

华安安润灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年四月十日

§1 重要提示

华安安润灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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]2603号《关于准予华安安润灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2016]2403号《关于华安安润灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人自2016年10月19日到2016年10月26日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第60971571_B19号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年10月31日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,份额注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《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《华安安润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,终止《基金合同》。鉴于华安安润灵活配置混合型证券投资基金已连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元,为维护基金份额持有人利益,根据本基金基金合同的约定,不需召开基金份额持有人大会,本基金管理人与基金托管人协商一致,决定本基金最后运作日为2018年1月26日,自2018年1月27日进入清算期。

由基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2018年1月29日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金简称	华安安润灵活配置混合
基金主代码	002153
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年10月31日
报告期末(2018年1月26日)基金份额总额	8,541,306.59份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。
业绩比较基准	50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

华安安润灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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]2603号《关于准予华安安润灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2016]2403号《关于华安安润灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人自2016年10月19日到2016年10月26日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第60971571_B19号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年10月31日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,份额注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

为适应市场环境变化,更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《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《基金合同》的有关规定,终止《基金合同》。鉴于华安安润灵活配置混合型证券投资基金已连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元,为维护基金份额持有人利益,根据本基金基金合同的约定,不需召开基金份额持有人大会,本基金管理人与基金托管人协商一致,决定本基金最后运作日为2018年1月26日,自2018年1月27日进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体:华安安润灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年1月26日

单位:人民币元

资 产	最后运作日 2018年1月26日
资 产:	
银行存款	4,155,130.18
结算备付金	-
存出保证金	234,779.41
交易性金融资产	4,613,000.00
其中：股票投资	4,613,000.00
应收利息	3,672.90
资产总计	9,006,582.49
负债和所有者权益	最后运作日 2018年1月26日
负 债:	
应付赎回款	1.04
应付管理人报酬	3,981.51
应付托管费	995.36
应付销售服务费	2.98
应付交易费用	119,417.60
其他负债	-
负债合计	124,398.49
所有者权益:	
实收基金	8,541,306.59
未分配利润	340,877.41
所有者权益合计	8,882,184.00
负债和所有者权益总计	9,006,582.49

注：本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师蒋燕华、蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)专字第 60971571_B04 号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

自 2018 年 1 月 27 日至 2018 年 3 月 9 日止清算期间，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 本基金最后运作日存出保证金人民币 234,779.41 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的结算保证金。该款项于 2018 年 2 月 2 日划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 4,613,000.00 元，系因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票，明细如下：（金额单位：人民币元）

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	终止日 估值单 价	数量	终止日成本总 额	终止日估值总 额
					（单位：股）		
601600	中国铝业	2017/9/12	重大事项停牌	6.59	700,000	4,880,805.17	4,613,000.00

根据《华安安润灵活配置混合型证券投资基金基金合同》第十四部分“基金资产估值”的约定，交易所上市的权益类证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化以及证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。流通受限证券中国铝业最后运作日的估值单价的系本基金管理人华安基金管理有限公司运用估值技术计算而得。该股票已于 2018 年 3 月 1 日全部出售，成交金额人民币 3,855,056.56 元，变现款项已于 2018 年 3 月 2 日划入托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为人民币 3,672.90 元。其中应收银行存款利息人民币 3,265.73 元，应收存出保证金利息人民币 407.17 元，上述款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 3 月 5 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。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1.04 元，该款项已于 2018 年 1 月 29 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,981.51 元，该款项已于 2018 年 2 月 2 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 995.36 元，该款项已于 2018 年 2 月 2 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 2.98 元，该款项已于 2018 年 2 月 2 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 119,417.60 元，为应付佣金，该款项已于 2018 年 3 月 5 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自 2018 年 1 月 27 日 至 2018 年 3 月 9 日 止清算期间
一、清算损益	
1、利息收入（注 1）	1,957.17
2、投资损益	-765,730.65
清算损益小计	-763,773.48
二、清算费用	
清算费用小计（注 2）	-
三、清算净损益	-763,773.48

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 1 月 27 日至 2018 年 3 月 9 日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 3 月 5 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。

注 2：根据《华安安润灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本次清算期间产生的清算费用由本基金管理人代为支付。

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2018年1月26日基金净资产	8,882,184.00
加：清算期间净损益	-763,773.48
减：基金净赎回转出金额（于2018年1月29日确认的投资者赎回转出申请）	3,120,002.08
二、2018年3月9日基金净资产	4,998,408.44

根据本基金的基金合同及《华安安润灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，将基金财产清算后的全部剩余资产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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2018 年 3 月 9 日止的剩余财产为人民币 4,998,408.44 元。

截至 2018 年 3 月 9 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人民币 5,287,301.84 元，其中人民币 360,000.00 元系基金管理人代垫的结算备付金、存出保证金以及以当前适用的利率预估的银行存款及存出保证金利息。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人 有义务于收到基金托管人通知后当日内将款项补足。

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。

86 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、华安安润灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 1 月 26 日资产负债表及审计报告
- 2、《华安安润灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安安润灵活配置混合型证券投资基金
基金财产清算小组
二〇一八年三月九日