

富国富利稳健配置混合型证券投资基金清算报告

富国富利稳健配置混合型证券投资基金
清算报告

基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
公告日期：2018年11月30日

一、重要提示及目录

1、重要提示

富国富利稳健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证监许可[2016]2773号文核准注册募集，于2017年1月25日成立并正式运作。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为维护基金份额持有人利益，基金管理人根据《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《富国富利稳健配置混合型证券投资基金基金合同》（简称“《基金合同》”）的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会（会议投票表决起止时间：自2018年8月21日起，至2018年9月18日17:00止），会议于2018年9月19日表决通过了《关于终止富国富利稳健配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告详见刊登在2018年9月20日《中国证券报》、《上海证券报》和基金管理人网站（www.fullgoal.com.cn）上的《关于富国富利稳健配置混合型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》。根据生效的基金份额持有人大会决议，本基金自2018年9月20日进入清算期。

本基金清算期自2018年9月20日起至2018年10月15日止。由基金管理人富国基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和北京大成（上海）律师事务所于2018年9月20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，北京大成（上海）律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、目录

| | |
|-----------------------|----|
| 一、重要提示及目录 | 2 |
| 1、重要提示 | 2 |
| 2、目录 | 3 |
| 二、基金概况 | 4 |
| 三、财务会计报告 | 4 |
| 四、清盘事项说明 | 5 |
| 1、基金基本情况 | 5 |
| 2、清算原因 | 6 |
| 3、清算起始日 | 6 |
| 4、清算报表编制基础 | 6 |
| 五、清算情况 | 7 |
| 1、清算费用 | 7 |
| 2、资产处置情况 | 7 |
| 3、负债清偿情况 | 8 |
| 4、清算期间的清算损益情况 | 8 |
| 5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况 | 9 |
| 5、基金财产清算报告的告知安排 | 9 |
| 六、备查文件目录 | 9 |
| 1、备查文件目录 | 9 |
| 2、存放地点 | 10 |
| 3、查阅方式 | 10 |

二、基金概况

- 1、基金名称：富国富利稳健配置混合型证券投资基金
- 2、基金简称：富国富利稳健配置混合型（基金主代码：003991）。
- 3、下属两级基金的简称：富国富利稳健配置混合型 A 级（交易代码 003991），富国富利稳健配置混合型 C 级（交易代码：003992）
- 4、基金运作方式：契约型开放式
- 5、基金合同生效日：2017 年 1 月 25 日
- 6、基金管理人：富国基金管理有限公司
- 7、基金托管人：中国工商银行股份有限公司
- 8、最后运作日（2018 年 9 月 19 日）基金份额总额：10,470,279.59，其中：富国富利稳健配置混合型 A 级份额总额：7,669,652.74，富国富利稳健配置混合型 C 级份额总额：2,800,626.85。
- 9、最后运作日（2018 年 9 月 19 日）基金净值：11,008,122.27 元，其中：富国富利稳健配置混合型 A 级净值：8,038,396.80 元，富国富利稳健配置混合型 C 级净值：2,969,725.47 元。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：富国富利稳健配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 9 月 19 日

单位：人民币元

最后运作日

2018 年 9 月 19 日

资 产：

银行存款 50,729.14
结算备付金 156,824.76
存出保证金 1,849.21
应收证券清算款 4,525,178.09
交易性金融资产 2,421,744.48
应收利息 20,887.87
买入返售金融资产 3,900,000.00
资产总计 11,077,213.55
负 债：
应付管理人报酬 6,146.39
应付托管费 1,229.28
应付销售服务费 660.09
应付交易费用 940.96
应付赎回款 19,706.46
其他负债 40,408.10
负债合计 69,091.28
所有者权益：
实收基金 10,470,279.59
未分配利润 537,842.68
所有者权益合计 11,008,122.27
负债和所有者权益总计 11,077,213.55

四、清盘事项说明

1、基金基本情况

富国富利稳健配置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[2016]2773号《关于准予富国富利稳健配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2017年1月25日生效,首次设立募集规模为238,185,167.82份基金份额(含利息折合的49,743.19份)。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及注册登记机构为富国基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。收取认购费、申购费、赎回费,而不计提销售服务费的,称为A类基金份额;不收取认购费、申购费,但收取赎回费并从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,并分别计算基金份额净值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市交易的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、国家债券、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、衍生工具(权证)以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 30%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*15%。

自 2017 年 1 月 25 日至 2018 年 9 月 19 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

