

中融融安二号灵活配置混合型 证券投资基金清算报告

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：2023年7月18日

清算报告公告日期：2023年8月2日

一、重要提示及目录

1、重要提示

中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金是由原中融融安二号保本混合型证券投资基金(以下简称“中融融安二号保本基金”)转型而来。中融融安二号保本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1747号文《关于准予中融融安二号保本混合型证券投资基金注册的批复》批准,由基金管理人中融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《中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同》发售,于2015年9月25日募集成立。中融融安二号保本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。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》、《中融融安二号灵活配置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”)的有关规定,中融基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)协商一致,由基金管理人召集,以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于2023年6月27日表决通过了《关于终止中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,决定终止本基金基金合同。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见2023年6月28日刊登在《中国证券报》和基金管理人网站(www.zrfunds.com.cn)上的《中融基金管理有限公司关于中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

本基金自2023年6月28日起进入清算程序。由基金管理人中融基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、上会会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所于2023年6月28日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由上会会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、目录

一、重要提示及目录	2
1、重要提示.....	2
2、目录.....	3
二、基金概况	4
三、财务会计报告	4
四、清算事项说明	6
1、基本情况.....	6
2、清算原因.....	7
3、清算起始日.....	7
4、清算报表编制基础.....	7
五、清算情况	8
1、资产处置情况.....	8
2、负债清偿情况.....	8
3、所有者权益情况.....	9
4、清算期间的清算损益情况、.....	9
5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况.....	9
6、基金财产清算报告的告知安排.....	10
六、备查文件目录	10
1、备查文件目录.....	10
2、存放地点.....	10
3、查阅方式.....	10

二、基金概况

- 1、基金名称：中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金简称：中融融安二号混合（基金代码：001739）
- 3、基金运作方式：契约型开放式
- 4、基金合同生效日：2018年9月29日
- 5、2023年6月27日（基金最后运作日）基金份额总额：824,168.56份
- 6、投资目标：本基金通过对股票、债券等金融资产的动态灵活配置，合理控制风险并保持组合良好流动性的前提下，实现基金资产的长期稳定增值，力求为投资者获取超额回报。
- 7、投资策略：1) 大类资产配置策略 2) 债券投资策略 3) 股票投资策略 4) 股指期货投资策略 5) 中小企业私募债券投资策略 6) 资产支持证券的投资策略 7) 国债期货投资策略
- 8、业绩比较基准：沪深300指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%
- 9、风险收益特征：本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。
- 10、基金管理人：中融基金管理有限公司
- 11、基金托管人：中国银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年6月27日

单位：人民币元

项目	基金最后运作日 2023年6月27日
资产：	
银行存款	727,969.07
结算备付金	207,275.24
存出保证金	32,191.01
资产合计	967,435.32

负债：	
应付管理人报酬	853.31
应付托管费	142.24
应付交易费用	5,322.24
其他负债	34,465.31
负债合计	40,783.10
所有者权益：	
实收基金	824,168.56
未分配利润	102,483.66
所有者权益合计	926,652.22
负债及所有者权益合计	967,435.32

四、清算事项说明

1、基本情况

中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金是由原中融融安二号保本混合型证券投资基金(以下简称“中融融安二号保本基金”)转型而来。中融融安二号保本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1747号文《关于准予中融融安二号保本混合型证券投资基金注册的批复》批准,由基金管理人中融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《中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同》发售,于2015年9月25日募集成立。中融融安二号保本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。根据原《中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,中融融安二号保本基金的保本周期为三年,自基金合同生效日(即2015年9月25日)起至三年后的对应日止,如该对应日为非工作日或该公历年不存在该对应日,则顺延至下一个工作日,即2018年9月25日。根据中融融安二号保本基金基金合同的约定,“如保本周期到期后,本基金未能符合保本基金存续条件,本基金转型为非保本基金‘中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金’,基金投资、基金费率、分红方式等相关内容也将根据本基金合同的约定做相应修改,在报中国证监会备案后,提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。”中融融安二号保本基金保本周期到期,因未能符合保本基金存续条件,将按照《中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的混合型基金,即“中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《中融融安二号保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型后运作相关业务规则的公告》,中融融安二号保本基金因未能符合保本基金存续条件,自2018年9月29日起转型为中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),并相应修改基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等。原《中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同》失效,《中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同日起生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等）、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 \times 50%+上证国债指数收益率 \times 50%。

