

华安国际配置基金清算报告

2011年11月2日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年十一月七日

§ 1 重要提示

华安国际配置基金（以下简称“本基金”）的合同成立日为2006年11月2日，第一个投资保本周期5年，华安基金管理有限公司决定于第一个投资保本周期到期日终止该基金的合作。根据《基金合同》第二十二条第（三）款约定，华安基金管理有限公司作为本基金的管理人、中国工商银行股份有限公司作为本基金的托管人，中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）上海监管局作为华安基金管理有限公司属地监管部门，和普华永道中天会计师事务所有限公司及上海市通力律师事务所共同组成清算小组，对本基金到期资产进行清算，并由普华永道中天会计师事务所有限公司对清算报告进行审计，由上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见书。

§ 2 基金概况

基金名称：	华安国际配置基金
基金简称：	华安国际配置
交易代码：	040006
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2006年11月2日
期末基金份额总额：	96,197,911.04份
投资目标：	通过全球化的资产配置和组合管理，寻求组合资产稳定的绝对收益，在降低组合波动性的同时，实现基金资产的最大增值。
投资策略：	在第一个投资周期内，本基金投资于结构性保本票据。该结构性保本票据所对应资金通过一定的结构和机制全额配置于收益资产与保本资产。
业绩比较基准：	基金业绩比较基准=摩根士丹利资本国际全球指数(MSCI World Index)×35%+雷曼兄弟全球综合指数(Lehman Brothers Global Aggregate Index)×45%+美国房地产信托凭证行业协会指数(NAREIT All REITs Index)×10%+道琼斯-美国国际集团商品指数(DJ-AIG Commodity Index)×10%
风险收益特征：	中等收益，中等风险
基金管理人：	华安基金管理有限公司

基金托管人：	中国工商银行股份有限公司
--------	--------------

§ 3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监基金字[2006]160号《关于同意华安国际配置基金募集的批复》及国家外汇管理局上海市分局上海汇复[2006]94号《关于华安基金管理有限公司经营外汇业务和境外证券投资额度的批复》核准，自2006年9月13日起通过华安基金管理有限公司的投资理财中心、电子交易平台及中国工商银行股份有限公司的代销网点定向募集，2006年10月20日募集结束。2006年11月2日获得中国证监会基金部函[2006]266号确认，基金合同正式成立并开始运作。自2006年11月2日至2008年9月15日期间，本基金按基金合同正常运作。

2008年9月15日，雷曼兄弟公司宣布申请破产保护，本基金投资的结构性保本票据的相关主体—雷曼兄弟国际公司（欧洲）（简称“雷曼欧洲”）及其关联机构于2008年9月至10月先后进入破产程序，致使本基金一直无法正常运作、估值和开放赎回。

华安基金管理有限公司经过与雷曼欧洲的积极交涉，于2009年11月收回结构性保本票据中的收益资产部分，合计45,388,711.96美元。该部分资产收回后，由基金管理人在境内进行固定收益投资。

为维护广大基金份额持有人的利益，2008年9月27日华安基金管理有限公司以雷曼欧洲违反双方签订的《产品合作协议》有关义务和责任为由向上海市高级人民法院（简称“上海高院”）起诉雷曼欧洲，要求判令解除本公司与雷曼欧洲的产品合作关系，并判令雷曼欧洲赔偿相关损失。2009年6月15日至6月16日，上海高院对本案进行了公开审理。对本案法庭没有进行当庭判决，要求原被告双方进行沟通，希望能通过庭外和解的方式结案。在上海高院的主持调解下，经过与雷曼欧洲艰苦的漫长谈判，华安基金管理有限公司依据《华安国际配置基金基金合同》的相关规定，与雷曼欧洲（由雷曼欧洲的破产管理人之一作为代理人）就上述案件达成了和解协议，并签收了上海高院出具的[2008]沪高民四(商)初字第6号《民事调解书》。根据和解协议和《民事调解书》，雷曼欧洲应向华安国际配置基金支付44,889,933.48美元（以下简称“和解款项”）及自2009年7月1日起计

算至付款日(最多计算至2011年11月2日止)以和解款项为本金、以年利率2.25%为利率计算的利息。华安国际配置基金于2011年10月27日收到雷曼欧洲的和解款及利息合计47,236,508.63美元。

根据华安基金和雷曼欧洲和解协议和《民事调解书》，双方同意，若雷曼欧洲就破产索赔权利的最终所得款项超过“和解所得”的金额(该等超过的金额下称“超出款项”)，则雷曼欧洲应向华安国际配置基金另行支付一笔款项，其金额等于“超出款项”扣除“和解所得”的利息(以“和解所得”为本金，以年利率2.25%为利率，自“和解所得”的付款日起计算至雷曼欧洲收到“超出款项”之日止)的余额。为避免疑义，若“和解所得”按上述方法计算的利息超过“超出款项”，则雷曼欧洲将不再支付“超出款项”。

