

# 工银瑞信聚盈混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

清算报告出具日：二零一九年十一月十八日

清算报告公告日：二零一九年十二月十三日

## §1 重要提示及目录

### §1.1 重要提示

工银瑞信聚盈混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予工银瑞信聚盈混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1895号文）准予注册募集，自2019年1月24日成立并正式运作。

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》、《工银瑞信聚盈混合型证券投资基金基金合同》（以下或简称《基金合同》）的有关规定，《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5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人在履行一定程序后终止基金合同并进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会审议。鉴于自《基金合同》生效后，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，无需召开基金份额持有人大会，本基金管理人应终止本基金合同并依法履行基金财产清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见基金管理人于2019年11月1日在中国证监会指定报刊及公司网站上发布的《关于工银瑞信聚盈混合型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》。

本基金自2019年11月1日起进入清算期，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司、基金托管人中国光大银行股份有限公司、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基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，由上海市通力律师事务所对本基金清算事宜出具法律意见书。

## §1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
§1.1 重要提示.....	2
§1.2 目录.....	3
<b>§2 基金产品概况</b> .....	<b>4</b>
<b>§3 基金运作情况</b> .....	<b>4</b>
<b>§4 财务会计报告（经审计）</b> .....	<b>5</b>
<b>§5 清盘事项说明</b> .....	<b>6</b>
§5.1 清算费用.....	6
§5.2 资产处置情况.....	6
§5.3 负债清偿情况.....	7
§5.4 清算期间的剩余资产分配情况.....	7
§5.5 基金财产清算报告的告知安排.....	8
<b>§6 备查文件目录</b> .....	<b>9</b>
§6.1 备查文件目录.....	9
§6.2 存放地点.....	9
§6.3 查阅方式.....	9

## §2 基金产品概况

基金名称	工银瑞信聚盈混合型证券投资基金
基金简称	工银聚盈混合
基金代码	006709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年1月24日
最后运作日（2019年10月31日）基金份额总额	33,060,961.86份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化，根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，执行“自上而下”的资产配置及动态调整策略。在市场上涨阶段中，增加权益类资产配置比例；在市场下行周期中，增加非权益类资产配置比例，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。 本基金可能投资港股通投资标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

## §3 基金运作情况

工银瑞信聚盈混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予工银瑞信聚盈混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1895号文）准予注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2018年12月24日至2019年1月18日期间向社会公开募集，基金合同于2019年1月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为250,790,838.42份（含募集期间利息结转的份额）。

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》、《工银瑞

信聚盈混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,《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 5,000 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 60 个工作日出现前述情形的,基金管理人在履行一定程序后终止基金合同并进入基金财产清算程序,无需召开基金份额持有人大会审议。鉴于自基金合同生效后,本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形,为维护基金份额持有人利益,根据《基金合同》约定,无需召开基金份额持有人大会,本基金管理人应终止本基金合同并依法履行基金财产清算程序。本基金最后运作日为 2019 年 10 月 31 日,自 2019 年 11 月 1 日起进入清算期。

## §4 财务会计报告（经审计）

基金最后运作日资产负债表

会计主体：工银瑞信聚盈混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 10 月 31 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 10 月 31 日（基金最后运作日）
<b>资 产：</b>	
银行存款	37,028,148.05
结算备付金	346,871.27
存出保证金	99,257.47
交易性金融资产	1,207,506.00
其中：股票投资	7,626.00
债券投资	1,199,880.00
买入返售金融资产	15,000,000.00
应收利息	32,355.64
资产总计	53,714,138.43
负债和所有者权益	本期末 2019 年 10 月 31 日（基金最后运作日）
<b>负 债：</b>	
应付证券清算款	15,000,000.07
应付赎回款	4,208,811.80
应付管理人报酬	28,215.30
应付托管费	7,053.80
应付销售服务费	15,268.63
应付交易费用	5,030.49
应付税费	332.65

其他负债	97,559.55
负债合计	19,362,272.29
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	33,060,961.86
未分配利润	1,290,904.28
所有者权益合计	34,351,866.14
负债和所有者权益总计	53,714,138.43

注：1、报告截止日 2019 年 10 月 31 日(基金最后运作日)，基金份额总额为 33,060,961.86 份，其中 A 类基金份额净值为人民币 1.0437 元，份额总额为 9,071,753.07 份；C 类基金份额净值为人民币 1.0373 元，份额总额为 23,989,208.79 份。

2、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。

## §5 清盘事项说明

自 2019 年 11 月 1 日至 2019 年 11 月 18 日止为清算期间。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 清算费用

