

安信消费升级一年持有期混合型发起式证
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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年6月11日

清算报告公告日：2024年6月18日

§ 1 重要提示

安信消费升级一年持有期混合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”）2021年3月4日下发的中国证监会证监许可[2021]697号文准予募集注册，并经机构部函[2021]1643号确认，自2021年6月2日起《安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“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（以下简称“基金管理人”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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，本基金《基金合同》生效日为2021年6月2日，《基金合同》生效之日起三年后的对应日为2024年6月2日。截至2024年6月2日日终，本基金的基金资产净值低于2亿元，触发《基金合同》终止的情形，本基金根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会，即本基金的最后运作日为2024年6月2日。

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	安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金
基金简称	安信消费升级一年持有混合
基金主代码	011858
基金运作方式	契约型开放式。对于本基金每份基金份额设定锁定持有期，锁定持有期为一年。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份基金份额自开放持有期首日起才能办理赎回及转换转出业务。
基金合同生效日	2021年6月2日
报告期末(2024年6月2日日终)基金份额总额	25,484,675.91份
投资目标	本基金致力于把握中国经济增长与消费升级带来的投资机会，在严格控制投资风险的前提下，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	资产配置策略方面，本基金通过对国内外宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的

	<p>波动，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。股票投资策略方面，消费升级主题的界定：随着国家经济的发展和国民收入的增加，居民消费水平呈不断改善和提升趋势，消费结构已从生存型消费向享受型、发展型消费转型升级。本基金通过深入研究宏观经济、政策指引、居民消费升级的变化趋势，重点投资于受益于消费升级的行业，消费升级主题所涉及的行业范围包括但不限于：（1）非强周期的，消费总规模、集中度持续提升的行业；（2）满足马斯洛中上层需求的、具备情感投射的消费升级类行业。本基金管理人将持续跟踪宏观经济、国家政策、消费产业发展趋势及最新动态。港股通标的股票投资策略方面，本基金将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、境外机构投资者行为、境内机构和个人投资者行为、世界主要经济体经济前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等影响港股投资的主要因素，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，本基金基金资产并非必然投资港股。存托凭证投资策略方面，本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。债券投资策略方面，本基金将采取自上而下的投资策略，通过深入分析宏观经济、货币政策、利率水平、物价水平以及风险偏好的变化趋势，从而确定债券的配置数量与结构。具体而言，通过比较不同券种之间的收益率水平、流动性、信用风险等因素评估债券的内在投资价值，灵活运用多种策略进行债券组合的配置。衍生品投资策略方面，本基金在严格遵守相关法律法规情况下，合理利用股指期货等衍生工具做套保或套利投资。投资的原则是控制投资风险、稳健增值。资产支持证券投资策略方面，本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。本基金将特别注重资产支持证券品种的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定资产支持证券类别资产的合理配置比例，保证本金相对安全和基金资产流动性，以期获得长期稳定收益。融资业务策略方面，在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证内地消费主题指数收益率*70%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*10%+中债总指数(全价)收益率*20%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股外，还可通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进</p>

	行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。
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《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	招商银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况

本基金经中国证监会 2021 年 3 月 4 日下发的证监许可[2021]697 号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规的有关规定及《基金合同》的约定自 2021 年 5 月 17 日起通过销售机构公开发售，2021 年 5 月 28 日募集结束。本基金《基金合同》于 2021 年 6 月 2 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额总额为 134,591,343.87 份，其中有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息折合 28,580.69 份基金份额。

根据基金管理人于 2024 年 6 月 3 日发布的《安信基金管理有限责任公司关于安信消费升级一年持有期混合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》，截至 2024 年 6 月 2 日，本基金资产净值低于 2 亿元，已触发《基金合同》终止的情形，根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止基金合同。本基金的最后运作日为 2024 年 6 月 2 日，并于 2024 年 6 月 3 日起进入清算程序。

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：安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 2 日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024年6月2日
资产：	
银行存款	18,081,030.65
交易性金融资产	10,529,089.35
其中：股票投资	10,529,089.35
应收清算款	4,028,101.79

应收股利	36,825.37
资产总计	32,675,047.16
负债和净资产	最后运作日 2024年6月2日
负债：	
应付赎回款	15,149,008.19
应付管理人报酬	56,321.56
应付托管费	9,386.94
应付销售服务费	7,825.15
其他负债	77,216.69
负债合计	15,299,758.53
净资产：	
实收资金	25,484,675.91
未分配利润	-8,109,387.28
净资产合计	17,375,288.63
负债和净资产总计	32,675,047.16

