

信诚惠选债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇一八年四月十七日

清算报告公告日期：二〇一八年六月九日

1、重要提示

1.1 重要提示

信诚基金管理有限公司经中国证监会批准于 2005 年 9 月 30 日注册成立。因业务发展需要，经国家工商行政管理总局核准，公司名称由信诚基金管理有限公司变更为中信保诚基金管理有限公司（以下简称我司），并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

根据《中华人民共和国合同法》第七十六条的规定，合同当事人名称变动不影响合同义务的履行。本次我司名称变更后，以信诚基金管理有限公司或中信保诚基金管理有限公司签署的法律文件（包括但不限于公司合同、公告等，以下简称原法律文件）不受任何影响，我司将按照原法律文件的约定行使权利、履行义务。如原法律文件对生效条件、有效期限进行特别说明的，以原法律文件的说明为准。

信诚惠选债券型证券投资基金（以下简称本基金）依据中国证监会证监许可[2016]2273 号文准予注册，由中信保诚基金管理有限公司依照《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《信诚惠选债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案，本基金的基金合同于 2017 年 7 月 12 日正式生效，本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司（以下简称基金管理人），基金托管人为中信银行股份有限公司（以下简称基金托管人）。

鉴于市场环境的变化，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《信诚惠选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，本基金管理人于 2017 年 12 月 7 日至 2018 年 1 月 5 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止信诚惠选债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2018 年 1 月 8 日表决通过了《关于终止信诚惠选债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，大会决议自该日起生效，表决结果及决议生效的公告详见 2018 年 1 月 9 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站上的《中信保诚基金管理有限公司关于信诚惠选债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日定为 2018 年 1 月 8 日，并于 2018 年 1 月 9 日进入清算期。

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司、基金托管人中信银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2018 年 1 月 9 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称 信诚惠选债券型证券投资基金

基金简称 信诚惠选债券

基金主代码 信诚惠选 A:004539；信诚惠选 C:004540

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2017 年 7 月 12 日

基金管理人 中信保诚基金管理有限公司

基金托管人 中信银行股份有限公司

基金合同存续期 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,追求基金资产的长期稳健增值。

投资策略 1、资产配置策略

本基金的大类资产配置主要通过自上而下的配置完成,主要对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势等,并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率,在限定投资范围内,决定债券类资产、股票类等工具的配置比例,动态调整股票、债券类资产在给定区间内的配置比例。

2、债券投资策略

(1)类属资产配置策略

在整体资产配置的基础上,本基金将通过考量不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、流动性风险、税收等因素,研究各投资品种的利差及其变化趋势,制定债券类属资产配置策略,以获取债券类属之间利差变化所带来的潜在收益。

(2)普通债券投资策略

对于普通债券,本基金将在严格控制目标久期及保证基金资产流动性的前提下,采用目标久期控制、期限结构配置、信用利差策略、相对价值配置、杠杆策略等策略进行主动投资。

3、股票投资策略

本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股。

本基金在进行个股筛选时,将主要从定性和定量两个角度对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司。

4、资产支持证券的投资策略

对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,采用数量化的定价模型跟踪资产支持证券的价格走势,在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。

5、其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。基金将在有效进行风险管理的前提下,通过对标的品种的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资。

在符合法律、法规相关限制的前提下,基金管理人按谨慎原则确定本基金衍生工具的总风险暴露。

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,本基金可以相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新或相关公告中公告。

风险收益特征 本基金为债券型基金,预期风险与预期收益低于股票型基金与混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等偏低风险收益品种。

3、基金运作情况概述

经中国证监会证监许可[2016]2273号文准予注册,由基金管理人于2017年4月6日至2017年7月5日向社会公开发行募集,《基金合同》于2017年7月12日正式生效,募集规模为203,728,088.64份基金份额。

鉴于市场环境的变化,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《信诚惠选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,本基金管理人于2017年12月7日至2018年1月5日以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议了《关于终止信诚惠选债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,并于2018年1月8日表决

