

# 安信安盈保本混合型证券投资基金

## 清算报告

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年3月26日

## § 1 重要提示

安信安盈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12月21日证监许可【2015】3001号文准予募集注册，并经机构部函[2016]448号确认，自2016年3月9日起基金合同生效，本基金基金管理人为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《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》、《关于避险策略基金的指导意见》等法律法规的有关规定及《安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本基金首个保本周期（第一个保本周期自2016年3月9日起至2018年3月9日止）到期后，不再符合保本基金的存续条件，触发《基金合同》终止事由，安信基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）根据法律法规、《基金合同》的约定履行了基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2018年3月16日，并于2018年3月19日进入清算程序。

由本基金的基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成本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。

## § 2 基金概况

基金名称	安信安盈保本混合型证券投资基金
基金简称	安信安盈保本混合
基金主代码	002308
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月9日
报告期末(2018年3月16日)基金份额总额	75,447,461.30份
投资目标	在保证投资者本金的基础上，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面，本基金运用恒定比例组合保险（CPPI）原理，动态调整固定收益类资产与权益类资产的投资比例，通过对固定收益类资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全，通过对权益类资产的投资寻求保本周期内资产的稳定增值。固定收益投资方面，本基金通过对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，综合考虑各种市场因素，在确保基金资产收益安全性和稳定性的基础上，构造债券组合。权益资产投资方面，本基金在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化、以及上市公司成长潜力的

	基础上，通过优选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资。	
业绩比较基准	两年期银行定期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。	
公告依据	《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》、《关于避险策略基金的指导意见》等法律法规的有关规定及《安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同》	
基金管理人名称	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人名称	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信安盈保本混合 A	安信安盈保本混合 C
下属分级基金的交易代码	002308	005380
报告期末(2018年3月16日)下属分级基金的份额总额	75,447,358.46 份	102.84 份

### § 3 基金运作情况

本基金经中国证监会 2015 年 12 月 21 日证监许可【2015】3001 号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自 2016 年 2 月 15 日至 2016 年 3 月 4 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2016 年 3 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 1,857,619,160.76 份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合 963,126.22 份基金份额）。

根据《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》、《关于避险策略基金的指导意见》等法律法规的有关规定及《基金合同》的约定，本基金首个保本周期（第一个保本周期自 2016 年 3 月 9 日起至 2018 年 3 月 9 日止）到期后，不再符合保本基金的存续条件，触发《基金合同》终止事由，本基金管理人根据法律法规、《基金合同》的约定履行了基金财产清算程序。本基金的最后运作日为 2018 年 3 月 16 日，并于 2018 年 3 月 19 日进入清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

### § 4 财务会计报告

#### 4.1 最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：安信安盈保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018年3月16日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2018年3月16日
<b>资 产：</b>	
银行存款	176,597,740.09
结算备付金	374,293.11
存出保证金	165,975.31
交易性金融资产	1,072,757.00
其中：股票投资	1,072,757.00
应收利息	162,996.65
资产总计	178,373,762.16
负债和所有者权益	最后运作日 2018年3月16日
<b>负 债：</b>	
应付赎回款	96,329,780.78
应付管理人报酬	476,876.31
应付托管费	79,479.36
应付交易费用	222,661.18
其他负债	132,651.26
负债合计	97,241,448.89
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	75,447,461.30
未分配利润	5,684,851.97
所有者权益合计	81,132,313.27
负债和所有者权益总计	178,373,762.16

注：1、报告截止日2018年3月16日(基金最后运作日)，本基金A类基金份额净值1.0753元，本基金C类基金份额净值1.0750元，本基金份额总额75,447,461.30份，其中A类基金份额75,447,358.46份，C类基金份额102.84份。

2、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，注册会计师签字出具了安永华明(2018)专字第60962175\_H02号标准无保留意见的审计报告。

### §5 基金财产分配

自最后运作日(不含)起至2018年3月23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 本基金最后运作日结算备付金人民币 374,293.11 元，为存放于上海证券交易所和深圳证券交易所的结算备付金。该款项由基金管理人安信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 3 月 23 日划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币 165,975.31 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。该款项由基金管理人安信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 3 月 23 日划入托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 1,072,757.00 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)		
600309	万华化学	2017/12/5	重大事项	35.86	16,400	626,833.52	588,104.00
002507	涪陵榨菜	2017/12/4	重大事项	16.77	28,900	418,552.46	484,653.00

注：1、根据《安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同》第十六部分“基金资产估值”的约定，交易所上市的有价证券（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或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。流通受限证券万华化学（600309）最后运作日的估值单价按照指数收益法进行计算，具体可查阅《安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持万华化学（600309）估值调整的公告》；流通受限证券涪陵榨菜（002507）最后运作日的估值单价为停牌前一交易日的收盘价。

