

平安证券安赢添利半年滚动持有
债券型集合资产管理计划
清算报告

管理人:平安证券股份有限公司

托管人:中信银行股份有限公司

报告出具日期:2024年6月28日

报告送出日期:2024年7月22日

目录

§ 1 重要提示.....	3
§ 2 产品概况.....	4
§ 3 资产管理计划运作情况说明.....	4
§ 4 财务报告.....	5
§ 5 清算事项说明.....	6
§ 6 备查文件目录.....	10

§ 1 重要提示

平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“资产管理计划”）由原平安证券稳健资本一号集合资产管理计划（以下简称“原资产管理计划”）变更而来。原资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，2011年8月5日经中国证监会证监许可【2011】1239号核准设立，自2011年10月11日起开始募集，于2011年11月11日结束募集工作，并于2011年11月18日正式成立。根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，原资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。本资产管理计划根据中国证监会《关于准予平安证券稳健资本一号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2021】261号）准予变更，自2021年5月12日起，《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《平安证券稳健资本一号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。资产管理计划运作方式为契约型开放式，就A类份额而言，不开放申购，每个开放日办理赎回。就B、C、D类计划份额而言，设置半年滚动运作期，每个运作期到期日，B、C、D类集合计划份额持有人可提出赎回申请。《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）存续期限为《资产管理合同》生效之日起3年。平安证券股份有限公司为管理人，中信银行股份有限公司为托管人，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

本资产管理计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许资产管理计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。资产管理计划的投资组合比例为：本计划债券资产的投资比例不低于资产管理计划资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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《资产管理合同》的约定，截至2024年5月12日，本资产管理计划存续期届满，触发《资产管理合同》规定的终止情形，《资产管理合同》应当终止，并无需召开资产管理计划份额持有人大会。根据《资产管理合同》以及《关于平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同终止及财产清算的公告》，本资产管理计划最后运作日为2024年5月12日，从2024年5月12日（不含当日）起进入清算程序。

本计划管理人、本计划托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师

事务所于2024年5月13日组成资产管理计划财产清算小组履行资产管理计划财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本计划进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 产品概况

简称	平安安赢添利半年债券			
主代码	970011			
运作方式	契约型开放式 就 A 类份额而言，不开放申购，每个开放日办理赎回。就 B、C、D 类计划份额而言，设置半年滚动运作期，每个运作期到期日，B、C、D 类集合计划份额持有人可提出赎回申请。			
合同生效日	2021 年 05 月 12 日			
产品最后运作日(2024 年 5 月 12 日) 份额总额	82,258,056.48 份			
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现计划资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。			
投资策略	精选信用债做底仓配置，在获取稳健收益的基础上，通过债券波段操作、利率中性策略交易、权益资产投资等方式博取超额收益。本集合计划投资策略具有攻守兼备的特点，在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。			
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%			
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。			
管理人	平安证券股份有限公司			
托管人	中信银行股份有限公司			
下属分级份额简称	平安安赢添利半年债券 A	平安安赢添利半年债券 B	平安安赢添利半年债券 C	平安安赢添利半年债券 D
下属分级份额的交易代码	970011	970012	970013	970014
产品最后运作日(2024 年 5 月 12 日) 下属分级份额的份额总额	80,185,072.83 份	1,118,603.00 份	954,380.65 份	0.00 份

§ 3 资产管理计划运作情况说明

平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划由原平安证券稳健资本一号集合资产管理计划变更而来。原资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，2011年8月5日经中国证监会证监许可【2011】1239号核准设立，自2011年10月11日起开始募集，于2011年11月11日结束募集工作，并于2011年11月18日正式成立。根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，原资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。本资产管理计划根据中国证监会《关于准予平安证券稳健资本一号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2021】261号）准予变更，自2021年5月12日起，《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《平安证券稳健资本一号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。资产管理计划运作方式为契约型开放式，就A类份额而言，不开放申购，每个开放日办理赎回。就B、C、D类计划份额而言，设置半年滚动运作期，每个运作期到期日，B、C、D类集合计划份额持有人可提出赎回申请。《资产管理合同》存续期限为《资产管理合同》生效之日起3年。平安证券股份有限公司为管理人，中信银行股份有限公司为托管人，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

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《资产管理合同》的约定，截至2024年5月12日，本资产管理计划存续期届满，触发《资产管理合同》规定的终止情形，《资产管理合同》应当终止，并无需召开资产管理计划份额持有人大会。根据《资产管理合同》以及《关于平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同终止及财产清算的公告》，本资产管理计划最后运作日为2024年5月12日，从2024年5月12日（不含当日）起进入清算程序，清算期间为2024年5月13日至2024年5月16日。

§ 4 财务报告

4.1 资产管理计划最后运作日资产负债表（已经审计）

单位：人民币元

2024年5月12日
(资产管理计划最后运作日)

