

山西证券保本混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：山西证券股份有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告出具日期：二〇一八年五月十八日

清算报告公告日期：二〇一八年七月二十一日

§1 重要提示

山西证券保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2016]558号《关于准予山西证券保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由山西证券股份有限公司作为基金管理人自2016年4月5日至2016年4月27日止期间向社会公开募集,募集期结束经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具中喜验字【2016】第0193号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年5月4日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。本基金的基金管理人为山西证券股份有限公司,份额登记机构为山西证券股份有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

山西证券保本混合型证券投资基金为保本基金,保本周期一般为两年,第一个保本周期自2016年5月4日起至2018年5月4日止。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》、《山西证券保本混合型证券投资基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)及监管机构的相关规定,如保本周期届满时,本基金未能符合保本基金存续条件,则本基金将根据《基金合同》的约定直接进入清算程序并终止《基金合同》。

根据2017年1月24日中国证监会发布的《关于避险策略基金的指导意见》(简称“《意见》”),现有保本基金在保本周期到期后若不能变更注册为避险策略基金,均需转型为其他类型基金或清盘。鉴于本基金不再符合保本基金的存续条件且未转型为其他类型基金,因此,在第一个保本周期到期后,本基金将按照《意见》的要求并根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止。本基金的到期期间为保本周期到期日及之后5个工作日(含第5个工作日),即2018年5月4日(含)至2018年5月11日(含)。本基金最后运作日为2018年5月11日,自2018年5月12日进入清算期。

由基金管理人山西证券股份有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、中喜会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰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,并由中喜会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金简称	山西证券保本基金
基金主代码	002589
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年05月04日
报告期末(2018年5月11日)基金份额总额	26,060,152.77份
投资目标	控制投资者本金损失风险，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	本基金通过固定比例投资组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）策略和时间不变性投资组合保险（TIPP，Time Invariant Portfolio Protection）策略，在保本周期中，对资产配置进行优化动态调整，确保投资者的投资本金的安全性。同时，本基金通过积极稳健的收益资产投资策略，竭力为基金资产获取更高的增值回报。
业绩比较基准	两年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，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。
基金管理人	山西证券股份有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

山西证券保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2016]558号《关于准予山西证券保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由山西证券股份有限公

司作为基金管理人自 2016 年 4 月 5 日至 2016 年 4 月 27 日止期间向社会公开募集,募集期结束经中喜会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具中喜验字【2016】第 0193 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 5 月 4 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期。本基金的基金管理人为山西证券股份有限公司,份额登记机构为山西证券股份有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

山西证券保本混合型证券投资基金为保本基金,保本周期一般为两年,第一个保本周期自 2016 年 5 月 4 日起至 2018 年 5 月 4 日止。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》、《山西证券保本混合型证券投资基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)及监管机构的相关规定,如保本周期届满时,本基金未能符合保本基金存续条件,则本基金将根据《基金合同》的约定直接进入清算程序并终止《基金合同》。

根据 2017 年 1 月 24 日中国证监会发布的《关于避险策略基金的指导意见》(简称“《意见》”),现有保本基金在保本周期到期后若不能变更注册为避险策略基金,均需转型为其他类型基金或清盘。鉴于本基金不再符合保本基金的存续条件且未转型为其他类型基金,因此,在第一个保本周期到期后,本基金将按照《意见》的要求并根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止。本基金的到期期间为保本周期到期日及之后 5 个工作日(含第 5 个工作日),即 2018 年 5 月 4 日(含)至 2018 年 5 月 11 日(含)。本基金最后运作日为 2018 年 5 月 11 日,自 2018 年 5 月 12 日进入清算期。

由基金管理人山西证券股份有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、中喜会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰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,并由中喜会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§4 财务报告

4.1 资产负债表(经审计)

会计主体:山西证券保本混合型证券投资基金

报告截止日:2018 年 5 月 11 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2018年5月11日
资 产：	
银行存款	35,753,339.20
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
应收利息	354,544.60
资产总计	36,107,883.80
负债和所有者权益	最后运作日 2018年5月11日
负 债：	
应付赎回款	9,122,568.40
应付管理人报酬	214,481.08
应付托管费	35,746.85
应付销售服务费	41,560.88
应付交易费用	29,961.50
应交税费	1,671.81
其他负债	115,000.00
负债合计	9,560,990.52
所有者权益：	
实收基金	26,060,152.77
未分配利润	486,740.51
所有者权益合计	26,546,893.28
负债和所有者权益总计	36,107,883.80

注：1，报告截止日 2018 年 5 月 11 日（基金最后运作日），基金份额总额 26,060,152.77 份。其中 A 类基金份额单位净值 1.009 元，基金份额 7,618,353.64 份；C 类基金份额单位净值 1.023 元，基金份额 18,441,799.13 份。

2，本财务报告已经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师白银泉、武丹签字出具了中喜专审字【2018】第 0663 号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

自 2018 年 5 月 12 日至 2018 年 5 月 18 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 本基金最后运作日应收利息为人民币 354,544.60 元。其中应收银行存款利息人民币 354,518.41 元，应收存出保证金利息人民币 26.19 元，上述款项由基金管理人山西证券股份有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 5 月 18 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 9,122,568.40 元，该款项已于 2018 年 5 月 14 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理费为人民币 214,481.08 元，该款项已于 2018 年 5 月 16 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 35,746.85 元，该款项已于 2018 年 5 月 16 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 41,560.88 元，该款项已于 2018 年 5 月 16 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 29,961.50 元，该款项将于 2018 年 5 月 18 日后支付。

5.2.6 本基金最后运作日应交税费为人民币 1,671.81 元，其中应交增值税为 1,492.69 元，应交增值税附加税为 179.12 元，该款项已于 2018 年 5 月 15 日支付。

5.2.7 本基金最后运作日其他负债为人民币 115,000.00 元，为预提信息披露费及审计费。其中预提信息披露费为 100,000.00 元，该款项已于 2018 年 5 月 16 日支付；预提审计费为 15,000.00 元，该款项已于 2018 年 5 月 17 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	单位：人民币元
	自2018年5月12日至2018年5月18日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	10,113.51
清算收入小计	10,113.51
二、清算费用	
清算费用小计（注2）	-
三、清算净收益	10,113.51

注1：利息收入系计提的自2018年5月12日至2018年5月18日止清算期间的银行存款利息。

注2：根据《山西证券股份有限公司关于山西证券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支付。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

项目	单位：人民币元
	金额
一、最后运作日2018年5月11日基金净资产	26,546,893.28
加：清算期间净收益	10,113.51
减：基金净赎回转出金额（于2018年5月14日确认的投资者赎回转出申请）	7,607,134.80
二、2018年5月18日基金净资产	18,949,871.99

根据本基金的基金合同及《山西证券股份有限公司关于山西证券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5月18日止的剩余财产为人民币18,949,871.99元，其中A类7,125,866.58元，C类11,824,005.41元。

清算起始日2018年5月12日至清算款划出日前一日的应收利息亦属份额持有人所有。以上利息均按实际适用的利率计算，由基金管理人以自有资金垫付并将于清算款划出前划入托管账户。

截至 2018 年 5 月 18 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 18,969,719.98 元，其中人民币 354,544.60 元系基金管理人代垫的应收利息。

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、《山西证券保本混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《山西证券保本混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

山西证券保本混合型证券投资基金
基金财产清算小组

二〇一八年七月二十一日