

# 安信保证金交易型货币市场基金 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：招商证券股份有限公司

清算报告出具日：2018年08月09日

清算报告公告日：2018年09月27日

## § 1 重要提示

安信保证金交易型货币市场基金（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”）2016年6月2日下发的证监许可[2016]1207号文准予募集注册，并经机构部函[2016]2164号确认，自2016年9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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

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》等法律法规的有关规定及《安信保证金交易型货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本基金于2018年6月29日至2018年7月27日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止安信保证金交易型货币市场基金基金合同有关事项的议案》，此次基金份额持有人大会的计票于2018年7月31日在本基金托管人招商证券股份有限公司授权代表的监督及上海通力律师事务所的见证下进行，并由北京市长安公证处对计票过程及结果进行了公证。根据表决结果，本次会议议案有效通过，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。根据《关于终止安信保证金交易型货币市场基金基金合同有关事项的议案的说明》，表决生效并公告的下一工作日起，本基金进入清算程序，即本基金的最后运作日为2018年8月2日，并于2018年8月3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 基金基本情况

基金名称	安信保证金交易型货币市场基金
基金简称	安信货币
场内简称	安信货币
基金主代码	511680
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月9日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

报告期末基金份额总额	87,886.60 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 9 月 27 日
投资目标	在力争保持基金资产相对低风险和相对高流动性的前提下，追求高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	久期配置上，本基金根据对未来利率变动的合理预判，结合基金未来现金流的综合预期，动态决定和调整投资组合平均剩余期限。类属配置上，通过对各类别金融工具政策倾向、税收政策、信用等级、收益率水平、资金供求、流动性等因素的研究判断，来确定并动态调整投资组合国债、央行票据、债券回购、非金融企业债务融资工具及现金等各类属品种的配置比例。个券选择上，优先选择高信用等级的流动性好的债券品种，并对低估值品种进行重点关注。此外，本基金还会采用套利策略、回购策略、流动性管理策略，在保持高流动性的基础上，把握无风险套利机会，获取安全的超额收益。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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》等法律法规的有关规定及《安信保证金交易型货币市场基金基金合同》、《关于终止安信保证金交易型货币市场基金基金合同有关事项的议案》
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	招商证券股份有限公司
最后运作日：	2018 年 8 月 2 日
最后运作日资产份额总额：	87,886.60 份

### § 3 基金运作情况

安信保证金交易型货币市场基金（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”）2016年6月2日下发的证监许可[2016]1207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9月1日至2016年9月5日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2016年9月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为1,798,683,750.00份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合87,750.00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》等法律法规的有关规定及《基金合同》、《关于终止安信保证金交易型货币市场基金基金合同有关事项的议案》、《关于终止安信保证金交易型货币市场基金基金合同有关事项的议案的说明》的约定本基金的最后运作日为2018年8月2日，并于2018年8月3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 最后运作日资产负债表

#### 1.1 最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：安信保证金交易型货币市场基金

报告截止日：2018年8月2日

单位：人民币元

资 产	2018年8月2日（最后运作日）
<b>资 产：</b>	
银行存款	8,805,267.87
券商户存款	-
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	-
应收银行存款利息	-

应收券商户存款利息	-
应收利息	18,705.02
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>8,823,972.89</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负 债:</b>	
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	144.46
应付托管费	48.16
应付销售服务费	120.38
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
预提上市费	35,000.00
<b>负债合计</b>	<b>35,313.00</b>
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	8,788,659.89
未分配利润	-
<b>所有者权益合计</b>	<b>8,788,659.89</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>8,823,972.89</b>

注：1、报告截止日 2018 年 8 月 2 日，本基金份额净值 100.00 元，基金份额总额 87,886.60 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\_H07 号标准无保留意见的审计报告。

## § 5 基金财产分配

自最后运作日后至 2018 年 8 月 9 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 18,705.02 元。其中应收银行存款利息人民币 18,705.02 元，该款项预计将由基金管理人安信基金管理有限责任公司以自有资金在支付清盘款之日进行垫付。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 144.46 元，该款项已于 2018 年 8 月 6 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 48.16 元，该款项已于 2018 年 8 月 6 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 120.38 元，该款项已于 2018 年 8 月 6 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日预提上市费为人民币 35,000.00 元，该款项已于 2018 年 8 月 8 日支付。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2018年8月3日至2018年8月9日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入	2,941.48
2、赎回费收入	-
清算收入小计	2,941.48
二、清算费用	
清算费用小计	-
三、清算净收益	2,941.48

注：1、利息收入系计提的自 2018 年 8 月 3 日至 2018 年 8 月 9 日止清算期间的银行存款利息，该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。

2、根据《关于终止安信保证金交易型货币市场基金基金合同有关事项的议案的说明》，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8月2日基金净资产	8,788,659.89
加：清算期间净收益	2,941.48
二、2018年8月9日基金净资产	8,791,601.37

依据《关于终止安信保证金交易型货币市场基金基金合同有关事项的议案的说明》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（本基金清算费用由基金管理人代为支付）、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 8 月 9 日止的剩余财产为人民币 8,791,601.37 元。

自 2018 年 8 月 10 日至清算款划出日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垫付的银行存款自资金到账日起至托管户销户为止孳生的利息归基

金管理人所有，在资产完全变现后向基金管理人支付垫付资金。

## 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

### 1.2 备查文件目录

- 1、《安信保证金交易型货币市场基金清算审计报告》
- 2、《通力律师事务所关于〈安信保证金交易型货币市场基金清算报告〉的法律意见》

### 1.3 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 1.4 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>

安信保证金交易型货币市场基金  
基金财产清算小组  
二〇一八年八月九日