

建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金
清算报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告出具日期: 2022 年 3 月 31 日

报告公告日期: 2022 年 4 月 23 日

一、重要提示

建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金（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9月9日证监许可【2016】2078号文注册募集，由建信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《建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人利益，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》和《建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）的有关规定，建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）出现了《基金合同》终止事由，且建信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”）应当在上述事由出现后终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。自2022年2月25日起，本基金进入清算期。

本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见刊登在2022年2月24日中国证监会规定媒介和基金管理人网站（<http://www.ccbfund.cn>）上的《关于建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金清算期自2022年2月25日起至2022年3月11日止。由基金管理人建信基金管理有限责任公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、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的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、基金概况

- 1、基金名称：建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金。
- 2、基金运作方式：契约型定期开放式。
- 3、《基金合同》生效日：2016年11月8日。
- 4、投资目标：在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，通过积极主动

的组合管理，力争获得高于业绩比较基准的投资收益，实现基金资产的长期稳健增值。

5、投资策略：

(1) 封闭期投资策略

本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。具体包括资产配置策略、债券投资组合策略、个券选择策略等。

(2) 开放运作期投资策略

开放运作期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。

6、业绩比较基准：中债综合全价指数收益率。

7、风险收益特征：本基金为债券型基金，属于较低风险基金产品，其长期平均风险和预期收益率低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。

8、基金管理人：建信基金管理有限责任公司。

9、基金托管人：兴业银行股份有限公司。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022年2月24日

单位：人民币元

资产	本期末 2022 年 2 月 24 日（基金最后运作日）
资产：	
银行存款	1,294,652.70
结算备付金	5,007,957.17
存出保证金	25,409.91
买入返售金融资产	
应收利息	
应收申购款	
证券清算款	
资产总计	6,328,019.78
负债和所有者权益	

负债:	
应付赎回款	
应付赎回费	
应付管理人报酬	1,118,452.44
应付托管费	
应付销售服务费	
应付交易费用	42,584.36
其他负债	5,160,590.46
负债合计	6,321,627.26
所有者权益:	
实收基金	6,333.38
未分配利润	59.14
所有者权益合计	6,392.52
负债和所有者权益总计	6,328,019.78

注:报告截止日 2022 年 2 月 24 日(基金最后运作日),基金份额总额 6,333.38 份,基金份额净值为人民币 1.0093 元。

四、清盘事项说明

1、基本情况

建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金(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 9 月 9 日证监许可【2016】2078 号文注册,由建信基金管理有限责任公司于 2016 年 11 月 4 日至 2016 年 11 月 7 日向社会公开募集,《基金合同》于 2016 年 11 月 8 日生效。首次设立募集规模为 24,800,002,141.04 份基金份额。

本基金为契约型定期开放式,存续期限为不定期。本基金的基金管理人及登记机构均为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购等金融工具,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。

本基金不参与投资股票、权证等权益类资产,但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而形成的权证。

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。

基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，在封闭期，本基金不受前述 5% 的限制；如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例限制会做相应调整。

2、清算原因

本基金出现了《基金合同》终止事由，且建信基金管理有限责任公司应当在上述事由出现后终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。

3、清算起始日

根据《关于建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金自 2022 年 2 月 25 日起进入清算程序。

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。基金管理人编制清算报表是为了呈报建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金全体持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。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 2022 年 2 月 25 日起至 2022 年 3 月 11 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《建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》“基金合同的

变更、终止与基金财产的清算”这个部分的规定，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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 1,294,652.70 元，其中包含应计利息为人民币 726,282.58 元。清算期间产生的计提银行存款利息为人民币 168,720.30 元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币 5,161,575.36 元，其中应计银行存款利息余额为人民币 895,002.88 元；

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 5,007,957.17 元，其中上海结算备付金为人民币 5,000,000.00 元，应计利息为人民币 7,957.17 元。清算期间上海结算备付金计提利息为人民币 1,125.00 元，其中结算备付金人民币 5,000,000.00 元已于 2022 年 3 月 2 日划入托管账户。截至清算期结束日，结算备付金余额为人民币 9,082.17 元，均为备付金利息；

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 25,409.91 元，其中上海存出保证金为人民币 25,346.62 元，应计利息为人民币 63.29 元。清算期间转入上海存出保证金为人民币 7,632.55 元，计提利息为人民币 20.50 元；转入深圳存出保证金为人民币 825.90 元，计提利息为人民币 0.40 元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币 33,889.26 元，其中存出保证金利息余额为人民币 84.19 元。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,118,452.44 元，该款项已于清算期间支付；

(2) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 42,584.36 元，该款项已于清算期间支付；

(3) 本基金最后运作日其他应付款为人民币 5,001,117.29 元，其中管理人垫付款为人民币 5,000,000.00 元，垫付款孳生的应付利息为人民币 14.90 元，应付划款手续费为人民币 1,102.39 元。清算期间计提的利息为人民币 449.48 元，计提银行手续费为人民币 215.26 元，支付手续费为人民币 1,102.39 元。截至清算期结束日，其他应付款余额为人民币 5,000,679.64 元，将于清算结束后支付；

(4) 本基金最后运作日预提费用为人民币 159,473.17 元，其中预提上清所

查询服务费为人民币 200.00 元，预提审计费为人民币 125,000.00 元，预提信息披露费为人民币 28,273.17 元，预提账户维护费为人民币 6,000.00 元。清算期间计提律师费为人民币 15,000.00 元。上清所查询服务费、账户维护费、审计费已于清算期间支付。截至清算期结束日，预提费用余额为人民币 43,273.17 元，将于清算结束后支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

	自 2022 年 2 月 25 日起 至 2022 年 3 月 11 日止的清算期间
一、清算期间收益	
利息收入（注 1）	169,416.72
清算收入小计	169,416.72
二、清算期间费用	
银行划款手续费	215.26
律师费	15,000.00
清算费用小计	15,215.26
三、清算净收益	154,201.46

注 1：利息收入包括银行活期存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

5、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

建信恒安一年定期开放债券(基金代码：003394)

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 2 月 24 日基金净资产	6,392.52
加：清算期间收益	169,416.72
减：清算期间费用	15,215.26
二、2022 年 3 月 11 日基金资产净值	160,593.98

注：截至 2022 年 3 月 11 日（清算期结束日），本基金剩余财产为人民币 160,593.98 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在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。

自清算期结束日次日 2022 年 3 月 12 日至清算款划出日前一日的银行存款等产生的利息亦属份额持有人所有，按实际适用的利率计算。基金管理人垫付资金

到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

6、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) 《建信恒安一年定期开放债券型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《建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

报告出具日期：2022年3月31日

报告公告日期：2022年4月23日