

创金合信鑫安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：中国工商银行股份有限公司

一、重要提示

创金合信鑫安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[2016]488号《关于准予创金合信鑫安保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，并于2016年5月11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北京首创融资担保有限公司，第一个保本周期（两年）到期日为2018年5月11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》第十二部分“三、保本周期到期（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，或不符合法律法规和《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，经与担保人北京首创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2018年4月19日、2018年4月20日，2018年4月21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鑫安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》、《创金合信基金管理有限公司关于创金合信鑫安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《创金合信基金管理有限公司关于创金合信鑫安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》。

本基金从2018年5月19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、基金托管人中国工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2018年5月19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：创金合信鑫安保本混合型证券投资基金（基金简称：创金合信鑫安保本混合；基金代码：002565）

2、基金类型：保本混合型证券投资基金

3、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

4、基金运作方式：契约型开放式

5、投资目标：本基金通过运用投资组合保险技术控制本金损失的风险，并力争实现基金资产的稳健增值。

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。

7、基金发售时间：2016年4月15日至2016年5月6日

8、基金合同生效日：2016年5月11日

9、成立规模及户数：成立规模为1,265,842,004.20份，有效认购户数为10,305户

10、基金的保本：

（1）保本周期：每两年，首个保本周期到期日为2018年5月11日

（2）保证人：北京首创融资担保有限公司

（3）保本保障机制：不可撤销的连带保证责任

11、到期操作期：保本周期到期日及之后5个工作日（含第5个工作日），共6个工作日，即2018年5月11日至2018年5月18日

12、最后运作日、运作终止日：2018年5月18日

三、财务会计报告

资产负债表（已审计）

会计主体：创金合信鑫安保本混合型证券投资基金

运作终止日：2018年5月18日

单位：人民币元

资产	运作终止日：2018年5月18日
资产：	
银行存款	125,281,542.44
结算备付金	3,890.95
存出保证金	76,243.29
交易性金融资产	2,020,630.00
其中：股票投资	2,020,630.00
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	16,062.50
应收利息	88,369.05
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	127,486,738.23
负债和所有者权益	运作终止日：2018年5月18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	24,977,881.57
应付管理人报酬	260,799.05
应付托管费	43,466.50
应付销售服务费	56,372.76
应付交易费用	36,460.88
应交税费	21,574.82
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	87,648.63
负债合计	25,484,204.21
所有者权益：	
实收基金	95,740,662.86
未分配利润	6,261,871.16
所有者权益合计	102,002,534.02
负债和所有者权益总计	127,486,738.23

注：1、基金最后运作日 2018 年 5 月 18 日，基金份额净值 1.065 元，基金份额总额 95,740,662.86 份。其中 A 类基金份额的份额总额为 72,673,734.68 份，份额净值 1.068 元；C 类基金份额的份额总额为 23,066,928.18 份，份额净值 1.056 元。

2、本财务报表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字（2018）第 2185 号标准无保留意见的审计报告。

四、基金财产分配

自 2018 年 5 月 19 日至 2018 年 6 月 22 日为本次清算期间，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）、保本操作期赎回情况

根据《基金合同》，本基金到期操作期为保本周期到期日及之后5个工作日（含第5个工作日），共6个工作日，即2018年5月11日（（本基金第一个保本周期到期日））至2018年5月18日为到期操作期。本公司对份额持有人于到期操作期期间的赎回申请进行了确认，共计赎回份额580,140,428.00份，转出份额474,437.90份，支付赎回款618,342,565.43元，转出款507,174.12元。

（三）、资产清算情况

截至本次清算期结束日（2018年6月22日），部分资产尚未收回或完成变现，为维护基金份额持有人利益并提高清算效率，基金管理人拟以自有资金对其中部分资产进行垫付。各项资产清算情况如下：

- 1、本基金最后运作日结算备付金为人民币3,890.95元，已于2018年6月4日收到。
- 2、本基金最后运作日存出保证金为人民币76,243.29元，已于2018年6月4日收到。
- 3、本基金最后运作日应收证券清算款为人民币16,062.50元，已于2018年5月21日收到。
- 4、本基金最后运作日的应收利息为人民币88,369.05元，已于2018年6月21日收到。
- 5、本基金最后运作日持有的未能变现的流通受限资产共计人民币2,020,630.00元，包括因停牌而流通受限的股票1,624,514.00元，因其他原因流通受限的股票396,116.00元。具体情况如下：

（1）本基金最后运作日（2018年5月18日）持有的全部停牌股票明细如下：

序号	证券代码	证券名称	证券数量 (股)	停牌价格(元)	最后运作日估值 金额(元)
----	------	------	-------------	---------	------------------

