

国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日：二零二六年九月二十四日

§ 1 重要提示

国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金（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”）《关于准予国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]2005 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《国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券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 2021 年 12 月 9 日生效。本基金为契约型、定期开放式基金，存续期限为不定期。首次设立募集规模为 4,000,013,954.57 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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 2026 年 8 月 10 日表决通过了《关于终止国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自 2026 年 8 月 11 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 2026 年 8 月 11 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、基金托管人兴业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（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、石琬如；基金托管人的授权代表为陆小石、钱璐；安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）中国注册会计师为费泽旭、骆文慧；上海市通力律师事务所律师为陆奇、狄家璐。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国联安恒鑫 3 个月定开债券
基金主代码	012807
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 9 日
基金最后运作日（2026 年 8 月 10 日）基金份额总额	10,131,396.44 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 1、封闭期投资策略 本基金通过宏观周期研究、行业周期研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在类属资产配置、行业配置

	结构上的比例；根据收益率、市场流动性、信用风险利差等因素，在国债、金融债、信用债等债券类别间进行债券类属资产配置；对未来市场利率趋势进行分析与预测，并据此确定合理的债券组合目标久期，通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。 2、开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金经中国证监会《关于准予国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]2005 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 2021 年 12 月 9 日生效。本基金为契约型、定期开放式基金，存续期限为不定期。首次设立募集规模为 4,000,013,954.57 份基金份额。2021 年 12 月 9 日至 2026 年 8 月 10 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 2026 年 8 月 10 日表决通过了《关于终止国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自 2026 年 8 月 11 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：国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 8 月 10 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产：		负 债：	
货币资金	201,750.84	短期借款	
结算备付金	16,530.87	交易性金融负债	
存出保证金	85.25	衍生金融负债	

交易性金融资产	3,690,230.55	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付清算款	
债券投资	3,690,230.55	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	965.97
基金投资		应付托管费	257.59
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	37.48
买入返售金融资产	800,089.23	应付利润	
应收清算款	5,978,764.72	递延所得税负债	
应收股利		其他负债	
应收申购款		负债合计	1,261.04
递延所得税资产		净资产：	
其他资产		实收基金	10,131,396.44
		其他综合收益	
		未分配利润	554,793.98
		净资产合计	10,686,190.42
资产合计：	10,687,451.46	负债与净资产总计：	10,687,451.46

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 2026 年 8 月 11 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参考财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。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，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

自 2026 年 8 月 11 日至 2026 年 8 月 21 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 201,750.84 元，其中本金为人民币 201,654.78 元，应计利息为人民币 96.06 元。

清算期间货币资金净流入为人民币 10,494,841.74 元，清算期间货币资金净流出为人民币 1,265.12 元，清算期间计提货币资金利息为人民币 1,073.48 元。于清算结束日货币资金余额为人民币 10,696,400.94 元，其中本金为人民币 10,695,231.40 元，应计利息为人民币

1,169.54 元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 16,530.87 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金本金为人民币 16,521.74 元，应计结算备付金利息为人民币 9.13 元。

清算期间结算备付金净流出为人民币 0.00 元，清算期间计提结算备付金利息为人民币 1.76 元。于清算结束日结算备付金余额为人民币 16,532.63 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金本金为人民币 16,521.74 元，应计结算备付金利息为人民币 10.89 元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 85.25 元，其中本金为人民币 85.25 元，应计利息为人民币 0.00 元。

清算期间存出保证金净流出为人民币 0.00 元，清算期间计提存出保证金利息为人民币 0.00 元。于清算结束日存出保证金余额为人民币 85.25 元，其中本金为人民币 85.25 元，应计利息为人民币 0.00 元。

5.1.4 本基金最后运作日债券投资余额为人民币 3,690,230.55 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人民币 0.00 元。

5.1.5 本基金最后运作日买入返售金融资产投资余额为人民币 800,089.23 元，所有买入返售金融资产投资于清算期间处置变现，于清算结束日买入返售金融资产投资余额为人民币 0.00 元。

5.1.6 本基金最后运作日应收清算款余额为人民币 5,978,764.72 元，所有应收清算款于清算期间划入托管账户，于清算结束日应收清算款余额为人民币 0.00 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 965.97 元，清算期间已支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为人民币 0.00 元。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 257.59 元，清算期间已支付，于清算结束日应付托管费余额为人民币 0.00 元。

5.2.3 本基金最后运作日应交税费余额为人民币 37.48 元，清算期间已支付，于清算结束日应交税费余额为人民币 0.00 元。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2026 年 8 月 11 日(基金清算起始日)至 2026
----	--------------------------------

	年 8 月 21 日(基金清算结束日)止期间
一、资产处置损益	1,828.84
1.利息收入	1,197.17
其中：银行存款利息收入	1,073.48
结算备付金利息收入	1.76
保证金利息收入	
买入返售金融资产利息收入	121.93
2.投资收益（损失以“-”填列）	-66,753.60
其中：股票投资收益	
债券投资收益	-66,753.60
股利收益	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	67,385.27
4.其他收入（损失以“-”号填列）	
二、清算费用	0.44
1.其他费用	
2.税金及附加	0.44
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	1,828.40

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2026年8月10日基金净资产	10,686,190.42
加：清算期间净收益	1,828.40
加：因清算期间确认的交易份额产生的净值变动	
二、2026年8月21日基金净资产	10,688,018.82

注：本基金最后运作日基金份额总额为 10,131,396.44 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 0.00 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 10,131,396.44 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 10,688,018.82 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后，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。

2026 年 8 月 22 日至清算划款日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属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，基金管理人已先行垫付尚未收回的最低结算备付金及其应计利息、存出保证金及其应计利息和应计银行存款

利息供清盘分配使用，基金管理人垫付资金自清算划款日至销户日孳生的利息归基金管理人所有。

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、国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金清算审计报告
- 2、关于《国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券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

国联安恒鑫 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金 基金财产清算小组

2026 年 9 月 18 日