

国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中 基金 (FOF) 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日：二零二二年五月三十日

§ 1 重要提示

国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)(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”)《关于准予国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》(证监许可[2018]2195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《国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》发售,基金合同于2019年4月26日生效。本基金为契约型开放式基金,对于每份基金份额,自基金合同生效日(含)(对于认购份额而言)起或自基金份额申购确认日(含)(对于申购份额而言)起满1年(1年按365天计算)之日为最短持有期,每份基金份额的最短持有期内,基金份额持有人不能提出赎回申请,每份基金份额的最短持有期到期日的下一工作日(含)起,基金份额持有人可提出赎回申请,存续期限为不定期。首次设立募集规模为347,217,695.51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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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《国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)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2022年4月22日表决通过了《关于终止国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)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2022年4月25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2022年4月25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、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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。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程芃钧、王依初;普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)会计师为魏佳亮、郭劲扬;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	国联安安享稳健养老一年持有混合(FOF)
基金主代码	006918

交易代码	006918
基金运作方式	<p>契约型开放式</p> <p>对于每份基金份额，自基金合同生效日（含）（对于认购份额而言）起或自基金份额申购确认日（含）（对于申购份额而言）起满 1 年（1 年按 365 天计算）之日为最短持有期，每份基金份额的最短持有期内，基金份额持有人不能提出赎回申请，每份基金份额的最短持有期到期日的下一工作日（含）起，基金份额持有人可提出赎回申请。</p>
基金合同生效日	2019 年 4 月 26 日
报告期末基金份额总额	11,350,040.67 份
投资目标	在严格控制基金资产投资下行风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略。基金的资产配置通过结合宏观基本面分析和风险平价策略确定。</p> <p>2、基金投资策略。在确定资产配置比例后通过定性与定量相结合的方法对基金数据进行分析，重点考察风格特征稳定性、风险控制和合规运作情况，并对照业绩比较基准评价中长期收益、业绩波动和回撤情况，得出适合投资目标的备选基金，构建基金组合。</p> <p>3、股票投资策略。（1）在股票投资中，本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法，选择其中经营稳健、公司治理较好的上市公司进行投资。（2）本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行港股投资。</p> <p>4、固定收益品种投资策略。（1）久期配置。利用宏观经济分析模型，确定宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此确定利率变动的方向和趋势。（2）类别配</p>

	置/选择：主要依据信用利差分析，自上而下的资产配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中证全债指数收益率×75%
风险收益特征	本基金属于混合型基金中基金(FOF)，是目标风险系列 FOF 产品中风险较低品种（目标风险系列根据不同风险程度划分为五档，分别是保守、稳健、平衡、积极、进取）。本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险以及境外市场的风险等风险。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)（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”）《关于准予国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》（证监许可[2018]2195 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《国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》发售，基金合同于 2019 年 4 月 26 日生效。本基金为契约型开放式基金，对于每份基金份额，自基金合同生效日（含）（对于认购份额而言）起或自基金份额申购确认日（含）（对于申购份额而言）起满 1 年（1 年按 365 天计算）之日为最短持有期，每份基金份额的最短持有期内，基金份额持有人不能提出赎回申请，每份基金份额的最短持有期到期日的下一工作日（含）起，基金份额持有人可提出赎回申请，存续期限为不定期。首次设立募集规模为 347,217,695.51 份基金份额。2019 年 4 月 26 日至 2022 年 4 月 24 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《国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)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 2022 年 4 月 22 日表决

通过了《关于终止国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)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 2022 年 4 月 25 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：国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)

报告截止日：2022 年 4 月 24 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产：		负 债：	
银行存款	752,418.30	短期借款	
结算备付金	18,895.07	交易性金融负债	
存出保证金	354.98	衍生金融负债	
交易性金融资产	11,462,845.10	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	394,541.81	应付赎回款	45,150.52
资产支持证券投资		应付管理人报酬	4,918.58
基金投资	11,068,303.29	应付托管费	1,241.85
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产	600,000.00	应付交易费用	
应收证券清算款	80.88	应付税费	
应收利息		应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款	744.04	其他负债	52,493.26
其他资产	68.05	负债合计	103,804.21
		所有者权益：	
		实收基金	11,350,040.67
		未分配利润	1,381,561.54
		所有者权益合计	12,731,602.21
资产合计：	12,835,406.42	负债与持有人权益总计：	12,835,406.42

4.2 利润表

会计主体：国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 4 月 24 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 4 月 24

	日（基金最后运作日）
一、收入	-352,237.02
1、利息收入	2,662.75
其中：存款利息收入	794.13
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	1,868.62
2、投资收益（损失以“-”填列）	193,201.67
其中：股票投资收益	
债券投资收益	5,445.78
资产支持证券投资收益	
基金投资收益	55,505.94
权证投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	132,249.95
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-548,101.44
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	
减：二、费用	36,807.93
1、管理人报酬	16,693.60
2、托管费	3,951.51
3、销售服务费	
4、交易费用	3,343.19
5、利息支出	15.62
其中：卖出回购金融资产支出	15.62
6、税金及附加	10.75
7、其他费用	12,793.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-389,044.95
减：所得税费用	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-389,044.95

