

创金合信聚财保本混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

一、重要提示

创金合信聚财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”）证监许可[2015]2430号《关于准予创金合信聚财保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，并于2015年11月16日正式成立。

本基金为保本基金，第一个保本周期的担保人为中国投融资担保有限公司，第一个保本周期（18个月）到期日为2017年5月16日。根据中国证监会2017年2月10日发布的《关于避险策略基金的指导意见》（以下简称“指导意见”），存续保本基金在保本周期到期后，应当符合《指导意见》的规定，调整产品保障机制并更名为“避险策略基金”，否则应转为其他类型的基金或予以清算。《基金合同》第二十一部分“一、保本周期到期后基金的存续形式”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，或不符法律法规和《基金合同》对基金的存续要求，则本基金将根据《基金合同》的规定进入清算程序并终止。”

根据《指导意见》的规定及《基金合同》的约定，经与担保人中国投融资担保有限公司协商一致，本基金第一个保本周期到期后，公司不再与本基金的担保人进行第二个保本周期的合作事宜，基金管理人也未能找到其他适合的担保机构，故本基金不再满足保本基金存续条件，也无法按照《指导意见》关于避险策略基金的运作机制进行调整，本公司决定于本基金第一个保本周期到期后对其进行清算。

本基金已于2017年5月5日、2017年5月12日、2017年5月15日在指定媒体就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告和提示性公告，详见《创金合信基金管理有限公司关于创金合信聚财保本混合型证券投资基金终止基金合同的公告》、《创金合信基金管理有限公司关于创金合信聚财保本混合型证券投资基金终止基金合同的第一次提示性公告》和《创金合信基金管理有限公司关于创金合信聚财保本混合型证券投资基金终止基金合同的第二次提示性公告》。

本基金从2017年5月17日起进入清算期，由基金管理人创金合信基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、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5月17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报告出具法律意见。

二、基金概况

- 1、基金名称：创金合信聚财保本混合型证券投资基金（基金简称：创金合信聚财保本混合；基金代码：001977）
- 2、基金类型：保本混合型证券投资基金
- 3、基金托管人：招商银行股份有限公司
- 4、基金运作方式：契约型开放式。以定期开放的方式运作，以每十八个月为一个保本周期，即在保本周期内封闭式运作（保本周期到期日除外），期间不开放申购及赎回；开放期为保本周期到期日及之后的4个工作日，其中开放期首个工作日同时开放申购和赎回，其余开放日仅开放申购业务
- 5、投资目标：本基金采取恒定比例组合保险策略，通过动态调整资产组合，在确保保本周期内本金安全的前提下，力争实现基金资产的稳定增值
- 6、风险收益特征：本基金为保本混合型基金，属证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金
- 7、基金发售时间：2015年11月6日至2015年11月12日
- 8、基金合同生效日：2015年11月16日

9、成立规模及户数：成立规模为 280,328,286.75 份，有效认购户数为 10,723 户

10、基金的保本：

(1) 保本周期：每十八个月，首个保本周期到期日为 2017 年 5 月 16 日

(2) 保证人：中国投融资担保有限公司

(3) 保本保障机制：不可撤销的连带责任担保

11、最后运作日、运作终止日：2017 年 5 月 16 日，即本基金第一个保本周期到期日

三、基金运作情况概述

创金合信聚财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”）证监许可[2015]2430 号《关于准予创金合信聚财保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由创金合信基金管理有限公司按照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信聚财保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期，首次募集期间为 2015 年 11 月 6 日至 2015 年 11 月 12 日，首次设立募集（不包括认购资金利息）280,266,800.00 元，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2015）第 1267 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2015 年 11 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 280,328,286.75 份，其中认购资金利息折合 61,486.75 份。

根据《指导意见》的规定及《基金合同》的约定，经与担保人中国投融资担保有限公司协商一致，本基金第一个保本周期到期后，公司不再与本基金的担保人进行第二个保本周期的合作事宜，基金管理人也未能找到其他适合的担保机构，故本基金不再满足保本基金存续条件，也无法按照《指导意见》关于避险策略基金的运作机制进行调整，本公司决定于本基金第一个保本周期到期后对其进行清算。

本基金从 2017 年 5 月 17 日起进入清算期，由基金管理人创金合信基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、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 5 月 17 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报告出具法律意见。