2、清算原因

根据《富国富利稳健配置混合型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 2018 年 9 月 20 日发布的《关于富国富利稳健配置混合型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 2018 年 9 月 19 日表决通过了《关于终止富国富利稳健配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，大会决议自该日起生效。

3、清算起始日

根据生效的本基金基金份额持有人大会决议，本基金于 2018 年 9 月 20 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2018 年 9 月 20 日。清算期间为 2018 年 9 月 20 日至 2018 年 10 月 15 日。

4、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 2018 年 9 月 20 日至 2018 年 10 月 15 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：

1、清算费用

按照《富国富利稳健配置混合型证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的律师费由基金管理人承担并支付。

2、资产处置情况

(1)本基金最后运作日应收利息为人民币 20,887.87 元，其中应收银行存款利息人民币 2,627.26 元，应收清算备付金利息人民币 956.91 元，应收结算保证金利息人民币 8.91 元，应收债券利息人民币 17,294.79 元。上述款项已于 2018 年 9 月 21 日划入托管账户。

(2)本基金最后运作日结算备付金为人民币 156,824.76 元，为存放于上海证券交易所和深圳证券交易所的结算备付金。该结算备付金于清算期间（2018 年 10 月 9 日）调整为人民币 211,914.73 元。该款项将于 2018 年 10 月 15 日之后于交易所调整结算备付金时划入托管账户。

(3)本基金最后运作日存出保证金为人民币 1,849.21 元，为存放于中国证券登记结算有限责

任公司上海分公司和深圳分公司的结算保证金。该款项已于 2018 年 10 月 9 日划入托管账户。

(4)本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 4,525,178.09 元, 该款项已于 2018 年 9 月 20 日划入托管账户。

(5)本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 2,421,744.48 元, 全部交易性金融资产人民币 2,421,744.48 元已于清算期间处置。

(6)本基金最后运作日买入返售金融资产为人民币 3,900,000.00 元, 全部买入返售金融资产人民币 3,900,000.00 元已于清算期间处置。

3、 负债清偿情况

(1)本基金最后运作日应付赎回款为人民币 19,706.46 元, 该款项已于 2018 年 9 月 20 日及 2018 年 9 月 21 日支付。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 6,146.39 元, 该款项已于 2018 年 10 月 9 日支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,229.28 元, 该款项已于 2018 年 10 月 9 日支付。

(4)本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 660.09 元, 该款项已于 2018 年 10 月 9 日支付。

(5)本基金最后运作日应付交易费用为人民币 940.96 元, 为应付席位佣金, 已于 2018 年 10 月 12 日支付。

(6)本基金最后运作日其他负债为人民币 40,408.10 元, 其中应付赎回费人民币 16.72 元, 预提清算审计费人民币 21,533.78 元, 预提信息披露费人民币 14,357.60 元, 预提银行间账户维护费人民币 4,500.00 元。其中应付赎回费人民币 16.72 元已分别于 2018 年 9 月 20 日及 2018 年 9 月 21 日支付, 清算审计费人民币 21,533.78 元已于 2018 年 10 月 12 日支付, 信息披露费人民币 7,178.80 元已于 2018 年 10 月 12 日支付, 剩余的信息披露费及银行间账户维护费将于 2018 年 10 月 15 日后支付。

4、 清算期间的清算损益情况

项目 自 2018 年 9 月 20 日

至 2018 年 10 月 15 日

止清算期间

一、 清算收益

1、 利息收入 (注 1) 6,051.07

2、 投资收益 22,327.06

3、 公允价值变动损益 -12,829.54

4、 赎回费收入 3.94

5、 交易费用 -2,853.58

清算收入小计 12,698.95

二、 清算费用

1、 银行汇划费 80.00

清算费用小计 80.00

三、 清算净收益 12,618.95

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 9 月 20 日至 2018 年 10 月 15 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、申购款利息、债券利息和买入返售金融资产利息。

5、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 9 月 19 日基金净资产 11,008,122.27

加：清算期间净收益 12,618.95

减：基金净赎回转出金额

（于 2018 年 9 月 20 日确认的投资者赎回转出申请） 1,721.47

二、2018 年 10 月 15 日基金净资产 11,019,019.75

根据本基金的基金合同及《关于富国富利稳健配置混合型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 2018 年 10 月 15 日止的剩余财产为人民币 11,019,019.75 元。

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

（1）《富国富利稳健配置混合型证券投资基金清算审计报告》；

（2）北京大成（上海）律师事务所关于《富国富利稳健配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

富国富利稳健配置混合型证券投资基金财产清算小组

2018 年 10 月 15 日