

# 东方荣家保本混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年4月19日

清算报告公告日：2018年6月8日

## 一、重要提示

东方荣家保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由东方基金管理有限责任公司担任基金管理人，由中国民生银行股份有限公司担任基金托管人。本基金根据2016年2月22日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东方荣家保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]300号）注册募集，根据《关于东方荣家保本混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2016]621号），基金合同于2016年3月29日正式生效。

本基金为保本基金，保本周期为24个月，本基金第一个保本周期自2016年3月29日起至2018年3月29日止，担保人由深圳市高新投集团有限公司担任。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》的相关规定，以及《东方荣家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，本基金不再满足保本基金的存续条件。本基金将于第一个保本周期到期后终止并依法对基金财产进行清算。为此，基金管理人于2018年3月14日、2018年3月19日和2018年3月26日在《中国证券报》、《证券日报》和基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）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《东方基金管理有限责任公司关于东方荣家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》、《东方基金管理有限责任公司关于东方荣家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第一次提示性公告》和《东方基金管理有限责任公司关于东方荣家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第二次提示性公告》。

根据上述公告，本基金自2018年4月10日起进入清算期，由基金管理人东方基金管理有限责任公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、立信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由立信会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金情况

### 1、基金基本情况

基金名称 东方荣家保本混合型证券投资基金

基金简称 东方荣家保本混合

基金主代码 002480

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年3月29日

基金管理人 东方基金管理有限责任公司

基金托管人 中国民生银行股份有限公司

基金合同存续期 不定期

### 2、基金产品说明

#### 投资目标

运用保本策略，通过动态调整股票与债券等资产的组合，在有效控制投资风险、确保保本周期内本金安全的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。

#### 投资策略

本基金运用 CPPI 固定比例投资组合保险机制，动

态分配基金资产在权益类资产和固定收益类资产上的投资比例。

业绩比较基准 两年期银行定期存款收益率(税后)  
风险收益特征

本基金为保本混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金和债券型基金，但低于股票型基金、非保本混合型基金，属于低风险水平的投资品种。

### 三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：东方荣家保本混合型证券投资基金

最后运作日：2018年4月9日

金额单位：人民币元

资 产 最后运作日

2018年4月9日

资 产：

银行存款 66,579,768.00

结算备付金 -

存出保证金 -

交易性金融资产 -

其中：股票投资 -

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 76,839.43

应收股利 -

应收申购款 -

递延所得税资产 -

其他资产 -

资产总计 66,656,607.43

负债和所有者权益 最后运作日

2018年4月9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 38,919,791.11

应付管理人报酬 -  
应付托管费 -  
应付销售服务费 -  
应付交易费用 69,501.53  
应交税费 45,947.74  
应付利息 -  
应付利润 -  
递延所得税负债 -  
其他负债 104,500.00  
负债合计 39,139,740.38  
所有者权益：  
实收基金 25,756,960.23  
未分配利润 1,759,906.82  
所有者权益合计 27,516,867.05  
负债和所有者权益总计 66,656,607.43

注：至基金最后运作日 2018 年 4 月 9 日，基金份额净值 1.0683 元，基金份额总额 25,756,960.23 份。

#### 四、清算报表附注

##### 1、基金基本情况

东方荣家保本混合型证券投资基金根据 2016 年 2 月 22 日中国证监会《关于准予东方荣家保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]300 号）和《关于东方荣家保本混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2016]621 号）的核准，由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方荣家保本混合型证券投资基金基金合同》自 2016 年 3 月 7 日至 2016 年 3 月 25 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 419,867,562.82 元人民币，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2016]第 01300005 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方荣家保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 419,947,991.98 份基金单位，其中认购资金利息折合 80,429.16 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方荣家保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

根据《东方荣家保本混合型证券投资基金基金合同》及东方基金管理有限责任公司于 2018 年 3 月 14 日发布的《东方基金管理有限责任公司关于东方荣家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》，本基金保本周期为 24 个月，第一个保本周期的到期日为 2018 年 3 月 29 日。根据《基金合同》的约定，自 2018 年 3 月 29 日（含）至 2018 年 4 月 9 日（含）为本基金的到期操作期间，共计 6 个工作日，基金份额持有人可在该期间赎回或转换转出本基金基金份额；未能在该期间赎回或转换转出的基金份额，将全部进入清算程序。

##### 2、清算原因

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》的相关规定，以及《东方荣家保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金不再满足保本基金的存续条件。

##### 3、清算起始日

根据《东方基金管理有限责任公司关于东方荣家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》，本基金清算起始日为2018年4月10日。

#### 4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

#### 五、清算情况

自2018年4月10日至2018年4月19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：

##### 1、清算费用

按照《东方荣家保本混合型证券投资基金基金合同》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，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。但从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的审计费用、律师费用由基金管理人承担，银行汇划费用等从基金财产中列支。

##### 2、资产处置情况

本基金最后运作日应收利息为人民币76,839.43元，该款项由基金管理人东方基金管理有限责任公司自有资金垫付，并将于清算款划出日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

##### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币69,501.53元，该款项将于2018年4月19日后支付。

(2) 本基金最后运作日应交税费为人民币45,947.74元，该款项已于2018年4月10日支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币104,500.00元，为预提信息披露费及银行间账户维护费。其中，预提审计费60,000.00元将于2018年4月19日后支付；预提信息披露费为人民币40,000.00元将于2018年4月19日后支付；预提银行间账户维护费为人民币4,500.00元将于2018年4月19日后支付。

##### 4、保本到期日赎回情况

根据《东方荣家保本混合型证券投资基金基金合同》及东方基金管理有限责任公司于2018年3月14日发布的《东方基金管理有限责任公司关于东方荣家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》，自2018年3月29日（含）至2018年4月9日（含）为本基金的到期操作期间，共计6个工作日，基金份额持有人可在该期间赎回或转换转出本基金基金份额，2018年4月10日，确认赎回及转出份额14,384,105.45份，应付赎回及转出款15,366,539.90元。应付赎回及转出款已于2018年4月12日完成支付。

##### 5、清算期间的清算损益情况

金额单位：人民币元

项目 2018年4月10日至2018年4月19日

一、清算收益① 4,440.12

1、存款利息收入 4,440.12

减：二、清算费用② 3,925.00

1、银行划款手续费 620.00

2、债券账户维护费 3,300.00

3、交易手续费 5.00

三、清算期间净收益 ①-H② 515.12

注：利息收入系自2018年4月10日至2018年4月19日清算期间计提的银行存款利息。

##### 6、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

金额单位：人民币元

项目 2018 年 4 月 10 日至 2018 年 4 月 19 日

#### 一、最后运作日 2018 年 4 月 9 日基金

净资产 27,516,867.05

加：清算期间净收益 515.12

减：赎回转出款 15,366,539.90

二、2018 年 4 月 19 日基金净资产 12,150,842.27

资产处置及负债清偿后，2018 年 4 月 19 日本基金剩余财产为人民币 12,150,842.27 元，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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日 2018 年 4 月 10 日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。基金管理人将在清算款划出日划入托管账户垫付款，用以垫付应收利息等，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

#### 7、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

#### 六、备查文件目录

##### 1、备查文件目录

- (1) 《东方荣家保本混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《东方荣家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

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）查阅。

##### 3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

东方荣家保本混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2018 年 6 月 8 日