

# 国联安鑫悦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：二零一八年七月六日

## 1 重要提示

国联安鑫悦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）《关于准予国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1822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《国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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309,153,157.81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》、《国联安鑫悦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》）的有关规定，国联安鑫悦灵活配置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16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16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 国联安鑫悦混合

基金主代码 002368

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5月15日)基金份额总额 18,083,683.27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

国联安鑫悦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）《关于准予国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1822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《国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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309,153,157.81份基金份额。2016年2月3日至2018年5月

15 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》、《国联安鑫悦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》）的有关规定，国联安鑫悦灵活配置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 16 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：国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 5 月 15 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 15 日

资产：

银行存款 14,022,024.94

结算备付金 19,403.33

存出保证金 11,345.54

交易性金融资产 5,466,923.01

其中：股票投资 5,466,923.01

债券投资

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 35,486.50

应收股利

应收申购款

其他资产

资产合计：19,555,183.32

负债和所有者权益 最后运作日

2018 年 5 月 15 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

应付管理人报酬 5,077.12

应付托管费 846.19

应付销售服务费 3,969.85

应付交易费用 2,057.13

应付税费

应付利息

应付利润

其他负债 54,200.00

负债合计 66,150.29

所有者权益：

实收基金 18,083,683.27

未分配利润 1,405,349.76

所有者权益合计 19,489,033.03

#### 4.2 利润表

会计主体：国联安鑫悦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5月15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15日（基金最后运作日）

一、收入 332,270.17

1、利息收入 119,035.58

其中：存款利息收入 88,694.48

债券利息收入 30,341.10

资产支持证券利息收入

买入返售金融资产收入

2、投资收益（损失以“-”填列） 28,514.46

其中：股票投资收益

债券投资收益 3,600.06

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 24,914.40

3、公允价值变动损益（损失以“-”填列） 181,637.68

4.汇兑收益（损失以-号填列）

5.其他收入（损失以-号填列） 3,082.45

减：二、费用 164,539.62

1、管理人报酬 45,549.72

2、托管费 7,591.58

3、销售服务费 35,437.48

4、交易费用 2,640.84

5、利息支出

其中：卖出回购金融资产支出

6、其他费用 73,320.00

三、利润总额（亏损总额以-号填列） 167,730.55

减：所得税费用

四、净利润（净亏损以-号填列） 167,730.55

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 1802904 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 16 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 16 日至 2018 年 5 月 30 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 14,022,024.94 元，清算期间银行存款净流入人民币 5,454,149.62 元，于清算结束日银行存款余额为人民币 19,476,174.56 元。

5.1.2 本基金最后运作日最低备付金余额为人民币 19,403.33 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 30 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 11,345.54 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 30 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 本基金最后运作日股票投资余额为人民币 5,466,923.01 元，清算期间相关股票资产已全部变现，于清算结束日股票投资余额为零。

5.1.5 本基金最后运作日应收利息余额为人民币 35,486.50 元，清算期间计提应收银行存款利息人民币 11,775.28 元、应收最低备付金利息人民币 13.05 元、应收交易保证金利息人民币 7.65 元，于清算结束日应收利息余额为人民币 47,282.48 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 30 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管理人报酬为人民币 5,077.12 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。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 846.19 元，均于清算期间支付，于清算结束日应付托管费余额为零。

5.2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 3,969.85 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。

5.2.4 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 2,057.13 元，均于清算期间支付，于清算结束日应付交易费用余额为零。

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 元为预估上清所查询费用且根据付款通知书确认无需支付已回冲，于清算结束日计提其他应付款人民币 156,582.89 元，为应付基金管理人代垫款。于清算结束日其他负债余额为 156,582.89 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 16 日(基金开始清算日)至 2018 年 5 月 30 日(基金结束清算日)止期间

一、资产处置损益 -50,714.11

1.利息收入 11,795.98

其中：存款利息收入 11,795.98

债券利息收入

2.投资收益（损失以-填列） 1,302,648.58

其中：股票投资收益 1,302,648.58

3.公允价值变动收益（损失以-号填列） -1,365,158.67

4.其他收入（损失以-号填列）

二、清算费用 40,695.90

1. 交易费用 10,830.90

2. 清算律师费 30,000.00

其中：卖出回购金融资产支出

3. 其他费用 -135.00

三、清算净损益（净亏损以-号填列） -91,410.01

#### 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 15 日基金净资产 19,489,033.03

加：清算期间净收益 -91,410.01

二、2018 年 5 月 30 日基金净资产 19,397,623.02

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 19,397,623.02 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产品承担。

清算结束日 2018 年 5 月 30 日至清算款划出日前一日(预估为 2018 年 8 月 28 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 29 日止的应收利息共计人民币 46,404.67 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 30 日划入托管账户。自 2018 年 5 月 30 日起至 2018 年 8 月 28 日止期间的应收利息，以当前适用的利率预估为人民币 79,429.35 元，由基金管理人以自有资金垫付并已于 2018 年 5 月 30 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 30 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 19,476,174.56 元，其中人民币 77,153.54 元系基金管理人代垫的截至 2018 年 5 月 29 日的应收利息、最低备付金以及交易保证金，人民币 79,429.35 元系基金管理人代垫的 2018 年 5 月 30 日起至 2018 年 8 月 28 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、国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 15 日(基金最后运作日)止期间财务报表及审计报告

2、《国联安鑫悦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。

国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018 年 5 月 30 日