

国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告出具的时间：2019年2月28日

报告公告的时间：2019年4月2日

1 重要提示

国都聚鑫定期开放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”）《关于准予国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2725号文）批准，由国都证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年12月21日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为397,208,118.04份基金份额。本基金的基金管理人为国都证券股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《国都聚鑫定期开放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”）的约定：“基金合同生效后，在任一开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止：

（1）基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于5000万元。

（2）基金份额持有人人数少于200人。”

因此本基金根据基金合同约定进入基金财产清算程序，而不需召开基金份额持有人大会。

基金管理人于2019年1月29日发布了《关于国都聚鑫定期开放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》，本基金于该日进入清算程序。

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金财产清算小组由基金管理人国都证券股份有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、中准会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成，并于2019年1月29日成立。其中，基金管理人的授权代表为薛志宏、赵楠、王实；基金托管人的授权代表为陈心心、曾燕；中准会计师事务所会计师为田雍、王健；上海市通力律师事务所律师为黎明、陆奇。

本基金财产清算小组根据相关法律法规履行清算程序。本基金清算期结束日为2019年2月28日。

2 基金产品概况

基金名称 国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金

基金简称 国都聚鑫定期开放

基金主代码 003856

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年12月21日

运作期末基金份额总额 260,652.98份

投资目标 在谨慎投资的前提下，本基金力争超越业绩比较基准，追求基金资产的稳健增值。

投资策略

1、资产配置策略。

本基金跟踪和分析宏观经济数据，通过定性与定量分析，对经济形势及未来发展趋势进行判断，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。

2、债券投资策略

本基金将在保持组合低波动性的前提下，运用多种积极管理增值策略，追求资本金保值的同时，持续性地以绝对正回报的方式实现增值。以久期策略和杠杆策略作为债券投资的基本策略，将债券组合久期与封闭期相匹配，在资金相对充裕的情况下，使用基础组合持有的债券进行回购放大融入短期资金滚动操作，获取超额稳定收益。同时，基金将辅以积极地增值策略，包括并不限于收益率曲线策略、债券类属配置策略、骑乘策略、相对价值策略、信用利差策略等，在谨慎投资的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

可转债投资策略：可转债不同于一般的企业债券，其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利，因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本基金投资于可转债，主要目标是降低基金净值的下行风险，基金投资的可转债可以转股，以保留参与股票升值的收益潜力。

3、股票投资策略

本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资。基金管理人在行业分析的基础上，选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景或价值被低估的上市公司股票，以合理价格买入并进行中长期投资。本基金股票投资具体包括行业分析与配置、公司财务状况评价、价值评估及股票选择与组合优化等过程。

本基金将对业绩增长平稳、股息率持续较高、现金流充裕的股票进重点筛选和行配置，在控制风险的前提下力求获取绝对收益。

4、股指期货投资策略

本基金的股指期货投资以对冲系统性风险为目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，优化资产配置，谨慎投资，以降低投资组合的整体风险，达到套期保值的目标。

5、国债期货投资策略

本基金在综合分析经济基本面、资金面和政策面的基础上，结合组合内各利率债持仓结构的基础上，按照“利率风险评估一套期保值比例计算一保证金、期现价格变化等风险控制”的流程，构建并实时调整利率债的套期保值组合。同时，结合套利策略和投机策略等多种交易策略，优化资产配置，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

6、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

7、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险、平滑收益、锁定利润为主要目的。本基金通过对权证标的的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑其的流动性，谨慎投资。

8、开放期投资策略

本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。

业绩比较基准 中国债券总指数收益率×60%+沪深 300 指数收益率×40%

风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。

基金管理人 国都证券股份有限公司

基金托管人 兴业银行股份有限公司

3 基金运作情况概述

国都聚鑫定期开放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”）《关于准予国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2725 号文）批准，由国都证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2016 年 12 月 21 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 397,208,118.04 份基金份额。2016 年 12 月 21 日至 2019 年 1 月 28 日期间，本基金按基金合同正常运作。

4 财务报表

4.1 资产负债表

会计主体：国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 1 月 28 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产 最后运作日

