

# 东方合家保本混合型证券投资基金

## 清算报告

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年7月3日

清算报告公告日：2018年8月10日

## 一、重要提示

东方合家保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”、“东方合家”）由东方基金管理有限责任公司担任基金管理人（以下简称“本基金管理人”），由中国建设银行股份有限公司担任基金托管人（以下简称“基金托管人”）。根据 2016 年 4 月 6 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东方合家保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]688 号）注册募集，根据《关于东方合家保本混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2016]1359 号）本基金合同于 2016 年 6 月 16 日正式生效。

本基金为保本基金，保本周期为 24 个月，本基金第一个保本周期自 2016 年 6 月 16 日起至 2018 年 6 月 19 日止（由于 2018 年 6 月 16 日为非工作日，根据《东方合家保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定顺延至下一工作日，即保本周期到期日为 2018 年 6 月 19 日），担保人由深圳市高新投集团有限公司担任。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》、《关于避险策略基金的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）的相关规定以及《基金合同》的约定，本基金不再满足保本基金的存续条件，故本基金将于第一个保本周期到期后终止并依法对基金财产进行清算。为此，本基金管理人于 2018 年 6 月 1 日、6 月 8 日以及 6 月 15 日在《中国证券报》、《证券时报》和本基金管理人网站（www.orient-fund.com）就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告及提示性公告，详见《东方合家保本混合型证券投资基金保本周期到期后终止基金合同并进行基金财产清算的公告》、《东方合家保本混合型证券投资基金保本周期到期后终止基金合同并进行基金财产清算的第一次提示性公告》和《东方合家保本混合型证券投资基金保本周期到期后终止基金合同并进行基金财产清算的第二次提示性公告》。

根据上述公告，本基金从 2018 年 6 月 27 日起进入清算流程。由基金管理人东方基金管理有限责任公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、立信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由立信会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报

告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、 基金情况

### 1、 基金基本情况

基金名称	东方合家保本混合型证券投资基金
基金简称	东方合家保本混合
基金主代码	002648
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月16日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同存续期	不定期

### 2、 基金产品说明

投资目标	运用保本策略，通过动态调整股票与债券等资产的组合，在有效控制投资风险、确保保本周期内本金安全的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金运用 CPPI 固定比例投资组合保险机制，动态分配基金资产在权益类资产和固定收益类资产上的投资比例。
业绩比较基准	两年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金和债券型基金，但低于股票型基金、非保本混合型基金，属于低风险水平的投资品种。

## 三、 财务会计报告

### 资产负债表（经审计）

会计主体：东方合家保本混合型证券投资基金

最后运作日：2018年6月26日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2018年6月26日
<b>资产：</b>	
银行存款	126,626,094.76
结算备付金	1,544,184.75
存出保证金	23,990.69
交易性金融资产	
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	

资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	
应收利息	25,791.21
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	128,220,061.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>最后运作日 2018年6月26日</b>
<b>负 债:</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	42,847,373.93
应付管理人报酬	284,564.94
应付托管费	43,779.22
应付销售服务费	
应付交易费用	18,292.82
应交税费	10,205.09
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	230,001.31
负债合计	43,434,217.31
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	82,738,771.40
未分配利润	2,047,072.70
所有者权益合计	84,785,844.10
负债和所有者权益总计	128,220,061.41

注：至基金最后运作日 2018 年 6 月 26 日，东方合家基金份额净值 1.0247 元，基金份额总额 82,738,771.40 份。

#### 四、清算报表附注

##### 1、基金基本情况

东方合家保本混合型证券投资基金根据 2016 年 4 月 6 日中国证监会《关于

准予东方合家保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]688号）和《关于东方合家保本混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2016]1359号）的核准，由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方合家保本混合型证券投资基金基金合同》自2016年5月3日至2016年6月8日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集798,014,663.92元人民币，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2016]第01300015号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方合家保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为798,540,221.70份基金单位，其中认购资金利息折合525,557.78份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金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基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

根据《东方合家保本混合型证券投资基金基金合同》及东方基金管理有限责任公司于2018年6月1日发布的《东方合家保本混合型证券投资基金保本周期到期后终止基金合同并进行基金财产清算的公告》，本基金保本周期为24个月，第一个保本周期的到期日为2018年6月19日。根据《基金合同》的约定，自2018年6月19日（含）至2018年6月26日（含）为本基金的到期操作期间，共计6个工作日，在该期间本基金不开放申购及转换转入业务，仅开放赎回及转换转出业务。基金份额持有人可在到期操作期间赎回或转换转出本基金基金份额；未能在该期间赎回的基金份额，将全部进入清算程序。

## 2、清算原因

本基金不满足《指导意见》规定和《基金合同》约定的存续要求，根据《基金合同》的约定，本基金将终止并进入清算程序。

### 3、清算起始日

本基金清算起始日为 2018 年 6 月 27 日。

### 4、清算报表编制基础

本基金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《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，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。

