

安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资  
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：2022年7月2日

清算报告公告日：2022年7月14日

## § 1 重要提示

安信永瑞定期开放债券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”）2018年5月17日下发的证监许可[2018]822号文准予募集注册，并经机构部函[2018]1266号确认，自2018年6月1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《安信永瑞定期开放债券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年后本基金继续存续的，若在开放期最后一日基金资产净值加上当日申购和基金转换中转入的基金份额对应的资产净值减去当日赎回和基金转换中转出的基金份额对应的资产净值低于5000万元，基金管理人应当终止《基金合同》，并根据《基金合同》第十九部分的约定进行财产清算，不需召开基金份额持有人大会。本基金2022年度第二次开放的开放期为2022年6月17日至2022年6月23日，截至本次开放期的最后一日（即2022年6月23日）日终，本基金出现触发基金合同中约定的终止的上述情形。

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，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                   | 安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金  |
| 基金简称                   | 安信永瑞定开债券  |
| 基金主代码                  | 006040  |
| 基金运作方式                 | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日                | 2018年6月1日   |
| 报告期末(2022年6月23日)基金份额总额 | 967,496.44份   |
| 投资目标                   | 本基金在严格控制信用风险的前提下，通过稳健的投资策略，力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。   |
| 投资策略                   | 封闭期内，本基金主要采用债券类属配置策略、久期投资策略、信用选择策略、个券挖掘策略、杠杆投资策略和资产支持证券投资策略。本基金通过对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化，以及信用债券的信用风险等因素进行分析，确定债券类属资产的最优权重，积 |

|         |  |
|---------|--|
|         | 极调整债券组合的平均久期，买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品，并通过杠杆操作提高组合收益。同时，本基金将在基础资产类型和资产池现金流研究基础上，分析不同档次证券的风险收益特征，确定资产支持证券类别资产的合理配置。开放期内，本基金将主要投资于高流动性的品种，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值波动。 |
| 业绩比较基准  | 中债综合指数收益率  |
| 风险收益特征  | 本基金为债券型基金，其预期收益水平和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。  |
| 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《安信永瑞定期开放债券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   |

### § 3 基金运作情况

安信永瑞定期开放债券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”）2018年5月17日下发的证监许可[2018]822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2018年5月28日起至2018年5月29日期间通过销售机构公开发售。本基金基金合同于2018年6月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为509,999,000.00份（有效认购资金在首次发售募集期内未产生利息金额）。

根据基金管理人于2022年6月24日发布的《安信基金管理有限责任公司关于安信永瑞定期开放债券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》，本基金的最后运作日为2022年6月23日，并于2022年6月24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：安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2022年6月23日

单位：人民币元

| 资 产         | 最后运作日<br>2022年6月23日 |
|-------------|---------------------|
| <b>资 产:</b> |                     |
| 银行存款        | 158,268.29          |
| 结算备付金       | 63,240.13           |
| 存出保证金       | 34,578.17           |
| 交易性金融资产     | 815,012.60          |
| 其中：债券投资     | 815,012.60          |
| 资产总计        | 1,071,099.19        |
| 负债和所有者权益    | 最后运作日<br>2022年6月23日 |
| <b>负 债:</b> |                     |
| 应付管理人报酬     | 17,404.76           |
| 应付托管费       | 5,801.60            |
| 应交税费        | 2,137.73            |
| 应付赎回款       | 91.67               |
| 其他负债        | 35,388.34           |
| 负债合计        | 60,824.10           |
| <b>净资产:</b> |                     |
| 实收资金        | 967,496.44          |
| 未分配利润       | 42,778.65           |
| 净资产合计       | 1,010,275.09        |
| 负债和净资产总计    | 1,071,099.19        |

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 23 日(基金最后运作日)，本基金份额净值 1.0442 元，基金份额总额 967,496.44 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号标准无保留意见的审计报告。

## § 5 基金财产分配

自 2022 年 6 月 24 日至 2022 年 6 月 30 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 本基金最后运作日银行存款人民币 158,268.29 元，其中托管户存款为 156,813.11 元，应计银行存款利息为 1,455.18 元，应计利息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。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金人民币 63,240.13 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 63,231.58 元,应计结算备付金利息 8.55 元。根据中登结算备付金管理办法,预计 7 月仍有结算备付金占用,结算备付金最后将于 2022 年 8 月 2 日自中登备付金账户全额退回托管户。支付清算款之日前未划回的部分及应计结算备付金利息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。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金人民币 34,578.17 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保证金为 34,573.49 元,应计存出保证金利息为 4.68 元。结算保证金预计将于 2022 年 7 月 4 日划回托管户,支付清算款之日前未划回的应计存出保证金利息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。

5.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 815,012.60 元,其中交易性债券投资市值为 800,240.00 元,应计债券利息为 14,772.60 元,已于 2022 年 6 月 24 日全部卖出变现,变现金额合计人民币 815,055.62 元。

## 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 17,404.76 元,该款项已于 2022 年 6 月 30 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 5,801.60 元,该款项已于 2022 年 6 月 30 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应交税费为人民币 2,137.73 元,该款项已于 2022 年 6 月 30 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 91.67 元,该款项已于 2022 年 6 月 27 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 35,388.34 元,其中应付交易费用为人民币 2,800.04 元,该款项预计于银行间账户销户日安排支付;其中预提清算审计费为人民币 23,288.30 元,该款项预计于 7 月安排支付;预提上清所账户维护费人民币 4,800.00 元,中债账户维护费人民币 4,500.00 元,该款项预计于银行间账户销户日安排支付。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

| 项目     | 自2022年6月24日至2022年6月30日止清算期间 |
|--------|-----------------------------|
| 一、清算收益 |                             |

|         |        |
|---------|--------|
| 1、利息收入  | 72.75  |
| 2、投资收益  | 493.02 |
| 清算收入小计  | 565.77 |
| 二、清算费用  |        |
| 划款手续费   | 85.22  |
| 清算费用小计  | 85.22  |
| 三、清算净收益 | 480.55 |

注：1、利息收入系计提的自 2022 年 6 月 24 日至 2022 年 6 月 30 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。支付清算款之日未到账部分拟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、划款手续费中包含预估汇划费 45.22 元，按托管行最新收费标准预估；预估金额与实际划款时产生的费用可能存在差异，差异金额由管理人承担。

#### 5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

| 项目                               | 金额           |
|----------------------------------|--------------|
| 一、最后运作日2022年6月23日基金净资产           | 1,010,275.09 |
| 加：清算期间净收益                        | 480.55       |
| 减：基金净赎回金额（于2022年6月24日确认的投资者赎回申请） | 7.21         |
| 二、2022年6月30日基金净资产                | 1,010,748.43 |

根据《安信基金管理有限责任公司关于安信永瑞定期开放债券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》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 2022 年 6 月 30 日止的剩余财产为人民币 1,010,748.43 元，其中包括未到账资产：结算备付金人民币 63,231.58 元，存出保证金人民币 34,573.49 元，应计利息人民币 1,541.16 元。支付清算款之日未到账的部分，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 2022 年 7 月 1 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。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。

#### 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、《安信永瑞定期开放债券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〈安信永瑞定期开放债券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>

安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2022年7月4日