2019 年 1 月 28 日

资产：

银行存款 241,235.68

结算备付金

存出保证金 32,171.25

交易性金融资产

其中：股票投资

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 158,909.78

应收股利

应收申购款

其他资产

资产合计：432,316.71

负债和所有者权益

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 18,744.34
应付托管费 5,154.71
应付销售服务费
应付交易费用
应付税费
应付利息
应付利润
其他负债 132,709.84
负债合计 156,608.89
所有者权益：
实收基金 260,652.98
未分配利润 15,054.84
所有者权益合计 275,707.82

4.2 利润表

会计主体：国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年1月28日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目 本期

2019年1月1日至2019年1月28日

一、收入 63,087.85

1.利息收入 63,087.85

其中：存款利息收入 31,415.83

债券利息收入

资产支持证券利息收入

买入返售金融资产收入 31,672.02

2.投资收益（损失以“-”填列）

其中：股票投资收益

基金投资收益

债券投资收益

资产支持证券投资收益

贵金属投资收益

衍生工具收益

股利收益

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）

4.其他收入（损失以“-”号填列）

减：二、费用 27,938.89

1. 管理人报酬 18,744.34

2. 托管费 5,154.71

3. 销售服务费

4. 交易费用

5. 利息支出

其中：卖出回购金融资产支出

6.税金及附加

7.其他费用 4,039.84

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） 35,148.96

减：所得税费用

四、净利润（净亏损以“-”号填列） 35,148.96

注：本报告期的基金财务会计报告经中准会计师事务所审计，注册会计师田雍、王健签字出具了中准专字[2019]1005号标准无保留意见的审计报告。

5 基金财产分配

本基金于 2019 年 1 月 29 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 2019 年 1 月 29 日至 2019 年 2 月 28 日的清算期间，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 241,235.68 元，清算期间银行存款净流出人民币 151,726.32 元，于清算期结束日银行存款余额为人民币 89,509.36 元。

5.1.2 本基金最后运作日 2019 年 1 月 28 日应收利息余额为人民币 158,909.78 元；清算期间计提应收债券利息人民币 0.00 元、应收银行存款利息人民币 264.49 元、应收结算备付金利息人民币 0.00 元、应收存出保证金利息人民币 39.37 元、应收买入返售金融资产利息人民币 0.00 元；收到债券利息人民币 0.00 元、买入返售金融资产利息人民币 0.00 元；清算期结束日应收利息余额为人民币 159,213.64 元，该款项由基金管理人以自有资金垫付，并划入托管账户。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.本基金最后运作日交易型金融资产为 0.00 元，其中股票投资 0.00 元,债券投资为 0.00 元。

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 0.00 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 18,744.34 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 5,154.71 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 0.00 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 132,709.84 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

项目 2019 年 1 月 29 日(基金开始清算日)至
2019 年 2 月 28 日(基金结束清算日)期间

一、资产处置损益 303.86

1.利息收入 303.86

其中：存款利息收入 264.49

债券利息收入

结算备付金利息收入

存出保证金利息收入 39.37

买入返售金融资产利息收入

2. 投资收益（损失以“-”填列）

其中：股票投资收益

债券投资收益

股利收入

3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）

二、清算费用 2,045.16

1. 交易费用

2. 利息支出

其中：卖出回购金融资产支出

3. 其他费用 2,045.16

三、清算净损益（净亏损以“-”号填列） -1,741.30

注：此处的其他费用包括银行间账户维护费、银行间账户查询服务费和划款手续费。

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 2019 年 1 月 28 日基金净资产 275,707.82

加：清算期间净收益 -1,741.30

加：基金最后运作日客户赎回申请 -10.47

二、清算期结束日 2019 年 2 月 28 日基金净资产 273,956.05

注：2019 年 1 月 28 日（基金最后运作日）本基金收到客户赎回申请，赎回份额为 9.90 份，赎回申请日单位净值为 1.0578；2019 年 1 月 30 日，本基金划付 10.47 元至客户账户。

资产处置及负债清偿后，本基金清算期结束日 2019 年 2 月 28 日的剩余财产为人民币为 273,945.03 元。自清算期结束日次日 2019 年 3 月 1 日起至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息属份额持有人所有，由基金管理人以自有资金垫付并划入托管账户。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。

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。后续由于清算支付过程中所产生的划款手续费由剩余资产承担。

5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金管理人审核、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、国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金财务报表及审计报告

2、关于《国都聚鑫定期开放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，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人客服热线 400-818-8118。

国都聚鑫定期开放混合型证券投资基金基金财产清算小组

2019 年 2 月 28 日