## 五、清算情况

自 2018 年 6 月 27 日至 2018 年 7 月 3 日止的清算期间，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：

### 1、清算费用

按照《东方合家保本混合型证券投资基金基金合同》“第二十二部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，依据《基金合同》，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。但考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算相关的律师费、审计费由本基金管理人承担。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 1,544,184.75 元，该款项将由基金管理人东方基金管理有限责任公司自有资金先行垫付，并于清算款划出日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归本基金管理人所有。

(2) 本基金最后运作日交易保证金为人民币 23,990.69 元，该款项将由基金管理人东方基金管理有限责任公司自有资金先行垫付，并于清算款划出日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归本基金管理人所有。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 25,791.21 元。其中，应收银行

存款利息 25,367.79 元，应收清算备付金利息 416.94 元，应收结算保证金利息 6.48 元。该款项将由基金管理人东方基金管理有限责任公司自有资金先行垫付，并于清算款划出日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归本基金管理人所有。

### 3、 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 18,292.82 元，其中，中债结算费用 3,640.00 元已于 6 月 28 日支付，上清所结算费用 11,010.00 元已于 7 月 3 日支付，剩余款项将于 2018 年 7 月 3 日后支付。

(2) 本基金最后运作日应交税费为人民币 10,205.09 元，该款项将于 2018 年 7 月 3 日后支付。

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 284,564.94 元，该款项将于 2018 年 7 月 3 日后支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 43,779.22 元，该款项将于 2018 年 7 月 3 日后支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 230,001.31 元，为预提信息披露费及审计费。其中，应付赎回费 1.31 元已于 2018 年 6 月 28 日支付；预提信息披露费为人民币 200,000.00 元，该款项将于 2018 年 7 月 3 日后支付；审计费 30,000.00 元，为保护基金份额持有人利益，该费用将由本基金管理人承担，故预提审计费已于 2018 年 6 月 28 日冲回。

### 4、 赎回情况

截止基金最后运作日当日，已确认应付赎回款及应付赎回费合计 42,847,375.24 元。最后运作日当日基金份额持有人申请赎回份额 21,985,202.90 份，申请已于 2018 年 6 月 27 日全部确认成功，共确认应付赎回款及应付赎回费 22,528,204.32 元。以上所有赎回款项已于 2018 年 6 月 29 日完成支付。

自 2018 年 6 月 27 日起，本基金进入清算期，不再接受基金份额持有人提交的各项交易申请，基金剩余份额全部进入清算程序。

#### 5、 清算期间的清算损益情况

份额变动项目	2018 年 6 月 27 日至 2018 年 7 月 3 日
一、运作截止日份额	82,738,771.40
减：二、赎回确认份额	21,985,202.90
三、清算终止日份额	60,753,568.50

金额单位：人民币元

资产损益变动项目	2018 年 6 月 27 日至 2018 年 7 月 3 日
一、清算收益①	40,526.06
1、利息收入	10,493.01
2、赎回费收入	33.05
3、审计费由管理人承担冲回收益	30,000.00
减：二、清算费用②	9,000.00
1、上交所账户维护费	4,500.00
2、中债登账户维护费	4,500.00
三、清算期间净收益 ①- ②	31,526.06

注：①赎回确认份额：到期操作期间截止日 2018 年 6 月 26 日申请赎回并于 6 月 27 日确认成功的基金份额。

②利息收入：2018 年 6 月 27 日至 2018 年 7 月 3 日清算期间计提的银行存款利息、清算备付金利息和结算保证金利息。

③赎回费收入：赎回申请所确认的赎回费中应归属于基金资产的赎回费。

④审计费由管理人承担冲回收益：为保护基金份额持有人利益，基金审计费用由本基金管理人承担，故基金预提审计费于 2018 年 6 月 28 日冲回。

#### 6、 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

金额单位：人民币元

项目	2018 年 6 月 27 日至 2018 年 7 月 3 日
一、最后运作日 2018 年 6 月 26 日基金净资产	84,785,844.10

加：清算期间净收益	31,526.06
减：赎回转出款	22,528,237.37
二、2018年7月3日基金净资产	62,289,132.79

资产处置及负债清偿后，2018年7月3日本基金剩余财产为人民币62,289,132.79元，根据本基金的基金合同约定，依据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。

清算起始日2018年6月27日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。基金管理人将于清算款划出日以自有资金划入托管账户用以垫付结算备付金、交易保证金、应收利息等，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归本基金管理人所有。

## 7、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- (1) 《东方合家保本混合型证券投资基金基金清算审计报告》；
- (2) 《东方合家保本混合型证券投资基金基金清算报告的法律意见》。

### 2、存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）查阅。

### 3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

东方合家保本混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2018年7月3日