2011年11月2日，本基金进入清算程序。

§ 4 财务会计报告

资产负债表(已经审计)

会计主体：华安国际配置基金
 报告截止日：2011年11月1日

单位：美元

	附注	2011年11月1日	2010年12月31日
资产：			
银行存款		94,938,824.83	46,440,424.13
其中：定期存款			45,760,069.70
结算备付金			
存出保证金			
交易性金融资产			
其中：股票投资			
债券投资			
资产支持证券投资			
基金投资			
权证投资			
衍生金融资产			
买入返售金融资产			
应收证券清算款			

应收利息		1,129.08	87,014.70
应收股利			
应收申购款			
其他资产	1		47,236,508.63
资产合计:		94,939,953.91	93,763,947.46
负债和所有者权益			
负债:			
短期借款			
交易性金融负债			
衍生金融负债			
卖出回购金融资产款			
应付证券清算款			
应付赎回款			
应付管理人报酬	2	363,892.79	363,892.79
应付托管费			
应付销售服务费			
应付交易费用			
应付税费			
应付利息			
应付利润			
其他负债	3	41,500.00	
负债合计		405,392.79	363,892.79
所有者权益:			
实收基金		96,197,911.04	96,197,911.04
未分配利润		-1,663,349.92	-2,797,856.37
所有者权益合计		94,534,561.12	93,400,054.67
负债与持有人权益总计:		94,939,953.91	93,763,947.46
份额净值		0.983	0.971

资产负债表附注:

1、其他资产

于2010年12月31日,其他资产余额为本基金所持结构性保本票据解约后可收回的和解所得。

2、应付管理人报酬

应付管理人报酬为本基金尚未支付华安基金管理有限公司的2008年6月至8月期间的管理人报酬。本基金自2008年9月起停止计提管理人报酬。

3、其他负债

于2011年11月1日,其他负债为预提的清算审计费23,500.00美元及清算律师费18,000.00美元。

§5 保本方案

按照《华安国际配置基金基金合同》、华安基金管理公司2008年9月18日发布的《华安基金管理有限公司关于华安国际配置基金所持有的结构性保本票据保本责任的公告》及2011年9月20日发布的《华安基金管理有限公司关于雷曼兄弟国际(欧洲)公司诉讼案进展情况和华安国际配置基金到期终止的公告》,华安基金管理有限公司将于本基金第一个投资周期届满之日2011年11月2日履行到期保本承诺。以美元计价的结构性保本票据清算所得、和解所得以及该等资产的投资收益合计,低于本基金原投资的相应结构性保本票据本金,华安基金管理有限公司将以自有资金弥补该等资金缺口。如弥补了该等资金缺口后,基金份额净值仍低于基金初始发售面值1.00美元,本公司将继续以自有资金补足基金初始发售的面值。

本基金于所持有的结构性保本票据解约后收到结构性保本票据清算所得、和解所得以及该等资产的投资收益合计94,636,630.22美元,低于本基金原投资的结构性保本票据的本金96,400,000.00美元。遵照上述保本承诺,华安基金于2011年11月2日将1,763,369.78美元(该金额已经普华永道中天会计师事务所有限公司复核)划入本基金托管账户弥补差额。上述资金划入后,本基金的基金份额净值为1.001美元。

§6 基金剩余财产分配

6.1 清算费用

按照《华安国际配置基金基金合同》第二十二部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定,本基金应聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书。基金财产清算后在扣除基金清算费用后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

本基金的清算费用包括:

- 1、聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,费用为23,500.00美元;
- 2、聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书,费用为18,000.00美元;

以上两项费用合计41,500.00美元，已在2011年11月1日的资产负债表中预提。

6.2 计划剩余财产的分配

按照《华安国际配置基金基金合同》第二十二部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，基金财产清算后在扣除基金清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

剩余财产的具体分配顺序见下表：

金额单位：美元

项 目	分 配 顺 序
一、2011年11月1日所有者权益	94,534,561.12
加：华安基金管理有限公司支付的保本补偿款	1,763,369.78
二、保本后所有者权益(即可供分配剩余财产)	96,297,930.90
清算日份额持有人持有的基金份额(份)	96,197,911.04
2011年11月1日每份份额可分配剩余资产(保留九位有效数字，末位数字采用去尾法)	1.001039730

合同到期日后至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有，在支付清算款时将一并计算并支付给份额持有人。

6.3 基金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。

§7 备查文件

7.1 备查文件目录

- 1、华安国际配置基金2011年11月1日(基金合同终止日)资产负债表及审计报告
- 2、《华安国际配置基金清算报告》的法律意见

7.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

7.3 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。

基金托管人
中国工商银行股份有限公司

基金管理人
华安基金管理有限公司

2011年11月7日

2011年11月7日