注：（1）报告截止日 2024 年 6 月 2 日（基金最后运作日），本基金份额总额 25,484,675.91 份，其中安信消费升级一年持有混合 A 基金份额总额 11,805,066.16 份，基金份额净值 0.6906 元；安信消费升级一年持有混合 C 基金份额总额 13,679,609.75 份，基金份额净值 0.6742 元。

（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（2024）专字第 70024611_H39 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

自 2024 年 6 月 3 日至 2024 年 6 月 10 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 18,081,030.65 元，其中托管户存款为人民币 779,704.83 元，应计银行存款利息为人民币 902.00 元，券商户存款为人民币 17,294,139.44 元，应计券商户存款利息为人民币 6,284.38 元。应计券商户存款利息已于 2024 年 6 月 6 日结息到账。支付清算款之日前未结息到账的应计银行存款利息款项预计将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

5.1.2 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 10,529,089.35 元，全部为交易性股票投资，已于 2024 年 6 月 3 日全部完成变现，相关款项已分别于 2024 年 6 月 3 日、2024 年 6

月 5 日到账至券商户存款。

5.1.3 本基金最后运作日应收股利人民币 36,825.37 元,为未到账的港股分红现金股利,其中部分股利已于 2024 年 6 月 6 日到账至券商户存款,剩余未到账港股分红现金股利以人民币为分红币种,不涉及汇率调整。支付清算款之前剩余未到账的应收股利将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

5.1.4 本基金最后运作日应收清算款金额为 4,028,101.79 元,为股票资产卖出未到账资金,已分别于 2024 年 6 月 3 日、2024 年 6 月 4 日到账至券商户存款。

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 15,149,008.19 元,该款项已分别于 2024 年 6 月 3 日、2024 年 6 月 4 日、2024 年 6 月 5 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 56,321.56 元,该款项预计于清算期结束后安排支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 9,386.94 元,该款项预计于清算期结束后安排支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 7,825.15 元,该款项预计于清算期结束后安排支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 77,216.69 元,其中应付交易费用为人民币 67,625.67 元,该款项预计于清算期结束后安排支付;预提清算审计费为人民币 8,852.76 元,该款项预计于清算期结束后安排支付;应付赎回费为人民币 53.49 元,已于 2024 年 6 月 3 日支付;应付汇划手续费为人民币 684.77 元,为截至 2024 年 6 月 2 日托管户实际产生未扣费的汇划手续费金额,已于 2024 年 6 月 7 日由托管行统一扣费。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	2024年6月3日至2024年6月10日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入	243.36
2、投资收益	68,988.55
清算收入小计	69,231.91
二、清算费用	
1、划款手续费	641.68
2、其他费用	5.90
清算费用小计	647.58
三、清算净收益	68,584.33

注:(1)利息收入系清算期间计提的银行存款利息,及券商户存款利息结息到账金额与计

提金额的差异。

(2) 投资收益系清算期间持有股票资产变现收益及港股分红现金股利实际到账与计提金额差异。

(3) 划款手续费中部分系根据托管户最新收费标准预提的费用，实际产生金额可能与预估金额存在差异，差异部分由基金管理人承担。

(4) 其他费用系最后运作日持仓港股通股票在清算期间产生的证券组合费。

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2024年6月2日基金净资产	17,375,288.63
加：清算期间净收益	68,584.33
减：基金净赎回金额（于2024年6月3日确认的投资者赎回（含转出）申请）	4,435,275.64
二、2024年6月10日基金净资产	13,008,597.32

根据《基金合同》及《安信基金管理有限责任公司关于安信消费升级一年持有期混合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本基金债务后，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2024年6月10日归属于剩余基金份额持有人的净资产为人民币13,008,597.32元，其中剩余未到账资产为人民币28,415.99元，包括应计银行存款利息人民币1,643.19元，应收未到账股利人民币26,772.80元。

自清算期结束日次日（2024年6月11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孳生的利息归基金份额持有人所有。剩余未到账港股分红现金股利以人民币为分红币种，不涉及汇率调整。为保护份额持有人利益，支付清算款之日前未结息的应计银行存款利息与未到账的应收股利将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付以加快清算速度，实际结息到账金额与垫付金额有差异的由基金管理人承担。

最终支付清算款金额以本基金登记机构的记录为准。基金管理人垫付的资金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，在托管户销户前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、《安信消费升级一年持有期混合型发起式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〈安信消费升级一年持有期混合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

投资者可在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅上述文件。

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>

安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金
基金财产清算小组
2024年6月11日