1	600022	山东钢铁	550,000	2.02	1,111,000.00
2	600221	海航控股	25,700	3.25	83,525.00
3	600309	万华化学	5,300	36.44	193,132.00
4	600682	南京新百	800	33.28	26,624.00
5	000156	华数传媒	2,200	11.40	25,080.00
6	000415	渤海金控	7,200	5.84	42,048.00
7	000540	中天金融	16,500	4.87	80,355.00
8	000723	美锦能源	2,200	5.43	11,946.00
9	002252	上海莱士	2,600	19.54	50,804.00

(2) 本基金最后运作日（2018年5月18日）持有的因其他原因流通受限的股票明细如下：

序号	证券代码	证券名称	证券数量 (股)	市价(元)	最后运作日估值 金额(元)
1	002122	*ST 天马	60,200	6.58	396,116.00

注 1：002122 因复牌后持续开盘跌停而流通受限。

(3) 本次清算期间流通受限股票解除限制及处置情况：

截至本次清算期结束日（2018年6月22日），本基金所持有的流通受限股票部分解除限制：

序号	证券代码	证券名称	证券数量 (股)	最后运作日估值 金额(元)	成交金额 (元)	交易费用	差额(元)
1	600309	万华化学	5,300	193,132.00	231,610.00	352.05	38,125.95
2	600682	南京新百	800	26,624.00	26,200.00	39.84	-463.84
3	002122	*ST 天马	60,200	396,116.00	115,584.00	161.81	-280,693.81

截至本次清算期结束日，未变现的停牌股票共计人民币 1,404,244.00 元（以股票停牌价

估值)。在基金剩余财产分配前，为维护基金份额持有人利益并提高清算效率，对于仍未变现的停牌股票，基金管理人将予以垫付处理，基金管理人垫付资金到账起孳生的利息归基金管理人所有；对于已复牌并变现的股票，将以实际变现金额为准分配给持有人。待所有停牌股票复牌并变现完毕后，清算小组将对变现资产进行核算并进行后续处理。

（四）负债清偿情况

1、 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 24,977,881.57 元，该款项已于 2018 年 5 月 21 日支付。

2、 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 260,799.05 元，该款项已于 2018 年 5 月 29 日支付。

3、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 43,466.50 元，该款项已于 2018 年 5 月 29 日支付。

4、 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 56,372.76 元，该款项已于 2018 年 5 月 29 日支付。

5、 本基金最后运作日应付税费 21,574.82 元，该款项已于 2018 年 5 月 29 日支付。

6、 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 36,460.88 元，其中银行间交易费用为人民币 19,108.34 元，该款项分别于 2018 年 5 月 29 日、2018 年 6 月 1 日支付；应付佣金为人民币 17,352.54 元，该款项已分别于 2018 年 5 月 29 日、2018 年 6 月 13 日支付。

7、 本基金最后运作日其他负债为人民币 87,648.63 元，为预提信息披露费、银行间账户维护费、清算审计费及应付赎回费。其中，预提信息披露费用为人民币 45,000.00 元，该款项已于 2018 年 5 月 29 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 2018 年 5 月 29 日支付，剩余 200.00 元将于收到上海清算所的付款单后支付；预提清算审计费为人民币 35,000.00 元，该款项已于 2018 年 5 月 29 日支付；应付赎回费为人民币 1,448.63 元，该款项已于 2018 年 5 月 21 日支付。

（五）清算期间的损益情况

自 2018 年 5 月 19 日至 2018 年 6 月 22 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）	62,012.19
2、流通受限股票解除限制变现收益（注2）	-243,031.70
3、股票红利收入	462.60
4、公允价值变动损益（注3）	-514.00
清算收益小计	-181,070.91
二、清算费用	
1、清算律师费	-20,000.00
2、汇划手续费	-82.00
3、股票红利税补缴	-850.00
4、赎回费支出	-916.56
清算费用小计	-21,848.56
三、清算净收益	-202,919.47

注1：利息收入为以当前使用的利率预估计提的清算期的银行存款利息。该部分利息归基金份额持有人所有，基金管理人将于基金剩余财产分配前对尚未结息部分予以垫资。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。

注2：流通受限股票解除限制变现收益为股票万华化学（600309）、南京新百（600682）和*ST 天马（000063）卖出时已扣除交易费用后的收益。

注3：公允价值变动损益为股票海航控股（600221）分红导致的价值变动。

（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 2018 年 5 月 18 日基金净资产	102,002,534.02
减：最后运作日赎回款	-14,269,297.10
加：清算期间净收益	-202,919.47
二：本次清算期结束日 2018 年 6 月 22 日基金净资产	87,530,317.45

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。

五、备查文件

1、备查文件目录

- （1）创金合信鑫安保本混合型证券投资基金 2018 年 5 月 18 日财务报表及审计报告
- （2）关于《创金合信鑫安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。

创金合信鑫安保本混合型证券投资基金财产清算小组

2018 年 8 月 24 日