

信诚新双盈分级债券型证券投资基金清算报告

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。

中信保诚基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依据中国证监会证监许可[2013]239 号文核准的信诚新双盈分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同于 2013 年 5 月 9 日生效。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”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

鉴于市场环境的变化，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《信诚新双盈分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）有关规定，本基金管理人决定召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于终止信诚新双盈分级债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告详见 2020 年 6 月 16 日刊登在《上海证券报》、基金管理人网站（<http://www.citicprufunds.com.cn/>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《中信保诚基金管理有限公司关于信诚新双盈分级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》。

告》。本基金管理人按照《信诚新双盈分级债券型证券投资基金基金合同》的约定，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2020年6月22日，并于2020年6月23日进入清算期。

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2020年6月23日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所(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	信诚新双盈分级债券型证券投资基金	
基金简称	信诚新双盈分级债券	
基金主代码	000091	
下属分级基金的基金简称	信诚新双盈分级债券 A	信诚新双盈分级债券 B
下属分级基金的交易代码	000092	000093
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年05月09日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,通过主动管理,力争追求超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略概述	本基金投资组合中债券类、货币类等大类资产各自的长期均衡比重,依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金,其资产配置以债券为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以

	及市场情绪,在一定的范围内对资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的中偏低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。其中,基于本基金的分级机制和收益规则,新双盈 A 为低风险、收益相对稳定的基金份额,新双盈 B 为中偏高风险、中偏高收益的基金份额。

3、基金运作情况概述

信诚新双盈分级债券型证券投资基金的募集申请经中国证监会 2013 年 3 月 12 日证监许可[2013]239 号文核准,募集期间为信诚新双盈分级债券 B 份额自 2013 年 4 月 22 日至 2013 年 5 月 2 日止、信诚新双盈分级债券 A 份额自 2013 年 5 月 3 日至 2013 年 5 月 6 日止。《信诚新双盈分级债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 9 日正式生效,首次设立募集规模为 3,722,212,226.85 份。

鉴于市场环境的变化,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《信诚新双盈分级债券型证券投资基金基金合同》,本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议并表决通过了《关于终止信诚新双盈分级债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金的最后运作日定为 2020 年 6 月 22 日,并于 2020 年 6 月 23 日进入清算期。

4、财务会计报告

4.1 资产负债表（已经审计）

单位：人民币元

资产	2020 年 6 月 22 日 最后运作日
资产：	
银行存款	8,390,949.69
结算备付金	100,789.72
存出保证金	2,012.29
交易性金融资产	0.00
其中：股票投资	0.00

基金投资	0.00
债券投资	0.00
资产支持证券投资	0.00
衍生金融资产	0.00
买入返售金融资产	0.00
应收证券清算款	0.00
应收利息	498.15
应收股利	0.00
应收申购款	0.00
其他资产	0.00
资产总计	8,494,249.85
负债：	
短期借款	0.00
交易性金融负债	0.00
衍生金融负债	0.00
卖出回购金融资产款	0.00
应付证券清算款	0.00
应付赎回款	959,214.94
应付管理人报酬	8,060.91
应付托管费	2,303.12
应付销售服务费	3,321.01
应付交易费用	200.00
应交税费	291,761.84
应付利息	0.00
应付利润	0.00
其他负债	106,539.62
负债合计	1,371,401.44
所有者权益：	
实收基金	5,349,818.65
未分配利润	1,773,029.76
所有者权益合计	7,122,848.41
负债和所有者权益总计	8,494,249.85

4.2 利润表（已经审计）

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 22日
一、收入	610,743.37
1. 利息收入	212,559.22
其中：存款利息收入	7,196.65
债券利息收入	204,981.34
资产支持证券利息收入	0.00

买入返售金融资产收入	381.23
2. 投资收益（损失以“-”填列）	503,281.40
其中：股票投资收益	0.00
基金投资收益	0.00
债券投资收益	503,281.40
资产支持证券投资收益	0.00
衍生工具收益	0.00
股利收益	0.00
个股期权收益	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-105,097.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.00
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	0.00
二、费用	124,627.88
1、管理人报酬	47,137.67
2、托管费	13,467.88
3、销售服务费	17,626.62
4、交易费用	784.88
5、利息支出	8,887.69
其中：卖出回购金融资产支出	8,887.69
6、其他费用	36,723.14
三、利润总额	486,115.49

5、基金财产分配

本基金自 2020 年 6 月 23 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

本基金自 2020 年 6 月 23 日至 2020 年 6 月 30 日止清算期间未产生清算费用。

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 172.24 元、应收清算备付金利息人民币 211.10 元、应收存出保证金利息人民币 4.81 元，应收申购款利息 110.00 元，共计人民币 498.15 元。

(2) 本基金最后运作日清算备付金人民币 100,789.72 元、存出保证金人民币 2,012.29 元，共计人民币 102,802.01 元。

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 959,214.94 元，该款项已于 2020

年6月23日及2020年6月24日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬人民币8,060.91元,该款项将于2020年6月30日后支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费人民币2,303.12元,该款项将于2020年6月30日后支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费人民币3,321.01元,该款项将于2020年6月30日后支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费人民币200.00元,该款项将于2020年6月30日后支付。

(6) 本基金最后运作日应付税金人民币291,761.84元,为历史债券利息税,该款项将于2020年6月30日后从基金资产支付给公司,由公司作为个人所得税合并申报浦东税局。

(7) 本基金最后运作日其他负债人民币106,539.62元,为预提银行划款手续费人民币600.00元及预提费用人民币105,939.62元。预提银行划款手续费人民币600.00元用于支付基金清算相关划款手续费,最终以银行实际扣款金额为准。预提费用包括审计费人民币16,639.62元、信息披露费人民币80,000.00元、中债上清账户维护费及查询费人民币9,300.00元,以上款项均将于2020年6月30日后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

项目	单位:人民币元	
	自2020年06月23日至 2020年06月30日止清算 期间	
一、清算收益		
1、利息收入-银行存款利息收入(注1)		1,252.02
清算收入小计		<u>1,252.02</u>
二、清算费用		
1、交易费用		-
2、税金及附加		-
清算费用小计		<u>-</u>
三、清算净收益		<u><u>1,252.02</u></u>

注 1：利息收入计提的自 2020 年 06 月 23 日至 2020 年 06 月 30 日止清算期间的银行存款利息、结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 2020 年 6 月 22 日基金净资产	7,122,848.41
加：清算期间净收益	1,252.02
收到的应收申购款	
减：支付应付赎回款	369,300.76
二、2020 年 6 月 30 日基金净资产	6,754,799.67

由于最后运作日 2020 年 06 月 22 日当日仍有投资者赎回，2020 年 06 月 23 日赎回确认后产生了应付赎回款人民币 369,300.76 元。应付赎回款已于 2020 年 06 月 29 日支付完毕。

资产处置及负债清偿后，于 2020 年 06 月 30 日本基金剩余财产为人民币 6,754,799.67 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，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对基金财产清算后本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

清算起始日 2020 年 06 月 23 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) 信诚新双盈分级债券型证券投资基金财务报表及审计报告
- (2) 上海市通力律师事务所关于信诚新双盈分级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免费查阅备查文件。

信诚新双盈分级债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2020年7月17日