

安信中债1-3年政策性金融债指数证券投资  
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：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年8月8日

清算报告公告日：2024年8月13日

## § 1 重要提示

安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金（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”）2020 年 9 月 28 日下发的中国证监会证监许可[2020]2439 号文准予募集注册，并经机构部函[2020]3161 号确认，自 2020 年 11 月 25 日起《安信中债 1-3 年政策性金融债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”）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”），基金托管人为中国民生银行股份有限公司（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，本基金于 2024 年 7 月 2 日至 2024 年 7 月 26 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2024 年 7 月 29 日计票表决通过了《关于终止安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。本基金的最后运作日为 2024 年 8 月 2 日，并于 2024 年 8 月 3 日起进入清算期。

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、普华永道中天会计师事务所（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，并由普华永道中天会计师事务所（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	安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金
基金简称	安信中债 1-3 政金债指数
基金主代码	010406
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 25 日
报告期末(2024 年 8 月 2 日日终)基金份额总额	5,218,780.37 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，以实现对标指数的有效跟踪。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	中债-1-3 年政策性金融债指数收益率*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。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	中国民生银行股份有限公司

### § 3 基金运作情况

本基金经中国证监会 2020 年 9 月 28 日下发的中国证监会证监许可[2020]2439 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》的约定负责公开募集。本基金《基金合同》于 2020 年 11 月 25 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额总额为 2,600,212,156.27 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 9,563.07 份基金份额。

根据基金管理人于 2024 年 7 月 31 日发布的《安信基金管理有限责任公司关于安信中债 1-3 年政策性金融债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 2024 年 8 月 2 日，并于 2024 年 8 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：安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 8 月 2 日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024年8月2日
<b>资产:</b>	
货币资金	758,292.89
存出保证金	53.70
交易性金融资产	4,657,737.37
其中:债券投资	4,657,737.37
资产总计	5,416,083.96
负债和净资产	最后运作日 2024年8月2日
<b>负债:</b>	
应付管理人报酬	44.60
应付托管费	14.87
应付销售服务费	25.09
其他负债	16,155.00
负债合计	16,239.56
<b>净资产:</b>	
实收资金	5,218,780.37
未分配利润	181,064.03
净资产合计	5,399,844.40
负债和净资产总计	5,416,083.96

注：（1）报告截止日 2024 年 8 月 2 日（基金最后运作日），本基金份额总额 5,218,780.37 份，其中安信中债 1-3 政金债指数 A 基金份额总额 827,769.95 份，基金份额净值 1.0267 元；安信中债 1-3 政金债指数 C 基金份额总额 4,391,010.42 份，基金份额净值 1.0362 元。

（2）本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。

## § 5 基金财产分配

自 2024 年 8 月 3 日至 2024 年 8 月 7 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 本基金最后运作日货币资金人民币 758,292.89 元，其中托管户存款为人民币 758,009.93 元，应计银行存款利息为人民币 282.96 元，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 本基金最后运作日存出保证金人民币 53.70 元，全部为应计上海存出保证金利息；

预计于 2024 年 9 月 21 日结息并划入托管户。支付清算款之日前未结息到账的应计存出保证金利息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。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 4,657,737.37 元，全部为债券投资，已于 2024 年 8 月 5 日全部完成变现，相关款项已于 2024 年 8 月 6 日到账至托管户。

## 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 44.60 元，该款项预计于清算期结束后安排支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 14.87 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销售服务费为人民币 25.09 元，该款项预计于清算期结束后安排支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债为人民币 16,155.00 元，其中应付交易费用为人民币 155.00 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 13,000.00 元，该款项预计于清算期结束后安排支付；预提中债账户维护费为 3,000.00 元，该款项预计于清算期结束后安排支付。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2024年8月3日至2024年8月7日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入	127.34
2、投资收益	38.61
清算收入小计	165.95
二、清算费用	
1、划款手续费	152.94
清算费用小计	152.94
三、清算净收益	13.01

注：（1）利息收入系清算期间计提的银行存款利息。

（2）投资收益系清算期间持有债券资产变现收益金额。

（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。

## 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8月2日基金净资产	5,399,844.40

加：清算期间净收益	13.01
减：基金净赎回金额（于2024年8月5日确认的投资者赎回申请）	3,110.58
二、2024年8月7日基金净资产	5,396,746.83

根据《基金合同》及《关于终止安信中债 1-3 年政策性金融债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 8 月 7 日归属于剩余基金份额持有人的净资产为人民币 5,396,746.83 元，其中剩余未到账款项为人民币 464.00 元，包括应计银行存款利息人民币 410.30 元，应计上海存出保证金利息人民币 53.70 元。

自清算期结束日次日（2024 年 8 月 8 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。为保护基金份额持有人利益，支付清算款之日前未结息的应计银行存款利息与应计上海存出保证金利息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、《安信中债1-3年政策性金融债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〈安信中债1-3年政策性金融债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

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>

安信中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金

基金财产清算小组

2024年8月8日