

安信优享纯债债券型证券投资基金

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：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年10月29日

清算报告公告日：2021年11月9日

§ 1 重要提示

安信优享纯债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”）2018年5月24日下发的证监许可[2018]850号文准予募集注册，并经机构部函[2018]2856号确认，自2018年12月7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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《安信优享纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，《基金合同》生效后，连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当终止《基金合同》，并根据《基金合同》第十九部分的约定进行财产清算，而无须召开基金份额持有人大会，同时向中国证监会报告。截至2021年10月21日，本基金基金资产净值连续60个工作日低于5000万元，触发基金合同中约定的终止条款。

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、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	安信优享纯债债券型证券投资基金
基金简称	安信优享纯债债券
基金主代码	006563
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月7日
报告期末(2021年10月21日)基金份额总额	940,488.01份
投资目标	本基金在控制组合净值波动率的前提下，力争实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面，本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定各类债券的配置比例。债券投资方面，灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、个券挖掘策略和可转换债券投资策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，最大化组合收益。资产支持证券投资方面，本基金将通过资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。

业绩比较基准	中债综合指数收益率	
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、股票型基金。	
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》等法律法规的有关规定及《安信优享纯债债券型证券投资基金基金合同》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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安信优享纯债债券 A	安信优享纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	006563	012825
报告期末下属分级基金的份额总额	11,379.03 份	929,108.98 份

§ 3 基金运作情况

安信优享纯债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”）2018年5月24日下发的证监许可[2018]850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2018年11月16日至2018年12月5日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2018年12月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为450,000,551.92份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合0.02份基金份额）。

根据本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于2021年6月28日发布的《关于安信优享纯债债券型证券投资基金新增C类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》，本基金自2021年6月28日起增加C类份额。

根据基金管理人于2021年10月22日发布的《安信基金管理有限责任公司关于安信优享纯债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》，本基金的最后运作日为2021年10月21日，并于2021年10月22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：安信优享纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021年10月21日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2021年10月21日
资 产:	
银行存款	45,224.90
结算备付金	9,054.06
存出保证金	987.31
交易性金融资产	850,545.00
其中：债券投资	850,545.00
买入返售金融资产	120,000.00
应收证券清算款	6.45
应收利息	16,281.29
资产总计	1,042,099.01
负债和所有者权益	最后运作日 2021年10月21日
负 债:	
应付管理人报酬	177.25
应付托管费	59.10
应付销售服务费	58.33
应付税费	18.26
预提上清所账户维护费	1,600.00
预提审计费	12,053.80
负债合计	13,966.74
所有者权益:	
实收基金	940,488.01
未分配利润	87,644.26
所有者权益合计	1,028,132.27
负债和所有者权益总计	1,042,099.01

注：1、报告截止日 2021 年 10 月 21 日(基金最后运作日)，本基金 A 类基金份额净值 1.0931 元，本基金 C 类基金份额净值 1.0932 元。基金份额总额 940,488.01 份，其中 A 类基金份额 11,379.03 份，C 类基金份额 929,108.98 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(2021)专字第 60962175_H08 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（2021 年 10 月 21 日）后至 2021 年 10 月 27 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 9,054.06 元，为存放于上海证券交易所和深圳证券交易所的结算备付金。根据中登结算备付金管理办法的计算规则，预计 11 月 2 日中登将继续从托管户扣收备付金，预计最终该款项将于 2021 年 12 月 2 日由中登备付金账户划回托管户。支付清算款之日前未划回的部分，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。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币 987.31 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。该款项预计将于 2021 年 11 月 2 日划回托管户。

5.1.3 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 6.45 元，该款项已于 2021 年 10 月 22 日划入托管户。

5.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 850,545.00 元，已于 2021 年 10 月 22 日全部卖出变现。变现金额合计人民币 866,900.24 元归基金资产所有，交易费用由基金资产承担。

5.1.5 本基金最后运作日买入返售金融资产为人民币 120,000.00 元，已于 2021 年 10 月 22 日全部卖出变现。变现金额归基金资产所有，交易费用由基金资产承担。

5.1.6 本基金最后运作日应收利息为人民币 16,281.29 元。其中应收债券利息 16,232.27 元，已于 2021 年 10 月 22 日随债券卖出变现完毕。应收银行存款利息人民币 33.94 元，应收结算备付金利息人民币 13.53 元，应收存出保证金利息人民币 1.55 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。

5.2 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 177.25 元，该款项已于 2021 年 10 月 28 日安排支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 59.10 元，该款项已于 2021 年 10 月 28 日安排支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 58.33 元，该款项已于 2021 年 10 月 28 日安排支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付税费为人民币 18.26 元，该款项已于 2021 年 10 月 28 日安排支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 13,653.80 元，其中预提清算审计费人民币

12,053.80 元，该款项将于 11 月安排支付；预提上清所账户维护费人民币 1,600.00，该款项已于 2021 年 10 月 28 日安排支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2021年10月22日至2021年10月27日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入	144.28
2、投资收益	65.00
清算收入小计	209.28
二、清算费用	
债券变现交易费用	0.86
清算费用小计	0.86
三、清算净收益	208.42

注：1、利息收入系计提的自 2021 年 10 月 22 日至 2021 年 10 月 27 日止清算期间的债券利息、银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。支付清算款之日前未收到部分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、投资收益系清算期间债券差价收入。

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2021年10月21日基金净资产	1,028,132.27
加：清算期间净收益	208.42
二、2021年10月27日基金净资产	1,028,340.69

根据《安信基金管理有限责任公司关于安信优享纯债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》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 2021 年 10 月 27 日止的剩余财产为人民币 1,028,340.69 元，其中包括未变现资产：结算备付金人民币 9,054.06 元，存出保证金人民币 987.31 元，应收利息人民币 116.40 元。支付清算款之日前未变现的部分，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。

自 2021 年 10 月 28 日至清算款划出前一日的归属于持有人的银行存款、结算备付金、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、《安信优享纯债债券型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海通力律师事务所关于〈安信优享纯债债券型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

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>

安信优享纯债债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2021年10月29日