四、财务会计报告

资产负债表（已审计）

会计主体：创金合信聚财保本混合型证券投资基金

运作终止日：2017 年 5 月 16 日

单位：人民币元

资产 运作终止日：2017 年 5 月 16 日

资产：

银行存款 286,410,632.62

结算备付金 —

存出保证金 33,794.03

交易性金融资产 1,994,370.00

其中：股票投资 1,994,370.00

基金投资 —

债券投资 —

资产支持证券投资 —

| | |
|--------------------------------|----------------|
| 贵金属投资 | — |
| 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 | 14,680.53 |
| 应收股利 | — |
| 应收申购款 | — |
| 递延所得税资产 | — |
| 其他资产 | — |
| 资产总计 | 288,453,477.18 |
| 负债和所有者权益 运作终止日：2017 年 5 月 16 日 | |
| 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 | 101,097.23 |
| 应付托管费 | 31,592.89 |
| 应付销售服务费 | 12,637.14 |
| 应付交易费用 | 16,162.51 |
| 应交税费 | — |
| 应付利息 | — |
| 应付利润 | — |
| 递延所得税负债 | — |
| 其他负债 | 69,897.91 |
| 负债合计 | 231,387.68 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 280,328,286.75 |
| 未分配利润 | 7,893,802.75 |
| 所有者权益合计 | 288,222,089.50 |
| 负债和所有者权益总计 | 288,453,477.18 |

注：1、基金最后运作日 2017 年 5 月 16 日，基金份额净值 1.0282 元，基金份额总额 280,328,286.75 份。
2、本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师曹翠丽、边晓红签字出具了普华永道中天特审（2017）第 2009 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

自 2017 年 5 月 17 日至 2017 年 6 月 9 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

按照《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，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产

中支付。

从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金预先计提的相关费用不足以覆盖清算成本的情况下，将由基金管理人承担剩余费用。

（二）、保本到期日赎回情况

根据《基金合同》，本基金的开放期为保本周期到期日及之后 4 个工作日的时间内，故 2017 年 5 月 16 日（本基金第一个保本周期到期日）为开放期。本公司于 2017 年 5 月 17 日对份额持有人 5 月 16 日的赎回申请进行了确认，共计赎回份额 280,328,286.75 份，并于 2017 年 5 月 18 日支付赎回款共计 288,233,556.44 元。

（三）、资产清算情况

截至本次清算期结束日（2017 年 6 月 9 日），部分资产尚未收回或完成变现，为提高清算效率，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、 本基金最后运作日存出保证金为人民币 33,794.03 元，已由基金管理人于 2017 年 5 月 18 日以自有资金垫付至托管户。
- 2、 本基金最后运作日的应收利息为人民币 14,680.53 元，已由基金管理人于 2017 年 5 月 18 日以自有资金垫付至托管户。
- 3、 本基金最后运作日持有的停牌证券资产为人民币 1,994,370.00 元，该金额为各只停牌证券的最后运作日估值金额（其中停牌股票 600551 于 2017 年 4 月 19 日起进行了估值调整，该只股票的金额为运用指数收益法计算的金额）之和（单只停牌证券最后运作日估值金额=该只证券停牌价格或运用指数收益法计算的价格*证券数量）。具体情况如下：

（1）本基金最后运作日（2017 年 5 月 16 日）持有的全部停牌证券明细如下：

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 证券数量（股） | 停牌价格/指数收益法价格（元） | 最后运作日估值金额（元） |
|----|--------|------|---------|-----------------|--------------|
| 1 | 600551 | 时代出版 | 29,000 | 16.19 | 469,510.00 |
| 2 | 002675 | 东诚药业 | 73,000 | 14.30 | 1,043,900.00 |
| 3 | 300367 | 东方网力 | 24,000 | 20.04 | 480,960.00 |

（2）本次清算期间停牌证券复牌及处置情况：

截至本次清算期结束日（2017 年 6 月 9 日），本基金所持有的停牌证券部分复牌：

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 证券数量（股） | 指数收益法价格（元） | 最后运作日估值金额（元） | 成交金额（元） | 交易费用 | 差额（元） |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|------------|--------|----------|
| 1 | 600551 | 时代出版 | 29,000 | 16.19 | 469,510.00 | 476,891.00 | 867.94 | 6,513.06 |

