

国联安德盛安心成长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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日：二零二四年三月二十日

§ 1 重要提示

国联安德盛安心成长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”）《关于同意国联安德盛安心成长混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2005] 9 号文）注册，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《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）发售，基金合同于 2005 年 7 月 13 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。首次设立募集规模为 409,055,615.48 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》等法律法规的规定及《基金合同》的约定，并经基金份额持有人大会于 2024 年 1 月 17 日表决通过了《关于终止国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自本次基金份额持有人大会决议生效并公告之日即 2024 年 1 月 18 日起，本基金进入基金财产清算程序。

根据上述法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金基金财产清算小组于 2024 年 1 月 18 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、基金托管人中国工商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(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、张志远；基金托管人的授权代表为陈杰、郭为之；普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)会计师为单峰、郭劲扬；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	国联安安心成长混合
基金主代码	253010
交易代码	253010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 7 月 13 日

基金最后运作日（2024年1月17日）基金份额总额	26,329,424.07份
投资目标	全程风险预算，分享经济成长，追求绝对收益
投资策略	本基金的投资管理主要分为两个层次：第一个层次通过全程的风险预算，结合数量化的金融工程模型，根据市场以及基金超额收益率的情况，进行资产配置、行业配置和不同种类债券的配置。第二个层次，在股票投资方面，以价值选股为原则，主要选取基本面好、流动性强，价值被低估的公司，在行业配置基础上进行组合管理；在债券投资方面，注重风险管理，追求稳定收益，基于对中长期宏观形势与利率走势的分析进行久期管理与类属配置，并适量持有可转换债券来构建债券组合。
业绩比较基准	<p>本基金的业绩基准为“德盛安心成长线”，德盛安心成长线的确定：在基金合同生效时的值为0.90元，随着时间的推移每天上涨，在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365。</p> <p>德盛安心成长线用公式表示如下：</p> $A(1) = 0.9$ $A(t+1) = A(t) + \frac{r(t)}{365}, t \geq 1,$ <p>其中 $A(t)$, $r(t)$ 分别为德盛安心成长线和一年期银行存款税后利率在基金合同生效后第 t 天的值。</p> <p>本基金将通过全程的风险预算，力争使基金份额累计净值高于德盛安心成长线水平。</p> <p>如果今后市场有其他更科学合理的业绩基准，在获得中国证监会批准后，本基金管理人可以变更业绩比较基准。</p>
风险收益特征	中低风险的基金产品，追求长期的稳定的收益
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

国联安德盛安心成长混合型证券投资基金经中国证监会《关于同意国联安德盛安心成长混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2005] 9 号文）注册，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《基金合同》发售，基金合同于 2005 年 7 月 13 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。首次设立募集规模为 409,055,615.48 份基金份额。2005 年 7 月 13 日至 2024 年 1 月 17 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》等法律法规的规定及《基金合同》的约定，并经基金份额持有人大会于 2024 年 1 月 17 日表决通过了《关于终止国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自本次基金份额持有人大会决议生效并公告之日即 2024 年 1 月 18 日起，本基金进入基金财产清算程序。

§ 4 财务报表

4.1 资产负债表

会计主体：国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 1 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产：		负 债：	
货币资金	9,069,202.04	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金	791.74	衍生金融负债	
交易性金融资产	6,966,979.83	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资	877,267.50	应付清算款	
债券投资	6,089,712.33	应付赎回款	161,356.22
资产支持证券投资		应付管理人报酬	7,778.18
基金投资		应付托管费	1,555.61
贵金属投资		应付销售服务费	
其他投资		应付投资顾问费	
衍生金融资产		应交税费	195,614.26
买入返售金融资产		应付利润	
应收清算款		递延所得税负债	
应收股利		其他负债	40,000.01
应收申购款	1,147.64	负债合计	406,304.28
递延所得税资产		净资产：	

其他资产	500.00	实收基金	14,490,120.00
		其他综合收益	
		未分配利润	1,142,196.97
		所有者权益合计	15,632,316.97
资产合计:	16,038,621.25	负债与净资产总计:	16,038,621.25

注：本报告期的基金财务会计报告经审计，注册会计师签字出具了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 2024 年 1 月 18 日进入清算期。

本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下按照财政部颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安德盛安心成长混合型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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。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，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

自 2024 年 1 月 18 日至 2024 年 2 月 6 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 本基金最后运作日货币资金余额为人民币 9,069,202.04 元，其中银行存款余额为人民币 9,066,438.46 元，应计利息余额为人民币 2,763.58 元。

