

## 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

清算报告出具日期：2019年3月5日

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]1693号文批准注册，并经机构函固函[2017]1689号确认，自2017年3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，审议并通过了《关于本基金修改基金合同的议案》，基金合同有关条款案案通过，本基金将更名为安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金，基金名称变更为“安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金”，基金合同变更为“安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金合同”，基金合同自2018年12月26日起生效。根据相关法律法规的规定，本基金将向持有人大会决议通过之日起生效。根据《安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定，基金管理人将向持有人大会决议通过之日起十个工作日内，将基金合同的修订后的文本登载于基金管理人网站（http://www.esscn.com）和中国证监会指定的基金信息披露媒体上，并于下一日起在销售机构（单位：股）

本基金的基本原则是，基金管理人、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”）和上海市浦东律师事务所将根据本基金财产净值小数保留金额和货币资金余额情况，并由上海浦东律师事务所（以下简称“普信普德”）对本基金进行清算审计，上海市浦东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
基金代码	004992
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
报告期截至2018年12月28日基金份额总额	906,619,040份
投资目标	本基金主要通过量化分析为本基金在严格控制基金财产的风险和保证基金财产流动性的同时，追求超越比较基准的基本的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将通过量化分析方法，在严格控制基金财产的风险和保证基金财产流动性的同时，追求超越比较基准的基本的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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	本基金是一只股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于股票型基金，高于货币型基金和债券型基金。
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《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合同的说明》的约定，本基金的最后运作日为2018年12月28日，并于下一日起进入清算程序。
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
下属分级基金的交易代码	004992
报告期截至2018年12月28日的分级份额	906,614,240份
基金的份额总额	480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日证监许可[2016]1693号文准予注册，基金管理人依法办理《基金合同》、《基金招募说明书》、《基金产品资料概要》、《基金托管协议》、《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合同的说明》的约定，本基金的最后运作日为2018年12月28日，并于下一日起进入清算程序。

### § 4 财务会计报告

4.1 最后运作日资产负债表（经审计）  
会计主数据：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

资产	最后运作日 2018年12月28日
资产：	
银行存款	789,390.48
结算备付金	0.03
存出保证金	63,076.15
交易性金融资产	76,960.00
其中：股票投资	76,960.00
应收利息	2,030.68
应收申购款	306.25
资产总计	930,582.49
负债：	
应付管理人报酬	3,000.08
应付托管费	513.37
负债合计	3,593.45
所有者权益：	
实收基金	906,614.00
未分配利润	-38,630.00
所有者权益合计	906,614.00
负债和所有者权益总计	930,582.49

注1.报告期末至2018年12月28日最后一个运作日止，本基金A类基金份额净值为0.9000元，本基金C类基金份额净值为0.90708元，本基金B类基金份额净值0.61040元，其中A类基金份额净值906,614.240份，C类基金份额480份。

2.本报告告白已按安永华明会计师事务所（普通合伙）审计，注册会计师签字出具了安永华明（2019）专审字第6062017H\_01号标准无保留意见的审计报告。

### § 5 基金资产分配

自报告期末至报告期末，本基金资产全部用于支付基金管理人的管理费、托管费和报告期的审计费用。

4.4 最后运作日资产负债表（经审计）  
会计主数据：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

资产	最后运作日 2018年12月28日
资产：	
银行存款	789,390.48
结算备付金	0.03
存出保证金	63,076.15
交易性金融资产	76,960.00
其中：股票投资	76,960.00
应收利息	2,030.68
应收申购款	306.25
资产总计	930,582.49
负债：	
应付管理人报酬	3,000.08
应付托管费	513.37
负债合计	3,593.45
所有者权益：	
实收基金	906,614.00
未分配利润	-38,630.00
所有者权益合计	906,614.00
负债和所有者权益总计	930,582.49

注2.报告期末至报告期末，本基金资产全部用于支付基金管理人的管理费、托管费和报告期的审计费用。

4.5 最后运作日资产负债表（经审计）  
会计主数据：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

资产	最后运作日 2018年12月28日
资产：	
银行存款	789,390.48
结算备付金	0.03
存出保证金	63,076.15
交易性金融资产	76,960.00
其中：股票投资	76,960.00
应收利息	2,030.68
应收申购款	306.25
资产总计	930,582.49
负债：	
应付管理人报酬	3,000.08
应付托管费	513.37
负债合计	3,593.45
所有者权益：	
实收基金	906,614.00
未分配利润	-38,630.00
所有者权益合计	906,614.00
负债和所有者权益总计	930,582.49

注3.报告期末至报告期末，本基金资产全部用于支付基金管理人的管理费、托管费和报告期的审计费用。

4.6 最后运作日资产负债表（经审计）  
会计主数据：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

资产	最后运作日 2018年12月28日
资产：	
银行存款	789,390.48
结算备付金	0.03
存出保证金	63,076.15
交易性金融资产	76,960.00
其中：股票投资	76,960.00
应收利息	2,030.68
应收申购款	306.25
资产总计	930,582.49
负债：	
应付管理人报酬	3,000.08
应付托管费	513.37
负债合计	3,593.45
所有者权益：	
实收基金	906,614.00
未分配利润	-38,630.00
所有者权益合计	906,614.00
负债和所有者权益总计	930,582.49

注4.报告期末至报告期末，本基金资产全部用于支付基金管理人的管理费、托管费和报告期的审计费用。

4.7 最后运作日资产负债表（经审计）  
会计主数据：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

资产	最后运作日 2018年12月28日
资产：	
银行存款	789,390.48
结算备付金	0.03
存出保证金	63,076.15
交易性金融资产	76,960.00
其中：股票投资	76,960.00
应收利息	2,030.68
应收申购款	306.25
资产总计	930,582.49
负债：	
应付管理人报酬	3,000.08
应付托管费	513.37
负债合计	3,593.45
所有者权益：	
实收基金	906,614.00
未分配利润	-38,630.00
所有者权益合计	906,614.00
负债和所有者权益总计	930,582.49

注5.报告期末至报告期末，本基金资产全部用于支付基金管理人的管理费、托管费和报告期的审计费用。

4.8 最后运作日资产负债表（经审计）  
会计主数据：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

资产	最后运作日 2018年12月28日
资产：	
银行存款	789,390.48
结算备付金	0.03
存出保证金	63,076.15
交易性金融资产	76,960.00
其中：股票投资	76,960.00
应收利息	2,030.68
应收申购款	306.25
资产总计	930,582.49
负债：	
应付管理人报酬	3,000.08
应付托管费	513.37
负债合计	3,593.45
所有者权益：	
实收基金	906,614.00
未分配利润	-38,630.00
所有者权益合计	906,614.00
负债和所有者权益总计	930,582.49

注6.报告期末至报告期末，本基金资产全部用于支付基金管理人的管理费、托管费和报告期的审计费用。

4.9 最后运作日资产负债表（经审计）  
会计主数据：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

资产	最后运作日 2018年12月28日





<tbl\_r cells="2" ix="5" maxcspan="1" maxr