资产

货币资金	20,545,779.77
结算备付金	716,108.26
存出保证金	11,681.54
交易性金融资产	93,092,622.87
待摊费用	81,413.26

资产总计	114,447,605.70
负债及净资产	
负债	
卖出回购金融资产款	8,800,000.00
应付TA赎回款	2,184,857.97
应付清算款	17,512,310.13
应付管理人报酬	11,552.04
应付托管费	1,444.00
应交税费	28,090.80
其他负债	38,542.92
负债合计	28,576,797.86
净资产	
实收资金	82,258,056.48
未分配利润	3,612,751.36
净资产合计	85,870,807.84
负债和净资产总计	114,447,605.70

§ 5 清算事项说明

截至2024年5月12日，资产管理计划存续期届满，触发《资产管理合同》规定的终止情形，《资产管理合同》应当终止，并无需召开资产管理计划份额持有人大会，本资产管理计划进入清算程序。根据《关于平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同终止及财产清算的公告》，2024年5月12日为资产管理计划的最后运作日。资产管理计划的清算期间为自2024年5月13日至2024年5月16日止。

5.1 清算报表编制基础

资产管理计划的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及中国财政部发布的《资产管理产品相关会计处理规定》（财会〔2022〕14号）的有关规定编制的。自资产管理计划最

后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5.2 清算情况

于清算期间，资产管理计划管理人对资产管理计划的资产、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：

5.2.1 资产处置及资产支付情况

(1) 资产管理计划最后运作日的银行存款为人民币 20,545,779.77 元，其中包含托管户银行存款本金人民币 20,543,187.71 元、托管户银行存款应计利息人民币 2,590.56 元及协议存款账户应计利息人民币 1.5 元。清算期间计提银行存款应收利息人民币 3,192.85 元，于 2024 年 5 月 15 日收到银行存款利息人民币 1.22 元。应计利息款项合计人民币 5,783.69 元将于下一付息日划入资产管理计划托管账户。

(2) 资产管理计划最后运作日结算备付金为人民币 716,108.26 元，其中，存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金为人民币 690,831.67 元，应计上海结算备付金利息为人民币 1,546.37 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金为人民币 23,686.71 元，应计深圳结算备付金利息为人民币 43.51 元。清算期间计提结算备付金利息人民币 237.16 元；于清算期间，结算备付金账户收支净变动为增加人民币 603,079.40 元；截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日），结算备付金余额为人民币 1,319,424.82 元。

(3) 资产管理计划最后运作日存出保证金为人民币 11,681.54 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币 6,982.20 元，应计上海存出保证金利息为人民币 16.08 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币 4,670.36 元，应计深圳存出保证金利息为人民币 12.90 元。截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日），清算期间计提存出保证金利息人民币 2.08 元，存出保证金余额为人民币 11,683.62 元。

(4) 资产管理计划最后运作日交易性金融资产为人民币 93,092,622.87 元，均为债券投资。资产管理计划于清算期间内对全部债券投资进行处置变现。实际变现金额为人民币 93,100,653.15 元。

(5) 资产管理计划最后运作日待摊费用为人民币 81,413.26 元，均为预付信息披露费，截至清算结束日，待摊费用为人民币 81,413.26 元。

5.2.2 负债清偿情况

(1) 资产管理计划最后运作日应付管理人报酬为人民币 11,552.04 元，截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）尚未支付。

(2) 资产管理计划最后运作日应付托管费为人民币 1,444.00 元，截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）尚未支付。

(3) 资产管理计划最后运作日卖出回购金融资产款为人民币 8,800,000.00 元，清算期间计提卖出回购金融资产款应付利息人民币 425.53 元，于 2024 年 5 月 13 日支付卖出回购金融资产款人民币 8,800,425.53 元。截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）卖出回购金融资产款余额为零。

(4) 于清算期间管理人以其自有资金向资产管理计划注入垫款人民币 1,350,000.00 元用于支付投资者分配款项。截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）尚未偿还。

(5) 资产管理计划最后运作日应付 TA 赎回款为人民币 2,184,857.97 元，清算期间确认应付 TA 赎回款人民币 85,880,370.67 元，并分别于 2024 年 5 月 13 日、2024 年 5 月 14 日及 2024 年 5 月 16 日支付应付 TA 赎回款合计人民币 88,065,228.64。截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）应付 TA 赎回款余额为零。

(6) 资产管理计划最后运作日应交税费为人民币 28,090.80 元，于 2024 年 5 月 16 日因处置亏损冲回应交税费人民币 253.03 元。截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）应交税费人民币 27,837.77 元尚未支付。

(7) 资产管理计划最后运作日其他负债人民币为 38,542.92 元。其中：

1) 应付交易费用人民币 4,197.19 元，于 2024 年 5 月 16 日支付应付交易费用人民币 3,220.00 元。截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日），应付交易费用人民币 977.19 元尚未支付。

