

中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金
清算报告

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：2017年5月4日

清算报告公告日：2017年6月9日

一、 重要提示

中海安鑫宝1号保本混合型证券投资基金（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”）2015年3月13日证监许可[2015]391号文核准募集，自2015年4月3日起基金合同生效，基金管理人为中海基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《关于避险策略基金的指导意见》关于已经成立的保本基金不符合该指导意见的处理方式及本基金《基金合同》对于本基金保本周期到期后基金的存续形式的约定，本基金不再满足保本基金存续的要求，根据《基金合同》的规定进入清算程序并终止。基金管理人已就该事项于2017年3月20日、2017年3月27日和2017年4月7日在《证券日报》及中海基金管理有限公司网站分别刊登了《中海基金管理有限公司关于中海安鑫宝1号保本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》、《中海基金管理有限公司关于中海安鑫宝1号保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的提示性公告》和《中海基金管理有限公司关于终止中海安鑫宝1号保本混合型证券投资基金基金合同及基金财产清算的公告》。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2017年4月6日成立基金财产清算小组，履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、 基金概况

基金名称	中海安鑫宝1号保本混合型证券投资基金
基金简称	中海安鑫宝1号保本混合
基金主代码	001155
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月3日
基金管理人名称	中海基金管理有限公司
基金托管人名称	平安银行股份有限公司

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会2015年3月13日证监许可[2015]391号文核准募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2015年3月26日至2015年4月1日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2015年4月3日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为238,602,520.44份（含募集期间利息结转的份额）。本基金为保本基金，保本周期为两年，第一个保本周期的担保人由瀚华担保股份有限公司担任，本基金自成立（2015年4月3日）至第一个保本周期到期日（2017年4月5日）期间，按基金合同约定正常运作。

根据《关于避险策略基金的指导意见》关于已经成立的保本基金不符合该指导意见的处理方式及本基金《基金合同》对于本基金保本周期到期后基金的存续形式的约定，本基金不再满足保本基金存续的要求，根据《基金合同》的规定进入清算程序并终止，本基金自2017年4月6日起进入基金财产清算程序。

四、 财务会计报告

（一） 2017年4月5日（基金最后运作日）资产负债表（经审计）

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资 产	本期末 2017年4月5日 (基金最后运作日)	上年度末 2016年12月31日
资 产:		
银行存款	244,844,847.19	2,941,138.84
结算备付金	10,845.18	636,742.36
存出保证金	125,660.57	260,703.19
交易性金融资产	-	125,382,413.20
其中：债券投资	-	125,382,413.20
买入返售金融资产	-	112,000,315.00
应收证券清算款	-	1,040,904.46
应收利息	2,029.71	1,121,658.55
资产总计	244,983,382.65	243,383,875.60

负债和所有者权益		
负 债:		
应付管理人报酬	20,121.02	123,359.04
应付托管费	3,353.50	20,559.83
应付销售服务费	10,060.50	61,679.52
应付交易费用	2,742.21	123,662.19
其他负债	63,700.00	105,000.00
负债合计	99,977.23	434,260.58
所有者权益:		
实收基金	238,602,520.44	238,602,520.44
未分配利润	6,280,884.98	4,347,094.58
所有者权益合计	244,883,405.42	242,949,615.02
负债和所有者权益总计	244,983,382.65	243,383,875.60

注:

1、 报告截止日 2017 年 4 月 5 日(基金最后运作日), 基金份额净值 1.026 元, 基金份额总额 238,602,520.44 份。

2、 财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 5 日(基金最后运作日)。

3、 自 2017 年 4 月 6 日起, 本基金进入基金财产清算期, 因此本基金财务报表以清算基础编制。所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量, 负债以预计需要清偿的金额计量。

(二) 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 5 日(基金最后运作日)止期间的利润表(经审计)

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 4 月 5 日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	2,620,059.39	3,671,996.97

利息收入	2,459,288.35	5,586,195.34
其中：存款利息收入	534,659.05	501,318.63
债券利息收入	1,342,434.36	4,141,525.65
买入返售金融资产收入	582,194.94	943,351.06
投资收益(损失以“-”填列)	-164,238.69	-615,044.65
其中：股票投资收益	-418.00	-1,963,150.54
债券投资收益	-163,820.69	1,312,955.77
股利收益	-	35,150.12
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	325,009.73	-1,299,153.72
减：二、费用	686,268.99	3,886,663.43
1. 管理人报酬	380,938.73	1,455,288.92
2. 托管费	63,489.80	242,548.20
3. 销售服务费	190,469.37	727,644.49
4. 交易费用	3,671.09	1,295,181.82
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	47,700.00	166,000.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,933,790.40	-214,666.46
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,933,790.40	-214,666.46

