

国联安信心增益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:中信银行股份有限公司
报告送出日:二零二二年二月八日

§ 1 重要提示

国联安信心增益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”)《关于核准国联安信心增益债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]528号文)批准,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《国联安信心增益债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2010年6月22日生效。本基金为契约型,基金合同生效后一年内封闭运作,基金合同生效满一年后转为开放运作,存续期限为不定期。首次设立募集规模为1,903,098,428.33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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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《国联安信心增益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的约定,并经基金份额持有人大会于2021年12月28日表决通过了《关于终止国联安信心增益债券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公告之日即2021年12月29日起,本基金进入财产清算程序。

根据上述法律法规的规定及《基金合同》的约定,本基金财产清算小组于2021年12月29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、基金托管人中信银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所(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、吴有生;基金托管人的授权代表为刘晓桐、刘碧茜;毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)会计师为张楠、钱茹雯;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	国联安信心增益债券
基金主代码	253030
交易代码	253030
基金运作方式	契约型。基金合同生效后一年内封闭运作,基金合同生效满一年后转为开放运作。
基金合同生效日	2010年6月22日
报告期末基金份额总额	38,436,123.46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	本基金在综合考虑基金组合的流动性需求、本金安全和投资风险控制的基础上,根据对宏观经济、货币政策、财政政策以及债券市场和股票市场相对投资价值和风险的分析,在法规及基金合同规定的比例限制内,动态调整现金类资产、债券类资产和权益类资产的比例,追求较低风险下的较高组合收益。 本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,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	中信银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

国联安信心增益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”)《关于核准国联安信心增益债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]528号文)批准,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《国联安信心增益债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2010年6月22日生效。本基金为契约型,基金合同生效后一年内封闭运作,基金合同生效满一年后转为开放运作,存续期限不定。首次设立募集规模为1,903,098,428.33份基金份额。2010年6月22日至2021年12月28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《国联安信心增益债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的约定,并经基金份额持有人大会于2021年12月28日表决通过了《关于终止国联安信心增益债券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公告之日即2021年12月29日起,本基金进入财产清算程序。

§ 4 财务报表

4.1 资产负债表

会计主体:国联安信心增益债券型证券投资基金
报告截止日:2021年12月28日(基金最后运作日)

单位:人民币元

资产:		负债:	
银行存款	35,176,822.77	短期借款	
结算备付金	66,937.56	交易性金融负债	
存出保证金	2,875.30	衍生金融负债	
交易性金融资产		卖出回购金融资产款	
其中:股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	1,979.74
资产支持证券投资		应付管理人报酬	27,928.59
基金投资		应付托管费	7,979.58
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款	11,970,485.11	应付税费	1,226,187.14
应收利息	1,314.44	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款	209.91	其他负债	121,314.50
其他资产		负债合计	1,385,389.55
		所有者权益:	
		实收基金	38,436,123.46
		未分配利润	7,397,132.08
		所有者权益合计	45,833,255.54
资产合计:	47,218,645.09	负债与持有人权益总计:	47,218,645.09

4.2 利润表

会计主体:国联安信心增益债券型证券投资基金
本报告期:2021年1月1日至2021年12月28日(基金最后运作日)

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月28日(基金最后运作日)
一、收入	1,817,674.20
1、利息收入	1,663,982.03
其中:存款利息收入	16,385.56
债券利息收入	1,633,922.44
资产支持证券利息收入	
买入返售金融资产收入	
2、投资收益(损失以“-”填列)	13,674.03
其中:股票投资收益	
债券投资收益	-17,288.41
资产支持证券投资收益	
基金投资收益	
权证投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	162,668.52
4、其他收入(损失以“-”填列)	8,312.06
减:二、费用	570,115.96
1、管理人报酬	316,443.88
2、托管费	90,412.54
3、销售服务费	
4、交易费用	319.57
5、利息支出	121.23
其中:卖出回购金融资产支出	121.23
6、税金及附加	3,366.22
7、其他费用	159,452.52
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	1,247,558.24
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”填列)	1,247,558.24

