

# 东方赢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：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2016年12月26日

清算报告公告日：2017年1月11日

## 一、重要提示

东方赢家保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由东方基金管理有限责任公司担任基金管理人，由中国民生银行股份有限公司担任基金托管人，本基金根据 2015 年 4 月 30 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东方赢家保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]797 号）进行募集，基金合同于 2015 年 6 月 12 日生效。

本基金为保本基金，保本周期为 18 个月，本基金第一个保本周期到期日为 2016 年 12 月 12 日。本基金第一个保本周期的担保人由瀚华担保股份有限公司担任。

根据《东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）第三部分“十二、基金保本周期”的约定，“如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，或不符法律法规和《基金合同》对基金的存续要求，则本基金将根据本基金合同的规定终止并进入清算程序”。

经与担保人瀚华担保股份有限公司协商一致，本基金第一个保本周期到期后，不再进行第二个保本周期的合作事宜，基金管理人也未能找到其他适合的担保机构，故本基金不再满足保本基金存续条件，本基金根据基金合同的约定终止并进入清算程序。基金管理人已于 2016 年 12 月 7 日、2016 年 12 月 8 日和 2016 年 12 月 9 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》和基金管理人网站（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和提示性公告，详见《东方基金管理有限责任公司关于东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》、《东方基金管理有限责任公司关于东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第一次提示性公告》和《东方基金管理有限责任公司关于东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的第二次提示性公告》。

本基金自 2016 年 12 月 13 日起进入清算期，由基金管理人东方基金管理有限责任公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、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、基金概况

### 1、基金基本情况

基金名称	东方赢家保本混合型证券投资基金
基金简称	东方赢家保本混合
基金主代码	001317
前端交易代码	001317
基金运作方式	契约型，以定期开放式运作
基金合同生效日	2015年6月12日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
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，在有效控制投资风险的前提下，力求基金资产的长期、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风险资产和固定收益类资产上的投资比例。
业绩比较基准	$(\text{一年期银行定期存款税后收益率} + 1\%) \times 1.5$
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。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

## 三、财务会计报告

### 资产负债表（经审计）

会计主体：东方赢家保本混合型证券投资基金

最后运作日：2016年12月12日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2016年12月12日
<b>资产：</b>	
银行存款	566,405,552.90
结算备付金	3,892,040.62
存出保证金	131,800.28
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	90,580.54
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	570,519,974.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>最后运作日 2016年12月12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	-
应付管理人报酬	149,758.11
应付托管费	28,079.65
应付销售服务费	56,159.29
应付交易费用	357,259.60
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	359,300.00
负债合计	950,556.65
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	527,894,279.79
未分配利润	41,675,137.90
所有者权益合计	569,569,417.69
负债和所有者权益总计	570,519,974.34

注：基金最后运作日 2016 年 12 月 12 日，基金份额净值 1.0789 元，基金份额总额 527,894,279.79 份。

## 四、清算报表附注

### 1、基金基本情况

东方赢家保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 4 月 30 日由中国证监会《关于准予东方赢家保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]797 号）准予募集注册，2015 年 5 月 19 日获得中国证监会证券基金机构监管部《关于东方赢家保本混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（证券基金机构监管部函[2015]1427 号）后，由东方基金管理有限责任公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规的规定和《东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同》、《东方赢家保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关约定，于 2015 年 6 月 3 日至 2015 年 6 月 9 日公开募集。募集结束后，经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2015]第 01300047 号”验资报告验证，并由中国证监会证券基金机构监管部《关于东方赢家保本混合型证券投资基金备案确认的函》（证券基金机构监管部函[2015]1792 号）予以备案，本基金基金合同于 2015 年 6 月 12 日生效，募集期间扣除认购费的实收资金（不包括认购资金利息）为 527,872,567.40 元人民币，折合本基金基金份额 527,872,567.40 份，认购资金在募集期间产生的利息 21,712.39 元人民币，折合本基金基金份额 21,712.39 份，本基金基金合同生效日的基金份额总额为 527,894,279.79 份。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规的规定和《东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，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）。