五、 清算情况

自 2017 年 4 月 6 日至 2017 年 5 月 4 日止为本次清算期间，基金财产清算组对本基金的基金财产进行清算，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：

（一）清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，包括支付给会计师事务所、证券日报信息披露费的费用，基金财产变现过程中所产生的交易费用、分配基金剩余财产的手续费等，根据基金合同的规定，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

（二）资产清算情况

截至本次清算期结束日（2017年5月4日）部分资产尚未完成变现，根据基金管理人2017年4月7日发布的《关于中海安鑫宝1号保本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》，为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金对该部分资产进行垫付。各项资产清算情况如下：

- 1、本基金最后运作日清算备付金为人民币10,845.18元，已于2017年4月6日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户；
- 2、本基金最后运作日存出保证金为人民币125,660.57元，已于2017年4月6日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户；
- 3、本基金最后运作日应收利息为人民币2,029.71元，已由基金管理人于2017年5月3日以自有资金垫付至托管账户。

（三）负债清偿情况

- 1、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币20,121.02元，该款项已于2017年5月2日支付。
- 2、本基金最后运作日应付托管费为人民币3,353.50元，该款项已于2017年5月2日支付。
- 3、本基金最后运作日应付销售费为人民币10,060.50元，该款项已于2017年5月2日支付。
- 4、本基金最后运作日应付交易费用为人民币2,742.21元，其中应付安信证券席位佣金为人民币1,427.21元，该款项已于2017年4月7日支付；应付17年1季度上清所债券结算手续费为人民币900.00元，该款项已于2017年4月7日支付；应付17年1季度中债登回购结算手续费为人民币120.00元，该款项已于2017年4月12日支付；应付17年1季度外汇交易中心交易手续费为人民币295.00元，该款项已于2017年4月17日支付。

5、本基金最后运作日其他负债为人民币 63,700.00 元，包括应付银行间账户维护费、应付信息披露费、预提审计费等。其中，应付 17 年证券日报信息披露费为人民币 26,700.00 元，该款项已于 2017 年 4 月 17 日支付；应付 16 年审计费尾款为人民币 25,000.00 元，该款项已于 2017 年 4 月 20 日支付；应付 17 年 1 季度上清所账户维护费为人民币 4,500 元，该款项已于 2017 年 4 月 7 日支付；应付 17 年 1 季度中债登账户维护费为人民币 4,500 元，该款项已于 2017 年 4 月 12 日支付；应付 17 年 2 季度上清所账户维护费为人民币 1,500 元，该款项已于 2017 年 4 月 26 日支付；应付 17 年 2 季度中债登账户维护费为人民币 1,500 元，该款项已于 2017 年 4 月 27 日支付。

(四) 本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2017 年 4 月 6 日 至 2017 年 5 月 4 日止清算期间
一、清算收益：	
利息收入（注 1）	6,533.79
二、清算净收益	6,533.79

表中相关项目具体说明如下：

利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2017 年 4 月 6 日至 2017 年 5 月 4 日止清算期间的银行存款利息、清算备付金利息、存出保证金利息。

(五) 截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2017 年 4 月 5 日基金净资产	244,883,405.42
加：清算期间净收益	6,533.79
加：清算期间基金份额交易产生的净值影响	-242,043,896.85
二、2017 年 5 月 4 日基金净资产	2,846,042.36

本基金最后开放日为 2017 年 4 月 5 日，最后开放日的确认日为 2017 年 4

月6日。

截至本次清算期结束 2017 年 5 月 4 日，本基金剩余财产为人民币 2,846,042.36 元。自本次清算期结束日次日 2017 年 5 月 5 日至本次清算款划出前一日的银行存款产生的利息（包括基金管理人垫付资金本金产生的利息）亦归基金份额持有人所有。

（六）基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后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析。

六、 备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金财务审计报告》；
- 2、《中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

中海安鑫宝 1 号保本混合型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇一七年六月九日