清算期间银行存款净流入人民币 7,039,206.30 元，清算期间银行存款净流出人民币 211,591.84 元，于清算结束日银行存款余额为人民币 15,894,052.92 元。

清算期间计提银行存款利息人民币 2,271.27 元，于清算结束日银行存款应计利息余额为人民币 5,034.85 元。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 790.88 元，清算期间存出保证金账户净流出人民币 790.88 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 0.00 元。

最后运作日应计存出保证金利息余额为人民币 0.86 元，清算期间计提存出保证金利息人民币 0.60 元，于清算结束日应计存出保证金利息余额为人民币 1.46 元。

5.1.3 本基金最后运作日股票投资余额为 877,267.50 元，所有股票投资于清算期间处置

变现，于清算结束日股票投资余额为 0.00 元。

5.1.4 本基金最后运作日债券投资余额为 6,089,712.33 元，其中债券投资成本余额为 5,999,400.00 元，应计债券利息余额为 90,312.33 元。所有债券投资于清算期间处置变现，于清算结束日债券投资余额为 0.00 元，应计债券利息余额为 0.00 元。

5.1.5 本基金最后运作日应收申购款余额为 1,147.64 元，清算期间已全部结转，于清算结束日应收申购款余额为 0 元。

5.1.6 本基金最后运作日其他应收款余额为 500.00 元，于清算结束日其他应收款余额为 500 元。

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 7,778.18 元，清算期间已支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为 0.00 元。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,555.61 元，清算期间已支付，于清算结束日应付托管费余额为 0.00 元。

5.2.3 本基金最后运作日应付赎回款余额为 161,356.22 元，应付赎回费余额为 0.01 元，清算期间已全部支付，于清算结束日应付赎回款余额为 0 元，应付赎回费余额为 0 元。

5.2.4 本基金最后运作日应付审计费为人民币 40,000.00 元，清算期间已支付，于清算结束日应付审计费余额为 0.00 元。

5.2.5 本基金最后运作日应付税费余额为人民币 195,614.26 元，于清算结束日应付税费余额为人民币 195,614.26 元。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2024年01月18日(基金清算起始日)至2024年02月06日(基金清算结束日)止期间
一、资产处置损益	57,986.61
1.利息收入	2,271.87
其中：银行存款利息收入	2,271.27
2.投资收益（损失以“-”填列）	147,458.27
其中：股票投资收益	139,842.42
债券投资收益	7,615.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-91,743.53
4.其他收入（损失以“-”号填列）	0.00
二、清算费用	23.00
1.其他费用	23.00
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	57,963.61

注：此处的其他费用为银行汇划费。

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2024年01月17日基金净资产	15,632,316.97
加：清算期间净收益	57,963.61
加：因清算期间确认的交易份额产生的净值变动	318.41
二、2024年02月06日基金净资产	15,690,598.99

注：本基金最后运作日基金份额总额为 26,329,424.07 份，于清算期间确认的赎回申请份额为 0.00 份，转出申请份额为 0.00 份，申购申请份额为 536.04 份，转入申请份额为 0.00 份。截至清算结束日基金份额总额为 26,329,960.11 份。

资产处置及负债清偿后，截止至清算结束日本基金剩余财产为人民币 15,690,598.99 元，本基金实际可供分配的剩余财产为人民币 15,885,713.25 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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。本基金清算费用包括基金份额持有人大会费用、律师费等由国联安基金管理有限公司承担。

清算结束日 2024 年 2 月 6 日至预估清算款划出日(2024 年 3 月 31 日)前一日的银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有。截至清算结束日 2024 年 2 月 6 日前一日止的应收利息共计人民币 4,880.32 元，保证金余额人民币 1.46 元，基金管理人预估的自 2024 年 2 月 6 日起至 2024 年 3 月 31 日止期间的应收利息人民币 8,494.20 元，合计 13,375.98 元，已由基金管理人以自有资金垫付并已于 2024 年 2 月 6 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。

截至清算结束日 2024 年 2 月 6 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 15,894,052.92 元，其中人民币 13,375.98 元系基金管理人代垫的存出保证金以及以当前适用的利率预估的银行存款利息。

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、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金清算审计报告
- 2、关于《国联安德盛安心成长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

国联安德盛安心成长混合型证券投资基金 基金财产清算小组

2024年3月8日