2、清算原因

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》和《中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议终止《中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。本基金管理人组织召开基金份额持有人大会，审议并通过了《关于终止中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并依法履行基金财产清算程序。

3、清算起始日

根据《基金合同》及《中融基金管理有限公司关于中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，2023 年 6 月 27 日为基金最后运作日，本基金于 2023 年 6 月 28 日进入清算期，故本基金清算起始日为 2023 年 6 月 28 日。

4、清算报表编制基础

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。本基金自最后运作日起，资产负债按实际清算价格计价。

五、清算情况

自 2023 年 6 月 28 日至 2023 年 7 月 10 日止为本基金清算期，中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金自清算起始日起，中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组成立，并对中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行，具体情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款 727,969.07 元，清算期间收到结算保证金转入 15,052.40 元，收到清算备付金转入 207,210.00 元，支付汇划费 15.00 元，存出结算保证金转出 8.06 元，支付管理费 853.31 元，支付托管费 142.24 元，计提银行存款利息 94.98 元，清算结束日银行存款 949,307.84 元。

(2) 本基金最后运作日清算备付金 207,275.24 元，清算期间转出 207,210.00 元，计提清算备付金利息 111.84 元，清算结束日清算备付金为 177.08 元，全部为应计清算备付金利息，预计将于三季度结息时转入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金 32,191.01 元，清算期间转入 8.06 元，转出 15,052.40 元，计提保证金利息 14.09 元，清算结束日存出保证金为 17,160.76 元，其中存出保证金 17,136.52 元预计将于 2023 年 8 月转入托管账户，应计存出保证金利息 24.24 元预计将于三季度结息时转入托管账户。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 853.31 元，该款项已于清算期间从托管账户划出。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为 142.24 元，该款项已于清算期间从托管账户划出。

(3) 本基金最后运作日、清算结束日应付交易费用均为 5,322.24 元，该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(4) 本基金最后运作日、清算结束日审计费用均为 8,163.71 元，该款项将于清算审计完成后从托管账户划出。

(5) 本基金最后运作日、清算结束日信息披露费均为 26,301.60 元，该款项将于收到信息披露费发票后从托管账户划出。

3、所有者权益情况

最后运作日基金净资产为926,652.22元，基金份额共824,168.56份；清算结束日本基金剩余财产为926,858.13元，基金份额共824,168.56份。

4、清算期间的清算损益情况

项目	清算期发生额
一、清算期间收入	
1、存款利息收入（注1）	220.91
清算期间收入小计	220.91
二、清算期间费用	
1、其他费用（注2）	15.00
清算期间费用小计	15.00
三、清算净收益（清算净损失以“-”表示）	205.91

注1：存款利息收入包括本基金自清算起始日2023年6月28日至清算结束日2023年7月10日产生的银行存款利息收入94.98元、结算备付金利息收入111.84元，结息保证金利息收入14.09元，共计220.91元。

注2：其他费用为汇划费15.00元。

5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况

项目	单位：人民币元	
	金额	
一、最后运作日2023年6月27日基金净资产	926,652.22	
加：清算期间净收益	205.91	
加：清算期间因申购影响的金额	0	
减：清算期间因赎回影响的金额	0	
二、清算结束日2023年7月10日基金净资产	926,858.13	

根据《基金合同》中关于基金财产清算的相关约定，基金财产清算小组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。同时，《基金合同》“第七部分 基金合同当事人及权利义务”中“三、基金份额持有人”项下约定：“每份基金份额具有同等的合法权益。”基金财产将按照上述分配原

则进行分配。

清算结束后，本基金若获得新的待分配剩余财产，则清算小组将该部分剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。本基金清算起始日 2023 年 6 月 28 日至基金财产清算款划出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。如前述利息在本基金财产分配划出日前尚未结清，则未结息部分将由基金管理人中融基金管理有限公司以自有资金垫付至托管账户。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，基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于利息结清后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

6、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，将报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金清算报告〉的法律意见》。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023 年 7 月 18 日