

金元顺安核心动力混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：金元顺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

清算报告出具日：二〇一八年九月十九日

清算报告公告日：二〇一八年十一月十日

重要提示

金元顺安核心动力混合型证券投资基金（原名为：金元比联核心动力股票型证券投资基金，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[2009]1424号文《关于核准金元比联核心动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人金元比联基金管理有限公司（系金元顺安基金管理有限公司的前身）向社会公开发行募集，基金合同于2010年02月11日正式生效，首次设立募集规模为436,884,917.98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与注册登记机构均为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

经金元比联第二届董事会第七次会议及第二届股东会第五次会议审议通过，并由中国证监会证监许可[2012]276号文核准，金元比联基金管理有限公司于2012年03月15日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为金元惠理基金管理有限公司。随后，报请中国证监会同意，将金元比联核心动力股票型证券投资基金更名为金元惠理核心动力股票型证券投资基金，并于2012年05月02日公告。

2015年02月05日，经金元惠理基金管理有限公司股东金元证券股份有限公司及惠理基金管理香港有限公司以书面表决的方式达成更名决议。金元惠理基金管理有限公司于2015年03月06日完成相关工商变更登记手续，并且变更公司名称为金元顺安基金管理有限公司，并于2015年03月10日进行公告。经本基金管理人与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后，金元惠理核心动力股票型证券投资基金相应更名为金元顺安核心动力混合型证券投资基金，并于2015年07月15日进行公告。

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》、《金元顺安核心动力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，基金合同生效后，连续60个工作日出现若基金资产净值低于5,000万情形的，基金合同应当终止并按照约定进入清算程序，无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金管理人于2018年08月22日发布《关于金元顺安核心动力混合型证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》。根据公告，本基金最后运作日为2018年08月21日，自2018年08月22日起，本基金进入基金财产清算程序。

基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所成立基金财产清算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）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

一、基金概况

基金名称	金元顺安核心动力混合型证券投资基金
基金简称	金元顺安核心动力混合
基金主代码	620005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年02月11日
最后运作日（2018年08月21日）基金份额总额	36,823,746.99份
基金管理人	金元顺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
注册登记机构	金元顺安基金管理有限公司

二、财务会计报告

资产负债表

会计主体：金元顺安核心动力混合型证券投资基金

报告截止日：2018年08月21日

单位：人民币元

	最后运作日（2018年08月21日）
资产：	
银行存款	6,397,868.42
结算备付金	-
存出保证金	44,904.65
交易性金融资产	26,279,895.23
其中：股票投资	26,279,895.23
应收利息	7,508.21
应收申购款	3,351.55
资产总计	32,733,528.06
负债：	
应付赎回款	3,192.32
应付管理人报酬	15,735.14
应付托管费	4,917.21
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,099.07
应付利润	-
其他负债	155,296.66

负债合计	180,240.40
所有者权益：	
实收基金	36,823,746.99
未分配利润	-4,270,459.33
所有者权益合计	32,553,287.66
负债和所有者权益合计	32,733,528.06

注：

报告截止日 2018 年 08 月 21 日（本基金最后运作日），本基金基金份额净值为 0.884 元，本基金基金总份额为 36,823,746.99 份。

三、清算事项说明

（一）基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2009]1424号文核准，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自2010年01月13日至2010年02月08日期间向社会公开发行人募集。

本基金合同于2010年02月11日正式生效，首次设立募集规模为436,884,917.98份基金份额（含募集期间利息结转的份额）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为股票资产占基金资产的60%—95%。债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%—40%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

根据《金元顺安核心动力混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自2018年08月22日起，本基金进入清算程序。本基金进入清算程序后，不再办理申购、赎回等业务，同时不再收取基金管理费和基金托管费。

（二）清算原因

根据《基金合同》“第三部分 基金的历史沿革与存续”中，“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于人民币5,000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现基金份额持有人达不到200人，基金资产净值低于人民币5,000万元情形的，基金合同应当终止并按照约定进入清算程序，无需召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时，从其规定。”的条款以及《基金合同》“第十七部分

基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的有关规定，截至2018年08月21日，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元的情形，已触发《基金合同》中约定的本基金终止条款。根据《基金合同》有关规定，无需召开基金份额持有人大会，本基金将终止并依据基金财

产清算程序进行财产清算。

(三) 清算起始日

根据《金元顺安核心动力混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自2018年08月22日起，本基金进入清算程序。由于本基金持有的流通受限股票无法确定变现时间，本基金计划将进行多次清算，其中第一次清算期间为2018年08月22日至2018年09月12日，第二次及后续清算期间将根据流通受限股票的变现时间确定。

(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。自本基金终止日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表为截至本基金终止日的资产负债表，并无比较期间的相关数据列示。

四、清算情况

自 2018 年 08 月 22 日至 2018 年 09 月 12 日止的清算期间，本基金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。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

（一）资产处置情况

1、本基金最后运作日存出保证金人民币 44,904.65 元,该款项已于 2018 年 09 月 04 日划入托管户。

2、本基金最后运作日交易性金融资产人民币 26,279,895.23 元，该金额为各只股票的最后运作日估值金额之和。其中，非停牌股票资产为人民币 20,276,501.69 元（单只非停牌股票最后运作日估值金额=该只股票的最后运作日收盘价×股票数量），停牌股票资产为人民币 6,003,393.54 元（单只停牌股票最后运作日估值金额=该只停牌股票的停牌价格或按指数估值法计算价格×股票数量）。具体情况如下：