注：本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师魏佳亮、郭劲扬签字出具了普华永道中天特审字(2022)第 3934 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 2022 年 4 月 25 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 2022 年 4 月 25 日至 2022 年 5 月 13 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 751,856.96 元，清算期间银行存款净流入人民币 12,587,285.46 元，清算期间银行存款净流出人民币 780,683.57 元，于清算结束日银行存款余额为人民币 12,558,458.85 元。

最后运作日应计银行存款利息余额为人民币 561.34 元，清算期间计提银行存款利息人民币 1,995.72 元，于清算结束日应计银行存款利息余额为人民币 2,557.06 元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 18,874.76 元，其中由托管账户划入至中国证券登记结算有限责任公司结算备付金账户人民币 35,783.59 元，由中国证券登记结算有限责任公司结算备付金账户划出至托管账户人民币 10,478.26 元，于清算结束日结算备付金余额为人民币 44,180.09 元。

最后运作日应计结算备付金利息余额为人民币 20.31 元，清算期间计提结算备付金利息人民币 25.27 元，于清算结束日应计结算备付金利息余额为人民币 45.58 元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 354.28 元，清算期间存出保证金账户净流出人民币 12.62 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 341.66 元。

最后运作日应计存出保证金利息余额为人民币 0.70 元，清算期间计提存出保证金利息人民币 0.38 元，于清算结束日应计存出保证金利息余额为人民币 1.08 元。

5.1.4 本基金最后运作日债券投资余额为 392,320.00 元，应计债券投资利息余额为 2,221.81 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科目余额为 0.00 元，应计债券投资利息余额为 0.00 元。

5.1.5 本基金最后运作日基金投资余额为 11,068,303.29 元，所有基金投资于清算期间处置变现，于清算结束日基金投资科目余额为 0.00 元。

5.1.6 本基金最后运作日买入返售金融资产投资余额为 600,000.00 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科目余额为 0.00 元。

5.1.7 本基金最后运作日清算资金往来科目余额为人民币 80.88 元，清算期间清算资金往来科目净流入人民币 12,524,825.68 元，清算资金往来科目净流出人民币 12,524,906.56 元，于清算结束日清算资金往来科目余额为人民币 0.00 元。

5.1.8 本基金最后运作日应收申购款余额为人民币 744.04 元，清算期间计提应收申购款人民币 168.65 元，于清算期间划入托管账户人民币 912.69 元，于清算结束日应收申购款余

额为人民币 0.00 元。

最后运作日应计申购款利息余额为人民币 68.05 元，清算期间无应收申购款利息计提，于清算结束日应计申购款利息余额为人民币 68.05 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 4,918.58 元，清算期间已支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为 0.00 元。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,241.85 元，清算期间已支付，于清算结束日应付托管费余额为 0.00 元。

5.2.3 本基金最后运作日应付审计费为人民币 52,493.26 元，清算期间已支付，于清算结束日应付审计费余额为 0.00 元。

5.2.4 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 45,150.52 元，于清算期间计提应付赎回款人民币 40,842.77 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。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2022年04月25日(基金清算起始日)至2022年05月13日(基金清算结束日)止期间
一、资产处置损益	-126,950.67
1.利息收入	2,048.33
其中：存款利息收入	2,021.37
债券利息收入	
买入返售金融资产收入	26.96
2.投资收益（损失以“-”填列）	-450,650.39
其中：债券投资收益	471.66
基金投资收益	-451,122.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	321,651.39
4.其他收入（损失以“-”号填列）	
二、清算费用	9,300.38
1.交易费用	9,047.38
2.利息支出	
其中：卖出回购金融资产支出	
3.其他费用	253.00
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-136,251.05

注：此处的其他费用为银行汇划费。

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2022年04月24日基金净资产	12,731,602.21
加：清算期间净收益	-136,251.05
减：因清算期间确认的交易份额产生的净值变动	40,674.12
二、2022年05月13日基金净资产	12,554,677.04

注：本基金最后运作日基金份额总额为 11,350,040.67 份，于清算期间确认的赎回申请份额为 36,408.24 份，转出申请份额为 0.00 份，申购申请份额为 150.34 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 11,313,782.77 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 12,554,677.04 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 5 月 13 日至清算款划出日前一日(预估为 2022 年 6 月 12 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 5 月 13 日前一日止的应收利息共计人民币 2,547.66 元，结算备付金余额人民币 44,180.09 元，保证金余额人民币 341.66 元，基金管理人预估的自 2022 年 5 月 13 日起至 2022 年 6 月 13 日止期间的应收利息人民币 3,905.92 元，均由基金管理人以自有资金垫付并已于 2022 年 5 月 13 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 5 月 13 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 12,558,458.85 元，其中人民币 50,975.33 元系基金管理人代垫的截至 2022 年 6 月 13 日的利息金额以及结算备付金、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、国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 4 月 24 日(基金最后运作日)止期间财务报表及审计报告

2、《国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)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

国联安安享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金财产清算小组

2022年5月13日