,183.61</b>
1、利息收入	9,463,671.11
其中：存款利息收入	134,442.64
债券利息收入	9,253,520.71
资产支持证券利息收入	

买入返售金融资产收入	75,707.76
2、投资收益（损失以“-”填列）	-3,787,084.10
其中：股票投资收益	4,978,787.27
债券投资收益	-8,766,164.86
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	293.49
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	6,223,722.67
4、其他收入（损失以“-”填列）	873.93
<b>减：二、费用</b>	<b>2,775,652.59</b>
1、管理人报酬	1,986,821.71
2、托管费	331,136.95
3、销售服务费	57.44
4、交易费用	111,723.52
5、利息支出	11,273.29
其中：卖出回购金融资产支出	11,273.29
6、其他费用	334,639.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>9,125,531.02</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>9,125,531.02</b>

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 1702883 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 2017 年 10 月 25 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 2017 年 10 月 25 日至 2017 年 11 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 287,707.88 元，清算期间银行存款净

流入人民币 187,511.62 元，于清算结束日银行存款余额为人民币 475,219.50 元。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金为人民币 494.06 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 697.89 元，该款项由基金管理人国联安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2017 年 11 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。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息余额为人民币 7,281.55 元，于清算结束日应收利息余额为人民币 870.09 元，该款项由基金管理人以自有资金垫付，并已于 2017 年 11 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。

5.1.4. 本基金最后运作日交易性金融资产为 429,742.00 元，其中股票投资为 0 元，债券投资为 429,742.00 元，系基金合同对债券投资的持有比例要求而持有的债券明细如下：

5.1.4.1 于 2017 年 10 月 24 日（基金最后运作日）本基金持有的债券投资列示如下：

债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
019563	17 国债 09	4,300	429,742.00	90.63

截至清算结束日，债券投资资产余额为零。

## 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 9.53 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 895.38 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 149.25 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 3.00 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 250,000.00 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	2017 年 10 月 25 日(基金清算起始日)至 2017 年 11 月 28 日(基金清算结束日)止期间
----	---

一、资产处置损益	382.42
1. 利息收入	511.42
其中：存款利息收入	394.09
债券利息收入	117.33
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-200.67
其中：债券投资收益	-200.67
3. 公允价值变动收益（损失以“允价号填列）	71.67
二、清算费用	203.99
1. 交易费用	0.44
2. 利息支出	0
其中：卖出回购金融资产支出	0
3. 其他费用	203.55
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	178.43

#### 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2017年10月24日基金净资产	474,168.33
加：清算期间净收益	178.43
减：因2017年10月24日交易份额产生的净值变动	9.53
二、2017年11月28日基金净资产	474,337.23

资产处置及负债清偿后，本基金截至2017年11月28日（清算结束日）止的剩余财产为人民币474,337,23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。

清算结束日 2017 年 11 月 28 日至清算款划出日前一日(预估为 2018 年 2 月 28 日)的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。截至 2017 年 11 月 27 日止的存出保证金余额为人民币 697.89 元，应收利息共计人民币 870.09 元，由基金管理人以自有资金垫付并已于 2017 年 11 月 28 日划入托管账户。自 2017 年 11 月 28 日起至 2018 年 2 月 28 日止期间的应收利息，以当前适用的年利率(0.72%)预估为人民币 882.27 元，由基金管理人以自有资金垫付并已于 2017 年 11 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 2017 年 11 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余额共计人民币 475,219.50 元，其中人民币 1,567.98 元系基金管理人代垫的截至 2017 年 11 月 27 日的上交所保证金及应收利息，人民币 882.27 元系基金管理人代垫的 2017 年 11 月 28 日起至 2018 年 2 月 28 日止期间以当前适用的年利率(0.72%)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、国联安鑫瑞混合型证券投资基金自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 10 月 24 日(基金最后运作日)止期间财务报表及审计报告

2、《国联安鑫瑞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。

国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金财产清算小组

2017年11月28日