（1）非停牌股票处置情况：

本基金最后运作日持有的全部非停牌股票已分别于 2018 年 08 月 24 日、08 月 27 日、08 月 28 日、08 月 29 日和 08 月 30 日卖出，卖出所得金额共计人民币 20,283,677.83 元。

（2）停牌股票处置情况：

本基金最后运作日（2018 年 08 月 21 日）持有的全部停牌股票明细如下：

单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	最后运作日估值单价	数量 (单位： 股)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大资产重组	15.12	377,700.00	7,998,090.18	5,710,824.00
002739	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	22.91	8,850.00	361,304.36	202,753.50

600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59	6,156.00	122,695.00	89,816.04
--------	------	------------	--------	-------	----------	------------	-----------

注：

根据《基金合同》第十二部分“基金资产估值”的约定，交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；交易所上市的有价证券估值日无市价，但最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

流通受限证券经纬纺机（000666）最后运作日的估值单价按照指数收益法进行计算，具体可查阅《金元顺安基金管理有限公司关于旗下产品持有的“经纬纺机”股票估值调整情况的说明》；

流通受限证券万达电影（002739）最后运作日的估值单价按照指数收益法进行计算，具体可查阅《金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的“万达电影”股票估值调整情况的公告》；

流通受限证券信威集团（002507）最后运作日的估值单价为停牌前一交易日的收盘价。

待停牌股票复牌后，基金管理人将及时变现停牌股票，并于再次清算时再向基金份额持有人分配。截至 2018 年 09 月 12 日，本基金持有停牌股票尚未复牌。

3、本基金最后运作日应收利息人民币 7,508.21 元，包括应收银行存款利息人民币 6,960.24 元、应收结算备付金利息人民币 423.42 元、应收存出保证金利息人民币 124.55 元。截至 2018 年 09 月 12 日，应收活期存款利息余额为人民币 16,013.29 元，应收清算备付金利息余额为人民币 423.42 元，应收结算保证金利息余额为人民币 152.97 元，上述款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

（二）负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款人民币 3,192.32 元，该款项已于 2018 年 08 月 22 日和 2018 年 08 月 23 日支付。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 15,735.14 元，该款项已于 2018 年 09 月 04 日支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,917.21 元，该款项已于 2018 年 09 月 04 日支付。

4、本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,099.07 元，该款项将于第一次清算结束后支付。

5、本基金最后运作日的其他负债为人民币 155,296.66 元,包括包括应付信息披露费人民币 110,795.52 元、应付赎回费人民币 1.14 元、应付审计和律师费用人民币 40,000.00 元、应付中债账户维护费人民币 4,500.00 元。其中，应付赎回费人民币 1.14 元已于 2018 年 08 月 24 日支付；应付审计费用人民币 20,000.00 元已于 2018 年 09 月 04 日支付；应付信息披露费人民币 110,795.52 元、应付律师费用人民币 20,000.00 元、应付中债账户维护费人民币 4,500.00 元将于第一次清算结束后支付。

(三) 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2018 年 08 月 22 日至 2018 年 09 月 12 日止清算期间
1、清算收益	
利息收入	70,745.47
股票变现损益	73,636.53
停牌股票公允价值变动损益	-252,496.50
赎回费收入	3.31
清算收入小计	-108,111.19
2、清算费用	
交易费用	41,003.61
股息红利税	55,566.02
银行划款手续费	29.00
清算费用小计	96,598.63
3、清算净损益	-204,709.82

注：

1、利息收入系计提的自 2018 年 08 月 22 日至 2018 年 09 月 12 日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息及实际收到的直销申购款利息；

2、股票变现损益为本次清算期间处置股票的卖出所得与其最后运作日估值金额的差额；

3、停牌股票公允价值变动损益为按照指数估值法本次清算期末与其最后运作日估值金额的差额。

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 2018 年 08 月 21 日基金净资产	32,553,287.66
加：清算期间净损益	-204,709.82
加：清算期间收到申购款	6,300.06
减：清算期间支付赎回、转出款	881.00
二、2018 年 09 月 12 日基金净资产	32,353,996.90

根据本基金的《基金合同》及《关于金元顺安核心动力混合型证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》的约定，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。

2018 年 09 月 12 日本基金剩余财产为人民币 32,353,996.90 元，其中包括交易性金融资产人民币 5,750,897.04 元（该金额为停牌股票的停牌时市值或在清算期末按指数估值法计算金额，与停牌股票资产复牌后实际变现金额可能存在差异）。上述剩余未变现的资产将根据变现情况在第二次及后续清算期间按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至清算款划出日前一日银行存款产生的利息，该期间利息亦属全体份额持有人所有，将于清算结束日净资产合计按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

七、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《金元顺安核心动力混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《金元顺安核心动力混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》

（二）存放地点

基金管理人的办公场所：中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

存放网址：www.jysa99.com

（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。

咨询电话：400-666-0666、021-68881898

金元顺安核心动力混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一八年十一月十日