2、根据《安信基金管理有限责任公司关于安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同终止并进行基金财产清算的公告》，如保本到期日交易时间结束仍有持仓证券停牌，基金进入清算程序后，为了最大化保护基金份额持有人利益，提高清算效率，基金管理人将以自有资金按照基金所持有证券资产最后运作日的估值价格垫付基金未能变现的证券资产，具体清算规则按照相关规定办理。待停牌证券复牌后，为保证基金资产流动性，基金管理人将及时变现停牌证券。待全部停牌证券复牌并卖出变现后，若变现金额高于基金管理人垫付的金额，则将差额按基金份额持有人持有的基金份额比例追偿给基金份额持有人；若变现金额小于基金管理人垫付的金额，则由基

金管理人承担相应损失。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为人民币 162,996.65 元。其中应收银行存款利息人民币 138,517.97 元，应收结算备付金利息人民币 23,974.80 元，应收存出保证金利息人民币 503.88 元，上述应收利息及银行存款、结算备付金、存出保证金自 2018 年 3 月 17 日至 2018 年 3 月 20 日孳生的利息已于 2018 年 3 月 21 日结转至银行存款；银行存款、结算备付金、存出保证金自 2018 年 3 月 21 日至 2018 年 3 月 23 日孳生的利息由基金管理人安信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 3 月 23 日划入托管账户。

## 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 96,329,780.78 元，该款项已分别于 2018 年 3 月 19 日、2018 年 3 月 20 日及 2018 年 3 月 21 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 476,876.31 元，该款项将于 2018 年 3 月 23 日后支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 79,479.36 元，该款项将于 2018 年 3 月 23 日后支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 222,661.18 元，其中应付券商佣金为人民币 203,619.14 元，应付银行间交易手续费及结算费用为人民币 19,042.04 元，该款项将于 2018 年 3 月 23 日后支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 132,651.26 元，其中应付赎回费为人民币 23,351.26 元，该款项已分别于 2018 年 3 月 19 日、2018 年 3 月 20 日及 2018 年 3 月 21 日支付；预提 2017 年审计费为人民币 100,000.00 元，该款项将于 2018 年 3 月 23 日后支付；预提银行间账户维护费和查询费为人民币 9,300.00 元，该款项将于 2018 年 3 月 23 日后支付。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2018年3月17日起至2018年3月23日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	13,512.64
2、赎回费收入	814.14
清算收入小计	14,326.78
二、清算费用	
清算费用小计（注2）	-
三、清算净收益	14,326.78

注：1、利息收入系计提的自 2018 年 3 月 17 日起至 2018 年 3 月 23 日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息和结算备付金利息。其中 2018 年 3 月 17 日至 2018 年 3 月 20 日孳生的利息已于 2018 年 3 月 21 日结转至银行存款，2018 年 3 月 21 日至 2018 年 3 月 23 日孳生的利息

由基金管理人安信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 3 月 23 日划入托管账户。

2、根据《安信基金管理有限责任公司关于安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同终止并进行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承担。

#### 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3月16日基金净资产	81,132,313.27
加：清算期间净收益	14,326.78
减：基金净赎回转出金额（于2018年3月19日确认的投资者赎回转出申请）	37,963,861.41
二、2018年3月23日基金净资产	43,182,778.64

根据本基金的基金合同及《安信基金管理有限责任公司关于安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同终止并进行基金财产清算的公告》，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 23 日止的剩余财产为人民币 43,182,778.64 元，其中包括本基金管理人为了最大化保护基金份额持有人的利益而根据本基金所持停牌股票（万华化学、涪陵榨菜）最后运作日的估值价格垫付的等价现金。待上述股票变现后，若其变现金额高于该等股票最后运作日的估值价格，则该差额将按基金份额持有人持有的基金份额比例追偿给基金份额持有人，若变现金额小于该等股票最后运作日的估值价格，则由基金管理人承担相应损失。

截至 2018 年 3 月 23 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 44,070,495.49 元，其中人民币 1,615,645.65 元系基金管理人代垫的结算备付金、存出保证金、按照最后运作日的估值价格垫付基金未能变现的股票资产以及以当前适用的利率预估的银行存款、结算备付金及存出保证金截至 2018 年 3 月 23 日的利息。

自 2018 年 3 月 23 日至清算款划出前一日的归属于持有人的银行存款孳生的利息归份额持有人所有。基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2018 年 3 月 23 日垫付并于 2018 年 3 月 23 日划入托管账户人民币 1,615,645.65 元，用以垫付结算备付金、存出保证金、停牌股票资产及应收利息等，该笔垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

#### 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、《安信安盈保本混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、安信安盈保本混合型证券投资基金清算的法律意见

### 6.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 6.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信安盈保本混合型证券投资基金  
基金财产清算小组  
2018年3月26日