本基金将主要根据 CPPI 固定比例投资组合保险策略，将投资对象主要分为固定收益类资产和风险资产两类，并动态调整两类资产的投资比例，从而达到防御下跌、实现增值的目的。其中，固定收益类资产包括国债、中央银行票据、地方政府债、金融债（含政策性金融债）、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具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固定收益类金融工具；风险资产包括股票、权证、可转换债券（含可分离

交易可转债)等权益类资产。

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《东方赢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2016年12月7日发布的《关于东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金第一个保本周期的到期日为2016年12月12日,基金份额持有人可在该日赎回或转换转出本基金基金份额,并适用保本条款。2016年12月12日未赎回的基金份额,于2016年12月13日全部进入清算程序。

## 2、清算原因

经与担保人瀚华担保股份有限公司协商一致,本基金第一个保本周期到期后,不再进行第二个保本周期的合作事宜,基金管理人也未能找到其他适合的担保机构,故本基金不再满足保本基金存续条件,根据《基金合同》的约定,本基金终止并进入清算程序。

## 3、清算起始日

根据《关于东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金清算起始日为2016年12月13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2016年12月13日至2016年12月26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:

## 1、清算费用

按照《东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同》第二十部分“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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。但从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的审计费用、律师费用由基金管理人承担，银行汇划费用等从基金财产中列支。

## 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 3,892,040.62 元，该款项由基金管理人东方基金管理有限责任公司自有资金垫付，并已于 2016 年 12 月 15 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 131,800.28 元，该款项由基金管理人东方基金管理有限责任公司自有资金垫付，并已于 2016 年 12 月 15 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基金管理人所有。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 90,580.54 元，该款项由基金管理人东方基金管理有限责任公司自有资金垫付，并已于 2016 年 12 月 15 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管理人报酬为人民币 149,758.11 元，该款项将于 2016 年 12 月 26 日后支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 28,079.65 元，该款项将于 2016 年 12 月 26 日后支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 56,159.29 元，该款项将于 2016 年 12 月 26 日后支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 357,259.60 元，该款项将于 2016 年 12 月 26 日后支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 359,300.00 元，为预提信息披露费及银行间账户维护费。其中，预提信息披露费为人民币 350,000.00 元将于 2016 年 12 月 26 日后支付；预提银行间账户维护费为人民币 9,300.00 元将于 2016 年 12 月 26

日后支付。

#### 4、保本到期日赎回情况

根据东方基金管理有限责任公司于2016年12月7日发布的《关于东方赢家保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金第一个保本周期的到期日为2016年12月12日，基金份额持有人可在该日赎回或转换转出本基金基金份额。2016年12月13日确认赎回及转出份额489,341,574.81份，应付赎回及转出款527,950,623.63元已于2016年12月15日完成支付。

#### 5、清算期间的清算损益情况

自2016年12月13日至2016年12月26日止清算期间

项目	金额（单位：人民币元）
一、清算收益	
利息收入- 银行存款利息收入（注1）	45,531.94
<b>清算收入小计①</b>	<b><u>45,531.94</u></b>
二、清算费用	
银行划款手续费	220.00
<b>清算费用小计②</b>	<b><u>220.00</u></b>
<b>三、清算净收益 ①- ②</b>	<b><u>45,311.94</u></b>

注1：利息收入系计提的自2016年12月13日至2016年12月26日清算期间的银行存款、结算备付金及交易保证金的利息等。

#### 6、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额（单位：人民币元）
一、最后运作日2016年12月12日基金净资产	569,569,417.69
减：保本到期日赎回转出款	527,950,623.63
加：清算期间净收益	45,311.94
二、2016年12月26日基金净资产	<b><u>41,664,106.00</u></b>

资产处置及负债清偿后，2016年12月26日本基金剩余财产为人民币41,664,106.00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 2016 年 12 月 13 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。基金管理人以自有资金垫付并已于 2016 年 12 月 15 日划入托管账户人民币 4,114,421.44 元，用以垫付结算备付金、交易保证金及应收利息等，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。

## 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)《东方赢家保本混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2)《东方赢家保本混合型证券投资基金清算报告》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）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。

东方赢家保本混合型证券投资基金  
基金财产清算小组  
2017 年 1 月 11 日