

# 圆信永丰中高等级债券型证券投资基金

## 清算报告

基金管理人：圆信永丰基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

清算报告出具日：2020年8月4日

清算报告公告日：2020年11月5日

## 一、重要提示

圆信永丰中高等级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由圆信永丰基金管理有限公司担任基金管理人，由江苏银行股份有限公司担任基金托管人，本基金根据中国证监会证监许可[2018]623号文核准募集，基金合同于2018年8月3日生效。

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》、《圆信永丰中高等级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，其中《基金合同》第五部分“基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行财产清算并终止，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。”截至2020年6月19日，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形，已触发《基金合同》中约定的《基金合同》终止条款。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，不需召开基金份额持有人大会，本基金管理人决定本基金最后运作日为2020年6月19日，并于2020年6月20日进入清算程序。

本基金，由基金管理人圆信永丰基金管理有限公司、基金托管人江苏银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所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）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

### 1、基金基本情况

基金全称	圆信永丰中高等级债券型证券投资基金
基金简称	圆信永丰中高等级
基金交易代码	005922

基金运作方式	契约型开放式
《基金合同》生效日	2018年8月3日
基金管理人名称	圆信永丰基金管理有限公司
基金托管人名称	江苏银行股份有限公司

## 2、基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济运行状况和金融市场运行趋势等因素，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）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，属于中低风险/收益的证券投资基金。

## 三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2018]623号文准予注册，于2018年7月20日至2018年7月30日向社会公开发行人募集，《基金合同》于2018年8月3日正式生效，首次设立募集规模为210,120,805.24份基金份额。自《基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

根据《基金合同》约定，本基金《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据《基金合同》第十九部分的约定进行财产清算并终止，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。

截至2020年6月19日，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，且本基金管理人已与基金托管人协商一致，决定终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现终止事由后依法履行基金财产清算程序。

本基金管理人与基金托管人协商一致确定 2020 年 6 月 19 日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即 2020 年 6 月 20 日）起本基金进入基金财产清算程序。

#### 四、财务会计报告

##### 资产负债表（经审计）

会计主体：圆信永丰中高等级债券型证券投资基金

最后运作日：2020 年 6 月 19 日

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 19 日 (基金最后运作日)	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	5	8,226.66	23,551.14
结算备付金		91,544.04	952,553.06
存出保证金		57,235.67	125,106.89
交易性金融资产	6	611,447.40	41,741,429.00
其中：债券投资		611,447.40	41,741,429.00
应收证券清算款		53,276.36	11,300,000.00
应收利息	7	13,546.21	749,488.28
<b>资产总计</b>		<b>835,276.34</b>	<b>54,892,128.37</b>
<b>负债和所有者权益</b>			
<b>负债：</b>			
卖出回购金融资产款		100,000.00	13,300,000.00
应付赎回款		99,991.29	210.00
应付管理人报酬	19(b)	106.90	12,981.68
应付托管费	19(c)	35.64	4,327.24
应付交易费用	8	50.00	1,750.00
应付利息		5.48	163.01
其他负债	9	52,000.00	180,000.00
<b>负债合计</b>		<b>252,189.31</b>	<b>13,499,431.93</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	10	543,391.93	39,162,800.93
未分配利润	11	39,695.10	2,229,895.51
<b>所有者权益合计</b>		<b>583,087.03</b>	<b>41,392,696.44</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>835,276.34</b>	<b>54,892,128.37</b>

注：1. 报告截止日 2020 年 6 月 19 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0731 元，基金份额总额 543,391.93 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 19 日(基金最后运作日)止期间。

## 五、清算报表编制基础

本基金自 2020 年 6 月 20 日起进入清算程序，因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2020 年 6 月 19 日(基金最后运作日)，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

此外，本基金财务报表按照中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 六、清算情况

自 2020 年 6 月 20 日至 2020 年 8 月 4 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：

### 1、清算费用

按照《基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金、存出保证金为人民币148,779.71元。2020年7月2日，备付金保证金调整金额为107,704.34元；2020年8月4日，备付金保证金调整金额为20,173.09元；剩余款项20,902.28元预计2020年9月2日调整完成。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币共计13,546.21元。其中卖出债券冲减应收债券利息6,157.09元，于2020年6月24日完成交收划回托管账户。活期存款及备付金、保证金利息7403.36元，于2020年6月21日结息日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币共计53,276.36元。于2020年6月22日划入托管账户。

(4) 截至2020年7月28日,本基金于基金最后运作日持有的交易性金融资产已全部卖出,清算金额为人民币616,955.78元(含应收利息)。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币基金净赎回款项为99,991.29元,该款项于2020年6月23日全部完成支付。

(2) 本基金最后运作日持有的卖出回购金融资产款为100,000.00元,该部分利息支出共计21.92元由基金份额持有人承担(包含最后运作日账面利息5.48元),已在2020年6月23日清算完成。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币35.64元,该款项于2020年7月2日完成支付。

(4) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币106.90元,该款项于2020年7月2日完成支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币50.00元,该款项于2020年7月15日完成支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币52,000.00元,已于2020年7月29日全部完成支付。

### 4、清算期间的损益情况

自2020年6月20日至自2020年8月4日止清算期间

项目	金额(单位:人民币元)
一、清算收益	

存款利息收入 (注 1)	567.27
债券利息收入	243.79
债券投资收益 (损失以“-”填列)	-2389.81
公允价值变动损益 (损失以“-”填列)	1497.31
其他收入 (损失以“-”填列)	374.39
清算收入小计	292.95
二、清算费用	
卖出回购利息支出	16.44
交易费用	0.63
三、清算净收益	275.88

注:上表所有的收入金额数据为包含了 2020 年 6 月 20 日至 2020 年 8 月 4 日的数据。

1: 利息收入系计提的自 2020 年 6 月 20 日至 2020 年 8 月 4 日止清算期间的银行存款利息收入、清算备付金利息收入和存出保证金利息收入。

#### 5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额 (单位:人民币元)
一、最后运作日 2020 年 6 月 19 日基金净资产	583,087.03
加:清算期间净收益	275.88
减:清算期间赎回导致的净值变动 (注)	50,025.53
二、2020 年 8 月 4 日基金净资产	533,337.38

注: 2020 年 6 月 24 日支付扣除基金赎回费后的基金净赎回款项 49,651.14 元。

资产处置及负债清偿后, 2020 年 8 月 4 日本基金剩余财产为人民币 533,337.38 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 2020 年 6 月 20 日至 2020 年 8 月 4 日报告期前一日银行存款产生的利息亦属份额持有人所有，截至 2020 年 8 月 4 日止的应收利息共计人民币 553.03 元（以当前适用的利率预估），将由基金管理人以自有资金垫付，于清算款划出日前划入托管账户。实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。清算期结束后至清算款划出前一日银行存款产生的利息属份额持有人所有，在支付清算款时将一并计算并支付给份额持有人。

截至 2020 年 8 月 4 日止仍有交易所最低备付金及最低保证金共 20,902.28 元尚未归还，为提高清算效率，将由基金管理人以自有资金垫付，于清算款划出日前划入托管账户。实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

## 6、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

## 七、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- (1)《圆信永丰中高等级债券型证券投资基金清算审计报告》；
- (2)《圆信永丰中高等级债券型证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 2、存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.gtsfund.com.cn](http://www.gtsfund.com.cn)）查阅。

### 3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及基金托管人住所，供公众查阅、复制。

圆信永丰中高等级债券型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二〇年八月四日