

国联安聚利 39 个月封闭式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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日：二零二六年七月七日

§ 1 重要提示

国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金（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[2022]3251 号《关于准予国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人国联安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2023 年 3 月 1 日正式生效，首次设立募集规模 6,372,070,096.44 份基金份额。本基金为契约型封闭式，封闭期限 39 个月。本基金的基金管理人及注册登记机构为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《基金合同》第三部分“基金的基本情况”约定：“本基金自基金合同生效之日起进入封闭期，封闭期为基金合同生效之日起至 39 个自然月后月度对日的前一日(若该日为非工作日，顺延至下一工作日)。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。”“本基金将在封闭期到期日（T 日）对基金份额进行自动赎回，按已变现的基金财产支付部分赎回款项，基金管理人将在 T+7 日内（含）将已变现的基金财产对应款项按基金份额持有人持有的基金份额比例自动赎回给本基金全体基金份额持有人。”“封闭期到期日的次日，本基金基金合同自动终止并进入基金财产清算程序。进入基金财产清算程序时，若存在未变现的资产，登记机构将于该部分资产变现完成后，将对应款项按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给本基金全体基金份额持有人，单位基金份额所分配的资产金额按照资产变现完成后的净额进行计算，单位基金份额对应的总到账款项可能与封闭期到期日基金份额净值不一致。”“基金管理人应在封闭期到期日的下一个工作日发布相关提示公告。若由于不可抗力的原因导致无法按时办理基金份额自动赎回的，则办理日相应顺延。”“本基金成立于 2023 年 3 月 1 日，《基金合同》生效后封闭运作 39 个月，2026 年 6 月 1 日为封闭期到期日，本基金在封闭期到期日（2026 年 6 月 1 日）对基金份额进行自动赎回，《基金合同》于封闭期到期日的次日（2026 年 6 月 2 日）自动终止并进入基金财产清算程序，不需要召开基金份额持有人大会审议。本基金管理人于 2026 年 6 月 2 日发布《关于国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金基金份额自动赎回、进入清算期及终止基金合同的公告》。

根据上述《基金合同》的约定，本基金基金财产清算小组于 2026 年 6 月 2 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、基金托管人中国光大银行股份有限公司、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吕金虎、李慈慧；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	国联安聚利 39 个月封闭式债券
基金主代码	017793
基金运作方式	契约型、封闭式。本基金自基金合同生效之日起进入封闭期，封闭期为基金合同生效之日起至 39 个自然月后月度对日的前一日（若该日为非工作日，顺延至下一工作日）。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。
基金合同生效日	2023 年 3 月 1 日
基金最后运作日（2026 年 6 月 1 日）基金份额总额	6,372,070,096.44 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
投资策略	基金管理人将根据基金资产估值方法的不同，对所投债券实行分单元管理，包括持有到期型单元和交易型单元。基金管理人在购买债券伊始即根据投资目的对其分别标记为摊余成本法债券品种和市值法债券品种，计入上述两个单元分别进行独立运营管理。 持有到期型单元包括投资于以收取合同现金流量为目的并持有到期的债券，采用摊余成本法估值。该单元内的资产均需通过《企业会计准则》要求的“合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付的测试”（“SPPI 测试”），并在存续期间每个工作日开展资产减值测试及影子定价偏离度监测，持续加强基金估值的

	<p>公允性评估，按法规要求及时采取有效措施，避免基金资产净值在到期前异常波动。若所投债券出现违约的，应当及时进行资产清算，尽量避免产品封闭期到期时仍未处置完毕的情况。其余债券纳入交易型单元，采用市值法进行公允价值计量且其变动计入当期损益。</p> <p>本基金可根据收益率、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。本基金将基于对未来宏观经济和利率环境的研究和预测，根据国债、金融债、信用债等不同品种的信用利差变动情况，以及各品种的市场容量和流动性情况，判断各个债券资产类属的预期回报，在不同债券品种之间进行配置。除此之外，本基金还可采用信用债投资策略、杠杆投资策略等。</p>
业绩比较基准	中债综合财富(1-3年)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	中国光大银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金（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[2022]3251 号《关于准予国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人国联安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2023 年 3 月 1 日正式生效，首次设立募集规模 6,372,070,096.44 份基金份额。本基金为契约型封闭式，封闭期限 39 个月。本基金的基金管理人及注册登记机构为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金自基金合同生效之日起进入封闭期，封闭期为基金合同生效之日起 至 39 个自然月后月度对日的前一日(若该日为非工作日，顺延至下一工作日)。 本基金在封闭期内不办

理申购与赎回业务，也不上市交易。

本基金投资于债券（包括国内依法发行上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及通知存款等）、同业存单、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金不投资于股票资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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。

