

中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日期：2022年6月23日

报告公告日期：2022年6月24日

一、重要提示

中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会《关于准予中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]1077号文）准予募集，于2019年11月27日成立并正式运作，基金合同生效日的基金份额总额为229,510,021.37份，包含认购资金利息结转的份额76,146.66份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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》、《中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的有关规定，基金管理人经与基金托管人协商一致，由基金管理人召集，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于2022年4月21日表决通过了《关于终止中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金基金合同相关事项的议案》，决定终止本基金基金合同。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见基金管理人于2022年4月23日发布的《中欧基金管理有限公司关于中欧滚利一年滚动持有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公告》。

本基金从2022年5月18日起进入清算期，由本基金管理人中欧基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师和上海市通力律师事务所律师组成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、基金名称：中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金。基金简称：中欧滚利一年滚动持有债券。A 类份额基金代码：007622；C 类份额基金代码：007623。

2、基金运作方式：契约型、开放式。对于每份基金份额，设定一年的滚动运作期。运作期内该基金份额封闭运作。运作期到期当月的开放期内可办理该基金份额的赎回业务。如果该基金份额在运作期到期当月的开放期内未申请赎回，则自该开放期结束之日次日起该基金份额进入下一个运作期。

3、基金合同生效日：2019 年 11 月 27 日

4、基金运作终止日：2022 年 5 月 17 日。基金份额总额 6,678,610.94 份。

5、投资目标：在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。

6、业绩比较基准：中债综合指数收益率

7、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，属于较低风险/收益的产品。

8、基金管理人：中欧基金管理有限公司

9、基金托管人：招商银行股份有限公司

三、基金最后运作日财务会计报告（经审计）

1、资产负债表

会计主体：中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 5 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2022 年 5 月 17 日 (基金最后运作日)
资产：	

银行存款	13,759,966.28
结算备付金	
存出保证金	13,091.95
交易性金融资产	
其中：债券投资	
资产支持证券投资	
应收证券清算款	
应收利息	
应收申购款	
资产总计	13,773,058.23
负债：	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	
应付赎回款	6,453,751.25
应付管理人报酬	4,336.49
应付托管费	1,084.11
应付销售服务费	595.56
应付交易费用	1,125.00
应交税费	
应付利息	
其他负债	55,165.00
负债合计	6,516,057.41
所有者权益：	
实收基金	6,678,610.94
未分配利润	578,389.88
所有者权益合计	7,257,000.82
负债和所有者权益总计	13,773,058.23

四、清盘事项说明

1、清算原因

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》、《基金合同》的有关规定，基金管理人经与基金托管人协商一致，由基金管理人召集，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于 2022 年 4 月 21 日表决通过了《关于终止中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金基金合同相关事项的议案》，决定终止本基金基金合同，并依法履行基金财产清算程序。

2、清算起始日

本基金于 2022 年 5 月 18 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2022 年 5 月 18 日。

3、清算报表编制基础

本清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。

五、清算情况

自 2022 年 5 月 18 日至 2022 年 6 月 6 日清算期间，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

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，根据《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产清算情况

本基金最后运作日存出保证金为人民币13,091.95元，其中含普通保证金人民币13,060.19元，应计保证金利息人民币31.76元；清算期间存出保证金利息收入为人民币8.85元，其中普通保证金人民币13,060.19元已于2022年6月2日划入托管账户，剩余人民币40.61元将于清算期间后划入托管账户。

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6,453,751.25元，该款项已于2022年5月18日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币4,336.49元，该款项已于2022年6月2日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,084.11元，该款项已于2022年6月2日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币595.56元，该款项已于2022年6月2日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币1,125.00元，该款项已于2022年6月1日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 55,165.00 元，其中人民币 165.00 元为未支付汇划费，已于清算期后 2022 年 6 月 8 日支付；人民币 55,000.00 元为预提审计费，已于 2022 年 5 月 26 日支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2022 年 5 月 18 日 至 2022 年 6 月 6 日 止清算期间
一、清算收益	
利息收入	1,380.94
清算收入小计	1,380.94
二、清算费用	179.08
清算费用小计	179.08
三、清算净收益	1,201.86

5、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 2022 年 5 月 17 日基金净资产	7,257,000.82
加：自 2022 年 5 月 18 日至 2022 年 6 月 6 日 止清算期间净收益	1,201.86
减：清算期间确认的净赎回、转出款	226,693.90
二、2022 年 6 月 6 日基金净资产	7,031,508.78

资产处置及负债清偿后，于 2022 年 6 月 6 日剩余财产为人民币 7,031,508.78 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 2022 年 5 月 18 日至清算款划出日前一日的银行存款利息、存出保证金利息和结算备付金利息均属基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。

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。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《中欧滚利一年滚动持有债券型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《中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

本基金管理人中欧基金管理有限公司办公地点——中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8 层。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

中欧滚利一年滚动持有债券型证券投资基金基金财产清算小组

2022 年 6 月 24 日