

# 安信量化多因子灵活配置混合型证券投资 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：2019年1月4日

## § 1 重要提示

安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金（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”）2016年11月14日证监许可【2016】2653号文准予募集注册，并经机构部函[2017]1689号确认，自2017年7月3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《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《安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本基金于2018年11月23日至2018年12月25日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，此次基金份额持有人大会的计票于2018年12月26日在本基金托管人中国银行股份有限公司授权代表的监督及上海通力律师事务所的见证下进行，并由北京市长安公证处对计票过程及结果进行了公证。根据表决结果，本次会议议案有效通过，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。根据《安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案的说明》，表决生效并公告的下一工作日起，本基金进入清算程序，即本基金基金合同的最后运作日为2018年12月28日，并于下一日进入清算程序。

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 安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

基金简称 安信量化多因子混合

基金主代码 004592

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2017年7月3日

报告期末(2018年12月28日)基金份额

总额 965,619.04 份

投资目标

本基金以量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实

现基金财产的长期稳健增值。

#### 投资策略

资产配置上，通过对宏观经济周期、宏观政策导向、货币供应量、市场估值水平以及市场情绪等因素的分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。股票投资上，本基金主要使用量化选股模型来发掘股票投资价值、构建股票组合，建立科学完整的量化选股体系，从海量历史数据中寻找市场上存在的共性规律，力求取得稳定、可持续、高于基准的超额回报。债券投资上，运用久期管理策略、收益率曲线策略、类别选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。股指期货投资上，本基金以套期保值为目的，在风险可控的前提下，管理投资组合的系统性风险。资产支持证券投资上，综合运用类别资产配置、久期管理等策略，进行资产支持证券产品的投资。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*80%+中债总指数收益率\*20%。

风险收益特征 本基金是一只混合型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

#### 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》、《关于避险策略基金的指导意见》等法律法规的有关规定及《安信安盈保本混合型证券投资基金基金合同》

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

下属分级基金的基金简称 安信量化多因子混合 A 安信量化多因子混合 C

下属分级基金的交易代码 004592 005697

报告期末(2018 年 12 月 28 日)下属分级

基金的份额总额 965,614.24 份 4.80 份

### § 3 基金运作情况

安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金（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”）2016 年 11 月 14 日下发的证监许可【2016】2653 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 2017 年 5 月 10 至 2017 年 6 月 27 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2017 年 7 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 206,537,178.47 份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合 40,645.30 份基金份额）。

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》、《关于终止安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》、《关于终止安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案的说明》的约定，本基金的最后运作日为 2018 年 12 月 28 日，并于下一日进入清算程序。

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：安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 28 日

单位：人民币元

##### 资 产 最后运作日

2018 年 12 月 28 日

资 产：

银行存款 789,930.48

结算备付金 0.03

存出保证金 63,076.15

交易性金融资产 76,950.00

其中：股票投资 76,950.00

应收利息 230.58

应收申购款 395.25

资产总计 930,582.49

负债和所有者权益 最后运作日

2018 年 12 月 28 日

负 债：

应付管理人报酬 3,080.08

应付托管费 513.37

负债合计 3,593.45

所有者权益：

实收基金 965,619.04

未分配利润 -38,630.00

所有者权益合计 926,989.04

负债和所有者权益总计 930,582.49

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 28 日(基金最后运作日)，本基金 A 类基金份额净值 0.9600 元，本基金 C 类基金份额净值 0.9708 元，本基金份额总额 965,619.04 份，其中 A 类基金份额 965,614.24 份，C 类基金份额 4.80 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安永华明(2019)专字第 60962175\_H01 号标准无保留意见的审计报告。

#### § 5 基金财产分配

自最后运作日后至 2019 年 1 月 4 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 本基金最后运作日结算备付金人民币 0.03 元，为存放于国投安信期货的期货备付金。该款项已于 2019 年 1 月 3 日划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币 63,076.15 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的结算保证金。存出保证金于 2019 年 1 月 3 日调整为 66,983.06 元，该款项预计将于 2019 年 2 月 11 日由基金托管行划回。支付清算款之日前若未划回，则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 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 76,950.00 元，系因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票，明细如下：

(金额单位：人民币元)

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	终止日估值单价	数量	终止日成本总额	终止日估值总额
000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大事项	3.80	20,250	99,393.00	76,950.0

注：1、根据《安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》第十四部分“基金资产估值”的约定，交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。流通受限证券中天金融（代码：000540）最后运作日的估值单价按照指数收益法进行计算，具体可查阅《安信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持中天金融（000540）估值调整的公告》。

2、股票中天金融（代码：000540）已于 2019 年 1 月 2 日复牌，并于 2019 年 1 月 4 日恢复活跃交易后全部卖出变现。股票变现金额归基金资产所有，股票卖出产生的费用由基金资产承担。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为人民币 230.58 元。其中应收银行存款利息人民币 207.86 元，应收存出保证金利息人民币 22.72 元，该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。

5.1.5 本基金最后运作日应收申购款为人民币 395.25 元，该款项已于 2019 年 1 月 2 日划入托管户。

## 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 3,080.08 元，该款项已于 2019 年 1 月 3 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 513.37 元，该款项已于 2019 年 1 月 3 日支付。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

项目 自 2018 年 12 月 29 日至 2019 年 1 月 4 日止清算期间

#### 一、清算收益

利息收入 130.55

投资收益 -19,175.00

公允价值变动损益 22,443.00

清算收入小计 3,398.55

#### 二、清算费用

划款手续费 20.00

股票变现交易费用 144.42

清算费用小计 164.42

三、清算净收益 3,234.13

注：1、利息收入系计提的自 2018 年 12 月 29 日至 2019 年 1 月 4 日止清算期间的银行存款利息和存出保证金利息。该利息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、股票变现投资收益及交易费用为中天金融（000540）全部变现产生的收入与交易费用。

### 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 2018 年 12 月 28 日基金净资产 926,989.04

加：清算期间净收益 3,234.13

二、2019 年 1 月 4 日基金净资产 930,223.17

根据《关于终止安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案的说明》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 2019 年 1 月 4 日止的剩余财产为人民币 930,223.17 元。

自 2019 年 1 月 5 日至清算款划出日前一日的归属于持有人的银行存款、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资产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、《安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金清算的法律意见》

### 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>

安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一九年三月五日