本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，且投资于采用摊余成本法估值的债券资产不低于基金净资产的 50%（如因基金资产价格波动等原因导致摊余成本计量的债券资产被动低于上述 50%比例的，应在 1 个月内调整至符合比例要求），采用交易策略、相应以市价法估值的债券资产不低于基金净资产的 20%。本基金在封闭期到期日前三个月内可以不满足上述投资比例限制。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（1-3 年）指数收益率。

根据《基金合同》以及本基金管理人于 2026 年 6 月 2 日发布《关于国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金基金份额自动赎回、进入清算期及终止基金合同的公告》，本基金自 2026 年 6 月 2 日起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：国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 1 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产：		负 债：	
货币资金	6,483,195,184.19	短期借款	-
结算备付金	62,240.03	交易性金融负债	-
存出保证金	63,931.62	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	-	应付清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	1,753,187.35
基金投资	-	应付托管费	292,197.88
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	596,858.48
买入返售金融资产	-	应付利润	-
应收清算款	-	递延所得税负债	-
应收股利	-	其他负债	90,847.46
应收申购款	-	负债合计	2,733,091.17
递延所得税资产	-	净资产：	
其他资产	-	实收基金	6,372,070,096.44
		其他综合收益	-
		未分配利润	108,518,168.23
		净资产合计	6,480,588,264.67
资产合计：	6,483,321,355.84	负债与净资产总计：	6,483,321,355.84

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 2026 年 6 月 2 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按照财政部颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。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 6 月 2 日至 2026 年 6 月 3 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 6,483,195,184.19 元，其中本金为人民币

6,483,123,758.48 元，应计利息为人民币 71,425.71 元。

清算期间货币资金净流入为人民币 63,880.52 元，清算期间货币资金净流出为人民币 6,483,000,647.78 元，清算期间计提货币资金利息为人民币 63,009.36 元，于清算结束日货币资金余额为人民币 321,426.29 元，其中本金为人民币 186,991.22 元，应计利息为人民币 134,435.07 元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 62,240.03 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为人民币 13,810.04 元，应计结算备付金利息为人民币 48,429.99 元。

清算期间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将按照结算规则逐步划回托管户，清算期间计提结算备付金利息为人民币 0.26 元，于清算结束日结算备付金余额为人民币 62,240.29 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 13,810.04 元，应计结算备付金利息为人民币 48,430.25 元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 63,931.62 元，其中本金为人民币 63,880.52 元，应计利息为人民币 51.10 元。

清算期间存出保证金本金已全部结转，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 51.10 元，其中本金为人民币 0.00 元，应计利息为人民币 51.10 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 1,753,187.35 元，清算期间已支付人民币 1,646,684.07 元，于清算结束日应付管理人报酬余额为 106,503.28 元，该款项将于 2026 年 6 月 3 日后支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 292,197.88 元，清算期间已支付人民币 274,447.34 元，于清算结束日应付托管费余额为 17,750.54 元，该款项将于 2026 年 6 月 3 日后支付。

5.2.3 本基金最后运作日应交税费余额为人民币 596,858.48 元，清算期间已支付人民币 491,251.70 元，于清算结束日应交税费余额为人民币 105,606.78 元，该款项将于 2026 年 6 月 3 日后支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债为人民币 90,847.46 元，其中应付审计费为人民币 30,000.00 元，应付交易费用为人民币 51,547.46 元，应付上交所季度账户维护费及查询费为

人民币 4,800.00 元，应付中债账户维护费为人民币 4,500 元。以上款项将于 2026 年 6 月 3 日后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2026年6月2日(基金清算起始日)至2026年6月3日(基金清算结束日)止期间
一、资产处置损益	63,009.62
1.利息收入	63,009.62
其中：银行存款利息收入	63,009.36
结算备付金利息收入	0.26
保证金利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-
其中：股票投资收益	-
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）	-
二、清算费用	-
1. 其他费用	-
2. 税金及附加	-
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	63,009.62

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6月1日基金净资产	6,480,588,264.67
加：清算期间净收益	63,009.62
加：因清算期间确认的交易份额产生的净值变动	-6,480,588,264.67
二、2026年6月3日基金净资产	63,009.62

注：本基金最后运作日基金份额总额为 6,372,070,096.44 份，于清算期间无确认的申赎及转换份额，截至清算结束日基金份额总额为 0.00 份。本基金已于 2026 年 6 月 2 日根据《基金合同》第三部分“基金的基本情况”约定按 2026 年 6 月 1 日基金净资产全额支付投资者赎回款项，后续不涉及对投资者的财产分配。

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 63,009.62 元。上述剩余财产将于清算期后划款至基金管理人。本基金清算费用包括律师费等由基金管理人国联安基金管理有限公司承担。

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、国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金清算审计报告
- 2、关于《国联安聚利 39 个月封闭式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

国联安聚利 39 个月封闭式纯债债券型证券投资基金 基金财产清算小组

2026 年 6 月 16 日