注:本报告期的基金财务会计报告经毕马威华振会计师事务所审计,注册会计师张楠、钱茹雯签字出具了毕马威华振审字第2200273号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2021年12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。由于报告性业务所致,本清算报表并无比较期间的数据列示。

自2021年12月29日至2022年1月19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本基金最后运作日银行存款余额为人民币35,176,822.77元,清算期间银行存款净流出人民币17,544,915.86元,于清算结束日银行存款余额为人民币17,631,906.91元。

5.1.2本基金最后运作日结算备付金余额为人民币66,937.56元,其中人民币66,937.56元已由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户,于清算结束日结算备付金余额为人民币0.00元。

5.1.3本基金最后运作日存出保证金余额为人民币2,875.30元,清算期间存出保证金账户净流入人民币3,153.82元,于清算结束日存出保证金余额为人民币6,029.12元。

5.1.4本基金最后运作日应收证券清算款余额为人民币11,970,485.11元,已于清算期间划入托管账户,于清算结束日应收证券清算款余额为人民币0.00元。

5.1.5本基金最后运作日应收申购款余额为人民币209.91元,清算期间计提应收申购款人民币1,998.40元,已于清算期间划入托管账户,于清算结束日其他资产余额为人民币0.00元。

5.1.6本基金最后运作日应收利息余额为人民币1,314.44元,清算期间计提应收银行存款利息人民币8,743.95元、计提结算备付金利息人民币21.07元、计提存出保证金利息人民币5.04元,于清算结束日应收利息(包括银行存款、备付金、保证金应收利息)余额为人民币10,084.50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27,928.59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。

5.2.2本基金最后运作日应付托管费为人民币7,979.58元,均于清算期间支付,于清算结束日应付托管费余额为零。

5.2.3本基金最后运作日应付税费为人民币1,226,187.14元,于清算期间转存公司清算户待日后缴付,于清算结束日应付税费余额为零。

5.2.4本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币1,979.74元,于清算期间计提应付赎回款人民币28,217,143.37元,均于清算期间支付,于清算结束日应付赎回款余额为人民币0.00元。

5.2.5本基金最后运作日其他负债为人民币123,294.24元,于清算期间计提其他负债人民币8,685.50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

单位:人民币元

项目	2021年12月29日(基金开始清算日)至2022年1月19日(基金结束清算日)止期间
一、资产处置损益	8,770.96
1.利息收入	8,770.06
其中:存款利息收入	8,770.06
债券利息收入	
2.投资收益(损失以“-”填列)	
其中:债券投资收益	
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)	0.90
二、清算费用	9,062.64
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	9,062.64
三、清算净损益(净亏损以“-”号填列)	-291.68

注:此处的其他费用为银行划款手续费、审计费、信息披露费。

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2021年12月28日基金净资产	45,833,255.54
加:清算期间净收益	-291.68
减:因清算期间确认的交易份额产生的净值变动	-28,215,145.87
二、2022年1月19日基金净资产	17,617,817.99

注:本基金最后运作日基金份额总额为38,436,123.46份,于清算期间确认的赎回申请份额为83.73份,转出申请份额为23,662,091.81份,申购申请份额为1,675.81份。截至清算结束日基金份额总额为14,775,623.73份。

资产处置及负债清偿后,本基金截止至清算结束日本基金剩余财产为人民币17,631,906.91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。本基金清算费包括持有人大会费用、律师费等由国联安基金管理有限公司承担。

清算结束日2022年1月19日至清算款划出日前一日(预估为2022年2月28日)的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。截至清算结束日2022年1月19日止的应收利息共计人民币10,084.50元,保证金余额人民币6,029.12元,基金管理人预估的自2022年1月19日起至2022年2月28日止期间的应收利息人民币14,088.92元,均由基金管理人以自有资金垫付并已于2022年1月19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2022年1月19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17,631,906.91元,其中人民币30,202.54元系基金管理人代垫的截至2022年2月28日的应收利息以及保证金余额。

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、国联安信心增益债券型证券投资基金自2021年1月1日至2021年12月28日(基金最后运作日)止期间财务报表及审计报告
- 2、《国联安信心增益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