

# 安信沪深 300 指数增强型发起式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：2019 年 10 月 25 日

清算报告公告日：2019 年 12 月 17 日

## § 1 重要提示

安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（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”）2016 年 7 月 13 日证监许可【2016】1591 号文准予募集注册，并经机构部函[2016]2473 号确认，自 2016 年 10 月 12 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》等法律法规的有关规定及《安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，基金合同生效满 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。2019 年 10 月 12 日为本基金《基金合同》生效满 3 年后的对应日，且本基金的基金资产净值低于 2 亿元，触发《基金合同》中约定的上述终止条款。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，在基金合同终止事由出现后终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，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 2019 年 10 月 12 日，并于 2019 年 10 月 13 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 安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

基金简称 安信沪深 300 增强

基金主代码 003261

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016 年 10 月 12 日

报告期末(2019 年 10 月 12 日)基金份额总额 16,569,947.70 份

投资目标 本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。

投资策略 股票投资上，本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。债券投资上，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线

变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。股指期货投资上，本基金以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。资产支持

证券投资上，对部分高质量的资产支持证券采用买入并持有到期策略，实现基金资产增值增厚。

业绩比较基准 95%\*沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

风险收益特征 本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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《安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的约定

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 安信沪深 300 增强 A 安信沪深 300 增强 C

下属分级基金的交易代码 003261 003262

报告期末(2019 年 10 月 12 日)下属分级基金的份额总额 14,236,886.51 份 2,333,061.19 份

### § 3 基金运作情况

安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（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”）2016 年 7 月 13 日证监许可【2016】1591 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 5 至 2016 年 9 月 23 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2016 年 10 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 12,614,138.32 份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合 1,309.48 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》的约定，基金合同生效满 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。2019 年 10 月 12 日为本基金《基金合同》生效满 3 年后的对应日，且本基金基金资产净值低于 2 亿元，触发《基金合同》中约定的上述终止条款。本基金管理人根据法律法规、《基金合同》的约定，在基金合同终止事由出现后终止基金合同并依法履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日为 2019 年 10 月 12 日，并于 2019 年 10 月 13 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：安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 10 月 12 日

单位：人民币元

资 产 最后运作日 2019 年 10 月 12 日

资 产：

银行存款 1,286,496.36

结算备付金 300,100.59

存出保证金 3,748.90

交易性金融资产 18,443,678.50

其中：股票投资 18,443,678.50

应收利息 787.16

证券清算款 62,409.90

资产总计 20,097,221.41  
负债和所有者权益 最后运作日 2019 年 10 月 12 日  
负 债：  
应付赎回款 87,694.00  
应付管理人报酬 6,475.40  
应付托管费 1,295.09  
应付销售服务费 461.75  
应付交易费用 53,093.65  
其他负债 25,578.41  
负债合计 174,598.30  
所有者权益：  
实收基金 16,569,947.70  
未分配利润 3,352,675.41  
所有者权益合计 19,922,623.11  
负债和所有者权益总计 20,097,221.41

注：1、报告截止日 2019 年 10 月 12 日(基金最后运作日)，本基金 A 类基金份额净值 1.2044 元，本基金 C 类基金份额净值 1.1895 元，本基金份额总额 16,569,947.70 份，其中 A 类基金份额 14,236,886.51 份，C 类基金份额 2,333,061.19 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(2019)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 2019 年 10 月 24 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 300,100.59 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。该款项预计将于 2019 年 11 月 4 日由基金托管行划回托管户，若支付清算款之日前未划回，则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算款之日进行垫付。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币 3,748.90 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。该款项预计将于 2019 年 11 月 4 日由基金托管行划回托管户，若支付清算款之日前未划回，则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算款之日进行垫付。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 18,443,678.50 元，已于 2019 年 10 月 22 日全部卖出变现。股票变现损益归基金资产所有，股票卖出产生的费用由基金资产承担。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为人民币 787.16 元。其中应收银行存款利息人民币 720.78 元，应收结算备付金利息人民币 62.28 元，应收存出保证金利息人民币 4.10 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算款之日进行垫付。

5.1.5 本基金最后运作日证券清算款人民币 62,409.90 元已于 2019 年 10 月 14 日结转至银行存款。

### 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 87,694.00 元，该款项已分别于 2019 年 10 月 14 日、2019 年 10 月 15 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 6,475.40 元，该款项于清算支付日进行支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,295.09 元，该款项已于 2019 年 10 月 24 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 461.75 元，该款项已于 2019 年 10 月 24 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 53,093.65 元，为应付长江证券交易费用，该款项已于 2019 年 10 月 24 日支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债为人民币 25,578.41 元，其中应付赎回费为人民币 28.66 元，该款项已分别于 2019 年 10 月 14 日、2019 年 10 月 15 日支付；应付指数使用费人民币 11,304.35 元，该款项将于 2019 年 10 月 24 日后支付；预提清算审计费为人民币 14,245.40 元，该款项将于 2019 年 10 月 24 日后支付。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

项目 自 2019 年 10 月 13 日至 2019 年 10 月 24 日止清算期间

#### 一、清算收益

利息收入（注 1） 3,435.78

赎回费收入 58.33

投资收益 106,686.93

清算收入小计 110,181.04

#### 二、清算费用

股票变现交易费用 33,400.28

其他费用（注 2） 55.00

清算费用小计 33,455.28

三、清算净收益 76,725.76

注：1、利息收入系计提的自 2019 年 10 月 13 日至 2019 年 10 月 24 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。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在支付清算款之日进行垫付。

2、其他费用系自 2019 年 10 月 13 日至 2019 年 10 月 24 日止清算期间托管账户扣缴的银行汇划费。

### 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 2019 年 10 月 12 日基金净资产 19,922,623.11

加：清算期间净收益 76,725.76

减：基金净赎回金额（于 2019 年 10 月 14 日确认的投资者赎回申请） 49,017.95

二、2019 年 10 月 24 日基金净资产 19,950,330.92

注：截至 2019 年 10 月 24 日，本基金资产净值 19,950,330.92 元，其中 A 类基金资产净值 17,180,125.85 元，C 类基金资产净值 2,770,205.07 元；基金份额总额 16,529,088.70 份，其中 A 类基金份额 14,209,230.15 份，C 类基金份额 2,319,858.55 份。

根据《基金合同》、《安信基金管理有限责任公司关于安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同终止及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 2019 年 10 月 24 日止的剩余财产为人民币 19,950,330.92 元。

自 2019 年 10 月 25 日至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的银行存款、结算备付金、存出保证金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，在相关账户销户后向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

本次清算相关的清算费用由基金财产承担。

#### 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、《安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海通力律师事务所关于〈安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金清算报告〉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>

安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

二〇一九年十月二十五日