通过，大会决议自该日起生效。本基金于 2018 年 1 月 9 日起进入清算期。

4、财务会计报告

4.1 资产负债表（已经审计）

会计主体：信诚惠选债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 1 月 8 日

最后运作日

2018 年 1 月 8 日

资产：

银行存款 20,141,026.02

结算备付金 896,190.48

存出保证金 644.61

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

衍生金融资产

买入返售金融资产

应收证券清算款 4,063,472.26

应收利息 2,188.16

应收股利

应收申购款

其他资产

资产总计 25,103,521.53

负债：

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 24,217,651.30

应付管理人报酬 3,059.62

应付托管费 611.92

应付销售服务费 610.64

应付交易费用

应交税费

应付利息

应付利润

其他负债 85,553.32

负债合计 24,307,486.80

所有者权益：

实收基金 792,577.38

未分配利润 3,457.35

所有者权益合计 796,034.73

负债和所有者权益总计 25,103,521.53

4.2 利润表（已经审计）

项目 本期金额

一、收入 23,427.69

1.利息收入 22,867.70

其中：存款利息收入 802.06

债券利息收入 77.15

资产支持证券利息收入 -

买入返售金融资产收入 21,988.49

2.投资收益（损失以-填列） -145.81

其中：股票投资收益 -

基金投资收益 -

债券投资收益 -145.81

资产支持证券投资收益 -

衍生工具收益 -

衍生工具收益 -

3.公允价值变动收益（损失以-号填列） 705.80

4.其他收入（损失以-号填列） -

二、费用 6,248.35

1、管理人报酬 3,059.62

2、托管费 611.92

3、销售服务费 610.64

4、交易费用 0.06

5、利息支出 -

其中：卖出回购金融资产支出 -

6、其他费用 1,966.11

三、利润总额 17,179.34

5、基金财产分配

本基金自 2018 年 1 月 9 日起进入清算程序，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 清算费用

自 2017 年 12 月 12 日至 2018 年 1 月 25 日止清算期间，未发生相关清算费用。

5.2 资产处置情况

(1)本基金最后运作日应收银行存款利息人民币 1,229.31 元、应收清算备付金利息人民币 958.28 元、应收存出保证金利息人民币 0.57 元，共计人民币 2,188.16 元。

(2)本基金最后运作日清算备付金人民币 896,190.48 元、存出保证金人民币 644.61 元，共计人民币 896,835.09 元。

(3)本基金最后运作日变现产生的证券清算款人民币 4,063,472.26 元于 2018 年 1 月 9 日划入托管账户。

5.3 负债清偿情况

(1)本基金最后运作日应付赎回款人民币 24,217,651.30 元，该款项已于 2018 年 1 月 9 日支付。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 3,059.62 元，该款项将于 2018 年 1 月 25 日后支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费人民币 611.92 元，该款项将于 2018 年 1 月 25 日后支付。

(4)本基金最后运作日应付销售服务费人民币 610.64 元，该款项将于 2018 年 1 月 25 日后支付。

(5)本基金最后运作日其他负债人民币 85,553.32 元，其中其他应付款人民币 465.56 元为预估清盘后需支付

的银行汇划手续费，该款项将于 2018 年 1 月 25 日后支付；应付预提审计费人民币 21,619.70 元，该款项将于 2018 年 1 月 25 日后支付；本基金最后运作日应付预提信息披露费人民币 63,468.06 元，该款项将于 2018 年 1 月 25 日后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目 自 2018 年 1 月 9 日至 2017 年 1 月 25 日止清算期间

一、清算收益

- 1、利息收入-银行存款利息收入 3.87
 - 2、利息收入-清算备付金利息收入 685.61
 - 3、利息收入-证券结算保证金利息收入 0.51
- 清算收入小计 689.99

二、清算费用

清算费用小计 0.00

三、清算净收益 689.99

注 1：利息收入计提的自 2018 年 1 月 9 日至 2018 年 1 月 25 日止清算期间的银行存款利息、清算备付金利息及存出保证金利息

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2018 年 1 月 8 日基金净资产 796,034.73

加：清算期间净收益 689.99

二、2018 年 1 月 25 日基金净资产 796,724.72

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 1 月 25 日本基金剩余财产为人民币 796,724.72 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 2018 年 1 月 9 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属于基金份额持有人所有。

5.6 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、备查文件目录

6.1 备查文件目录

- (1) 信诚惠选债券型证券投资基金财务报表及审计报告
- (2) 《信诚惠选债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地--中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

信诚惠选债券型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇一八年六月九日