

安信中证信用主体50债券指数

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：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年6月25日

清算报告公告日：

§ 1 重要提示

安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金（基金代码：009259，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”）2019 年 10 月 24 日公布的《关于准予安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]1990 号）准予募集注册，《安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于 2020 年 6 月 2 日正式生效，本基金基金管理人为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》以及本基金《基金合同》等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同的，《基金合同》应当终止。本基金管理人于 2021 年 4 月 15 日发布了《关于以通讯方式召开安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，陆续于 2021 年 4 月 16 日、2021 年 4 月 19 日发布了提示性公告，并于 2021 年 5 月 24 日召开了基金份额持有人大会，基金份额持有人大会审议通过了终止本基金《基金合同》有关事项的议案，大会决议自表决通过之日起生效，本基金管理人于 2021 年 5 月 25 日发布了《安信基金管理有限责任公司关于安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

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	安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金
基金简称	安信信用主体 50 债券指数
基金主代码	009259
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 2 日
报告期末(2021 年 5 月 25 日)基金份额总额	888,420.48 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风

	险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。其中，备选成份券或作为替代的非成份券的发行人须在指数公布的发行人篮子中。同时，单一发行主体（不含国债、政策性金融债、地方政府债的发行主体）的所有债券的持仓比例不超过组合净资产的 5%。在正常情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证信用主体 50 债券指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
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《安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金基金合同》、《关于终止安信中证信用主体 50 债券指数证券投资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	上海浦东发展银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况

安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金经中国证监会 2019 年 10 月 24 日下发的证监许可[2019]1990 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 2020 年 4 月 20 日至 2020 年 5 月 28 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2020 年 6 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 203,642,653.40 份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合 57,890.75 份基金份额）。

根据基金管理人于 2021 年 5 月 25 日发布的《安信基金管理有限责任公司关于安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金的最后运作日为 2021 年 5 月 25 日，于 2021 年 5 月 26 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：安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金



报告截止日：2021 年 5 月 25 日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2021年5月25日
资产：	
银行存款	67,544.33
结算备付金	8,946.94
存出保证金	4,383.45
交易性金融资产	871,897.00
其中：债券投资	871,897.00
应收利息	15,747.52
应收申购款	19.99
资产总计	968,539.23
负债和所有者权益	最后运作日 2021年5月25日
负债：	
应付赎回款	1,034.93
应付管理人报酬	148.44
应付托管费	37.10
应付税费	63.86
其他负债	54,015.29
负债合计	55,299.62
所有者权益：	
实收基金	888,420.48
未分配利润	24,819.13
所有者权益合计	913,239.61
负债和所有者权益总计	968,539.23

注：1、报告截止日 2021 年 5 月 25 日（基金最后运作日），本基金基金份额净值 1.0279 元，基金份额总额 888,420.48 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(2021)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 2021 年 6 月 21 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 8,946.94 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,其中 7,785.99 元已于 2021 年 6 月 2 日划回托管户,剩余 1,160.95 元预计将于 2021 年 7 月 2 日划回托管户。支付清算款之日前未划回的部分,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。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币 4,383.45 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。该款项已于 2021 年 6 月 2 日划回托管户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 871,897.00 元,该款项已于 2021 年 6 月 21 日前变现完毕。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息人民币 15,747.52 元,其中应收银行存款利息人民币 282.47 元,应收结算备付金利息人民币 41.33 元,应收存出保证金利息人民币 33.55 元,应收债券利息人民币 15,390.17 元。截至 2021 年 6 月 21 日,剩余应收利息人民币 6.79 元未到账,其中应收银行存款利息人民币 6.74 元,应收结算备付金利息人民币 0.05 元。该部分未到账应收利息预计将于结息日或销户日到账,支付清算款之日前未划回的部分,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 本基金最后运作日应收申购款人民币 19.99 元。该款项已于 2021 年 5 月 26 日到账。

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 1,034.93 元,该款项已于 2021 年 5 月 26 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 148.44 元,该款项已于 2021 年 6 月 2 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 37.10 元,该款项已于 2021 年 6 月 2 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付税费为人民币 63.86 元,该款项已于 2021 年 6 月 10 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 54,015.29 元,其中应付赎回费为人民币 0.77 元,该款项已于 2021 年 5 月 26 日支付;应付指数使用费为人民币 50,041.52 元,其中人民币 50,000.00 元已分别于 2021 年 5 月 27 日、2021 年 6 月 8 日支付,人民币 41.52 元预计于收到与中证指数有限公司签订的《终止协议》后支付;预提的清算审计费为人民币 3,973.00 元,该款项预计于 2021 年 6 月 25 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2021年5月26日至2021年6月21日止清算期间
一、清算收益	
利息收入(注1)	1,026.73
投资收益	1,966.18
赎回费收入	8.92

清算收入小计	3,001.83
二、清算费用	
交易费用	1.87
税金及附加	27.72
划款手续费(注2)	95.00
清算费用小计	124.59
三、清算净收益	2,877.24

注：1、利息收入系计提的自 2021 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 21 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息、债券利息。该利息大部分已于 2021 年 6 月 21 日债券投资全部变现完毕以及结息时到账；截至 2021 年 6 月 21 日，剩余未到账利息人民币 6.79 元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。

2、划款手续费中含清算期间已实际产生的手续费人民币 60.00 元以及预提的费用支付、清算款、垫付款划出时的划款手续费人民币 35.00 元，由于该金额为根据基金托管人最新划款收费标准预估的金额，与实际划款手续费可能存在差异，差异金额由基金管理人承担。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	单位：人民币元	
	金额	
一、最后运作日2021年5月25日基金净资产	913,239.61	
加：清算期间净收益	2,877.24	
减：基金净赎回金额（于2021年5月26日确认的投资者赎回申请）	525,451.58	
二、2021年6月21日基金净资产	390,665.27	

根据《关于终止安信中证信用主体 50 债券指数证券投资基金基金合同有关事项的议案的说明》中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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2021 年 6 月 21 日止的剩余财产为人民币 390,665.27 元，其中包括未变现资产：结算备付金人民币 1,160.95 元，应收利息人民币 6.79 元，共计人民币 1,167.74 元，支付清算款之日前未划回的部分，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。

自 2021 年 6 月 22 日至清算款划出日前一日的归属于持有人的银行存款、结算备付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有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。

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、《安信中证信用主体50债券指数证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于〈安信中证信用主体50债券指数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。

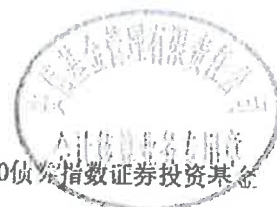
6.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站和中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)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>



二〇二一年六月二十五日

