

安信量化优选股票型发起式证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2025年3月31日

清算报告公告日：2025年4月8日

§ 1 重要提示

安信量化优选股票型发起式证券投资基金（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 7 月 13 日下发的中国证监会证监许可[2018]1119 号文准予募集注册，自 2018 年 9 月 3 日起《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“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（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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，本基金《基金合同》生效日为 2018 年 9 月 3 日，《基金合同》生效满 3 年后本基金继续存续的，若连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形的，则触发《基金合同》终止的情形。截至 2025 年 3 月 25 日，本基金《基金合同》生效满 3 年且连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形，本基金根据《基金合同》第十九部分的约定进入基金财产清算程序并终止《基金合同》，而无需召开基金份额持有人大会，即本基金的最后运作日为 2025 年 3 月 25 日。

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	安信量化优选股票型发起式证券投资基金
基金简称	安信量化优选股票
基金主代码	006346
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 3 日
报告期末(2025 年 3 月 25 日日终)基金份额总额	1,386,646.86 份
投资目标	本基金以数量化分析为基础，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	本基金使用量化模型构建股票组合，主要基于对股票市场及上市公

	司相关数据的深度挖掘，在综合数据可获得性、建模复杂程度的基础上，对数据进行个性化的分析处理，形成了一套完善的选股体系，并据此构建股票组合。资产配置方面，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，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，适度降低组合系统性风险。债券投资方面，采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。同时，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将采用国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。
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《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	中国工商银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况

本基金经中国证监会 2018 年 7 月 13 日下发的中国证监会证监许可[2018]1119 号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规的有关规定及《基金合同》的约定负责公开募集。本基金《基金合同》于 2018 年 9 月 3 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额总额为 10,026,300.59 份，其中有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息折合 3.08 份基金份额。

根据基金管理人于 2025 年 3 月 26 日发布的《安信基金管理有限责任公司关于安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，截至 2025 年 3 月 25 日，本基金生效满 3 年且连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形，已触发《基金合同》终止的情形，根据《基金合同》第十九部分的约定进入基金财产清算程序并终止《基金合同》。本基金的最后运作日为 2025 年 3 月 25 日，并于 2025 年 3 月 26 日起

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：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 3 月 25 日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2025年3月25日
资产：	
货币资金	3,218,838.34
结算备付金	1,801.06
交易性金融资产	2,244,236.48
其中：股票投资	2,042,538.18
债券投资	201,698.30
应收申购款	652.61
资产总计	5,465,528.49
负债和净资产	最后运作日 2025年3月25日
负债：	
应付赎回款	2,842,562.77
应付管理人报酬	9,839.52
应付托管费	1,639.93
应付销售服务费	1,926.60
其他负债	76,271.83
负债合计	2,932,240.65
净资产：	
实收基金	1,386,646.86
未分配利润	1,146,640.98
净资产合计	2,533,287.84
负债和净资产总计	5,465,528.49

注：（1）报告截止日 2025 年 3 月 25 日（基金最后运作日），本基金份额总额 1,386,646.86 份，其中安信量化优选股票 A 基金份额总额 671,301.82 份，基金份额净值 1.8503 元；安信量化优选股票 C 基金份额总额 715,345.04 份，基金份额净值 1.8050 元。

（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（2025）专字第 70024611_H36 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

自 2025 年 3 月 26 日至 2025 年 3 月 30 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 本基金最后运作日银行存款人民币 3,218,838.34 元，其中托管户存款为人民币 262,094.72 元，应计银行存款利息为人民币 20.00 元，券商户存款为人民币 2,956,652.08 元，应计券商户存款利息为人民币 71.54 元。应计券商户存款利息已于 2025 年 3 月 28 日结息到账。支付清算款之日前未结息到账的应计银行存款利息款项预计将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金 1,801.06 元，全部为国投期货备付金利息，已于 2025 年 3 月 26 日结息并全部划入托管户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 2,244,236.48 元，其中交易性股票投资 2,042,538.18 元、交易性债券投资 201,698.30 元，交易性股票投资于 2025 年 3 月 27 日全部完成变现，交易性债券投资于 2025 年 3 月 26 日全部完成变现，相关款项已于 2025 年 3 月 28 日前全部划回托管户。

5.1.4 本基金最后运作日应收申购款 652.61 元，已于 2025 年 3 月 26 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赎回款为人民币 2,842,562.77 元，该款项已于 2025 年 3 月 26 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 9,839.52 元，该款项预计于清算期结束后安排支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,639.93 元，该款项预计于清算期结束后安排支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,926.60 元，该款项预计于清算期结束后安排支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 76,271.83 元，其中应付交易费用为人民币 63,967.31 元，该款项预计于清算期结束后安排支付；预提清算审计费及应支付 2024 年审计费合计为人民币 12,300.00 元，该款项预计于清算期结束后安排支付；应付赎回费为人民币 4.52 元，已于 2025 年 3 月 26 日支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2025年3月26日至2025年3月30日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入	5.78
2、投资收益	5,323.47
3、其他收入	0.87
清算收入小计	5,330.12
二、清算费用	
1、划款手续费	182.13
清算费用小计	182.13
三、清算净收益	5,147.99

注：（1）利息收入系清算期间产生的银行存款利息，及券商户存款利息、期货备付金利息。

（2）投资收益系清算期间持有股票资产及债券资产变现的收益。

（3）其他收入为赎回费归基金资产产生的收益。

（4）划款手续费系清算期间支付赎回款产生的银行汇划费与根据托管户最新收费标准预提的费用，实际产生金额可能与预估金额存在差异，差异部分由基金管理人承担。

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2025年3月25日基金净资产	2,533,287.84
加：清算期间净收益	5,147.99
减：基金净赎回金额（确认的2025年3月25日投资者净赎回（含转出）申请）	1,516,218.74
二、2025年3月30日基金净资产	1,022,217.09

根据《基金合同》及《安信基金管理有限责任公司关于安信量化优选股票型发起式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本基金债务后，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 2025 年 3 月 30 日归属于剩余基金份额持有人的净资产为人民币 1,022,217.09 元，其中剩余未到账资产为应计银行存款利息人民币 66.34 元。

自清算期结束日次日（2025 年 3 月 31 日）至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有。为保护份额持有人利益，支付清算款之日前未结息的应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付以加快清算速度，实际结息到账金额与垫付金额有差异的由基金管理人承担。

最终支付清算款金额以本基金登记机构的记录为准。基金管理人垫付的资金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,在托管户销户前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、《安信量化优选股票型发起式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〈安信量化优选股票型发起式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

投资者可在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅上述文件。

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>

安信量化优选股票型发起式证券投资基金
基金财产清算小组
2025年3月31日