按照《工银瑞信聚盈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剩余财产中支付。

### §5.2 资产处置情况

本基金最后运作日持有的股票投资估值金额为人民币 7,626.00 元，已于清算期间全部卖出。

本基金最后运作日持有的债券投资估值金额为人民币 1,199,880.00 元，已于清算期间全部兑付。

本基金最后运作日持有的买入返售金融资产共计人民币 15,000,000.00 元，已于 2019 年 11 月 1 日到期。

本基金最后运作日应收利息人民币 32,355.64 元，其中应收银行存款利息人民币 4,543.92

元、应收清算备付金利息人民币 105.27 元、应收交易保证金利息人民币 24.78 元，该部分利息于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该款项；应收债券利息为 27,681.67 元，已于清算期间全部到账。

### §5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日的应收证券清算款金额为人民币 15,000,000.07，已于 11 月 1 日支付。

本基金最后运作日应付赎回款人民币 4,208,811.80 元，已于 2019 年 11 月 1 日、4 日、5 日支付。

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 28,215.30 元，该款项将于清算资产支付日后支付给管理人。

本基金最后运作日应付托管费为人民币 7,053.80 元，该款项已于 2019 年 11 月 5 日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 15,268.63 元，该款项已于 2019 年 11 月 5 日支付。

本基金最后运作日应付交易费用共计人民币 5,030.49 元，将于清算资产支付日前支付。

本基金最后运作日应付税费人民币 332.65 元，将于清算资产支付日前支付。

本基金最后运作日其他负债为人民币 97,559.55 元，为预提审计费、预提信息披露费、预提中债登账户维护费、预提上清所账户维护费及应付赎回费。其中预提审计费为人民币 40,000.00 元，该款项预计将于收到会计师事务所付款通知书及发票起五日内支付；预提信息披露费为人民币 50,000.00 元，该款项将于清算资产支付日前支付；预提中债登账户维护费为人民币 1,564.20 元，该款项已于 2019 年 11 月 12 日支付；预提上清所账户维护费为人民币 1,668.50 元，该款项已于 2019 年 11 月 12 日支付；应付赎回费为人民币 4,326.85 元，该款项已于 2019 年 11 月 1 日、4 日、5 日支付。

### §5.4 清算期间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 10 月 31 日基金净资产	34,351,866.14
加：清算期间（2019-11-1 至 2019-11-18）收入	
利息收入（注 1）	17,477.32
变现损益（注 2）	-1,267.46
公允价值变动损益	1,448.37

赎回费收入	3,278.68
减：清算期间（2019-11-1 至 2019-11-18）费用	
清算费用（注3）	2,995.95
减：清算期间（2019-11-1 至 2019-11-18）基金赎回产生的基金净值变动数（注4）	21,117,401.03
二、2019年11月18日（清算报告出具日）基金净资产（注5）	13,252,406.07

注：1、利息收入中 5,796.87 元系以当前适用的利率预估计提的自 2019 年 11 月 1 日至 2019 年 11 月 18 日止清算期间的银行存款利息；利息收入中 428.28 元系以当前适用的利率计提的自 2019 年 11 月 1 日至 2019 年 11 月 18 日止清算期间的备付金利息；利息收入中 13.17 元系以当前适用的利率计提的自 2019 年 11 月 1 日至 2019 年 11 月 18 日止清算期间的保证金利息；利息收入中 7,959.55 元系清算期间持有的债券投资利息；利息收入中 3,279.45 元系清算期间持有买入返售金融资产利息。

2、变现损益为本次清算期间扣除交易费用后的证券投资变现金额与证券投资最后运作日估值金额的差额。

3、清算费用中 1,531.50 元系清盘期间计提的上交所账户维护费；清算费用中 1,435.80 元系清盘期间计提的中债登账户维护费；清算费用中 28.65 元系应付税费。

4、清算期间基金赎回及转出产生的基金净值变动数为 2019 年 11 月 1 日赎回及转出确认产生的基金净值变动数。

5、资产处置及负债清偿后，于 2019 年 11 月 18 日本基金剩余财产为人民币 13,252,406.07 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。

2019 年 11 月 19 日至资产支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

## §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 备查文件目录

### §6.1 备查文件目录

- 1、《工银瑞信聚盈混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《通力律师事务所关于〈工银瑞信聚盈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、基金托管人处。

### §6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。

工银瑞信聚盈混合型证券投资基金基金财产清算小组

2019年11月18日