截止基金最后运作日，未变现的停牌证券资产共计人民币 1,994,370.00 元，为维护基金份额持有人利益并提高清算效率，基金管理人以自有资金垫付，该款项已于 2017 年 5 月 18 日垫付至托管账户。待停牌证券变现后，若本基金所持停牌证券变现合计金额高于基金管理人为本基金停牌证券垫付的金额，则将差额按运作终止日基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人；若本基金所持停牌证券变现合计金额小于基金管理人为本基金停牌证券垫付的金额，则由基金管理人承担相应损失。

（四）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 101,097.23 元，该款项已于 2017 年 5 月 31 日支付。
- 2、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 31,592.89 元，该款项已于 2017 年 5 月 31 日支付。
- 3、 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 12,637.14 元，该款项已于 2017 年 5 月 31 日支付。
- 4、 本基金最后运作日应付佣金为人民币 13,412.88 元，该款项已于 2017 年 5 月 31 日支付。
- 5、 本基金最后运作日应付银行间交易费用为人民币 2,749.63 元，该款项已于 2017 年 5 月 25 日及 31 日

支付。

6、 本基金最后运作日其他负债为人民币 69,897.91 元，为预提信息披露费、银行间账户维护费、清算审计费及汇划费。其中，预提信息披露费用为人民币 40,000.00 元，该款项已于 2017 年 5 月 31 日支付；预提银行间账务维护费为人民币 6,200.00 元，其中 6,000.00 元已于 2017 年 5 月 25 日及 31 日支付，剩余 200.00 元为上海清算所 4 至 5 月银行间查询服务费，已由上海清算所于 2017 年 5 月减免，并已于 5 月 25 日冲减损益；预提清算审计费为人民币 22,355.68 元，该款项已于 2017 年 5 月 31 日支付；预提汇划费 1,342.23 元，该款项已于 2017 年 6 月 7 日支付。

（五）清算期间的损益情况

自 2017 年 5 月 17 日至 2017 年 6 月 9 日清算期间

单位：人民币元

项目 金额

一、清算收益

1、利息收入-银行存款利息收入（注 1） 5,728.21

2、停牌证券复牌变现收益（注 2） 6,513.06

3、银行间账户维护费减免损益(注 3) 200.00

清算收益小计 12,441.27

二、清算费用

1、汇划手续费 270.00

清算费用小计 270.00

三、清算净收益 12,171.27

注 1：利息收入为以当前使用的利率预估计提的 2017 年 5 月 17 日的银行存款利息。清算起始日至清算款划出前一日之银行存款产生的利息归基金份额持有人所有，基金管理人 2017 年 5 月 18 日支付赎回款时已将该部分利息垫付给委托人。基金管理人垫付资金到账日（2017 年 5 月 18 日）起孳生的利息归基金管理人所有。

注 2：停牌证券复牌变现收益为 2017 年 5 月 26 日股票时代出版（600551）卖出时已扣除交易费用后的收益。

注 3：银行间账户维护费减免损益为 2017 年 5 月上海清算所对本基金 2017 年 4 至 5 月银行间查询服务费减免 200.00 元。

（六）剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2017 年 5 月 16 日基金净资产 288,222,089.50

加：四舍五入尾差补足款（注 1） 11,466.94

减：保本到期日赎回款 288,233,556.44

加：清算期间净收益 12,171.27

二：本次清算期结束日 2017 年 6 月 9 日基金净资产 12,171.27

注 1：保本到期日赎回款共计 288,233,556.44 元，根据《创金合信基金管理有限公司关于聚财保本混合型证券投资基金终止基金合同的公告》，若由于基金份额净值计算四舍五入而产生损失，由基金管理人承担相应损失。故由基金管理人于 2017 年 5 月 18 日补足资金 11,466.94 元用于支付赎回款。

根据本基金的基金合同约定，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，按运作终止日基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。

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，基金管理人有权于收到基金托管人通知

后当日内将款项补足。

（七）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，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。

六、备查文件

1、备查文件目录

（1）创金合信聚财保本混合型证券投资基金 2017 年 5 月 16 日财务报表及审计报告

（2）关于《创金合信聚财保本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至基金管理人的办公场所免费查阅。

创金合信聚财保本混合型证券投资基金财产清算小组

2017 年 7 月 18 日