2) 应付审计费人民币 15,000.00 元，截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）尚未支付。

3) 应付律师费人民币 10,000.00 元，截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）尚未支付。

4) 应付银行汇划费用人民币 500.00 元，截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）尚未支付。

5) 应付账户维护费用人民币 6,200.00 元，于 2024 年 5 月 16 日支付应付账户维护费用人民币 3,000.00 元。截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日），应付账户维护费用人民币 3,200.00 元尚未支付。

6) 应付销售服务费用人民币 145.73 元，截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）尚未支付。

7) 应付中登 TA 服务费人民币 2,500.00 元，截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日）尚未支付。

5.2.3 份额持有人权益情况

份额持有人权益于资产管理计划最后运作日为人民币 85,870,807.84 元，于资产管理计划最后运作日已申请但尚未划转的赎回款为人民币 2,184,857.97 元。清算期间产生净收益人民币 11,039.87 元。于 2024 年 5 月 13 日，管理人向份额持有人划付了归属于份额持有人的应付 TA 赎回款人民币 2,184,857.97 元；于 2024 年 5 月 14 日，向份额持有人划付了归属于份额持有人的应付 TA 赎回款共计人民币 5,514,796.01 元；于 2024 年 5 月 16 日，向份额持有人划付了归属于份额持有人的应付 TA 赎回款人民币 80,365,574.66 元。截至 2024 年 5 月 16 日（清算结束日），资产管理计划剩余财产为人民币 1,477.04 元。

5.2.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

自2024年5月13日至

2024年5月16日止期间

项目

一、清算收入

利息收入（注1）	3,432.09
公允价值变动收益/(亏损)（注2）	10,507.79
投资收益（注3）	(2,501.58)
清算收入小计	11,438.30
二、清算支出	
利息支出（注4）	425.53
税金及附加（注5）	(27.10)
清算支出小计	398.43
三、清算净收益	11,039.87

（1）利息收入系计提的自2024年5月13日至2024年5月16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。

（2）公允价值变动收益系自2024年5月13日至2024年5月16日止清算期间持有债券投资产生的公允价值变动收益。

（3）投资收益系自2024年5月13日至2024年5月16日止清算期间产生的债券利息收入及处置债券投资产生的差价收入。

（4）利息支出系自2024年5月13日至2024年5月16日止清算期间持有卖出回购金融资产款合约产生的利息支出。

（5）税金及附加系自2024年5月13日至2024年5月16日止清算期间处置债券投资产生的城市建设税、教育附加税及地方教育费。

5.3 清算期间结束后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2024年5月12日净资产	85,870,807.84
加：最后运作日已申请但尚未划转的赎回款	2,184,857.97
加：清算期间净收益	11,039.87
减：清算期间资产管理计划净赎回金额	(88,065,228.64)
二、2024年5月16日资产管理计划净资产	1,477.04

于2024年5月16日（清算结束日），资产管理计划剩余资产为人民币1,424,633.77元，其中

银行存款本金人民币 6,328.38 元及剩余未到账的资产人民币 1,418,305.39 元。剩余未到账的资产包括结算备付金本金人民币 1,317,597.78 元、存出保证金本金人民币 11,652.56 元、待摊费用人民币 81,413.26 元及应计银行存款、结算备付金、存出保证金利息人民币 7,641.79 元。之后将支付应付管理人报酬人民币 11,552.04 元、应付托管费人民币 1,444.00 元、其他负债人民币 32,322.92 元、其他应付款管理人垫款人民币 1,350,000.00 元以及应交税费 27,837.77 元，剩余财产为人民币 1,477.04 元。

自 2024 年 5 月 17 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、存出保证金孳生的利息归份额持有人所有，最终支付清算款金额以资产管理计划登记机构的记录为准。资产管理计划管理人平安证券股份有限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资产管理计划管理人所有，在托管户销户前向资产管理计划管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

资产管理计划计提的应收银行存款利息收入为合理估计金额，可能与实际收取金额存在少量差异，最终分配时以银行实际结算金额为准。资产管理计划最终剩余财产将按照《资产管理合同》的约定，按资产管理计划份额持有人持有的资产管理计划份额比例进行分配。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- (1) 《关于平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同终止及财产清算的公告》；
- (2) 《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划清算审计报告》；
- (3) 关于《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划清算报告》的法律意见；
- (4) 《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划清算报告》。

6.2 存放地点

广东省深圳市福田区福田街道福华三路 15 号与金田路交汇处卓越世纪中心 1 号楼 36 层。

6.3 查阅方式

- (1) 书面查阅：可在营业时间于管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- (2) 网络查阅：管理人网站：<https://stock.pingan.com/>。

平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划财产清算小组
二〇二四年七月二十二日