

# 信诚年年有余定期开放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依据中国证监会证监许可[2013]874 号文注册的信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同于 2013 年 11 月 27 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》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《信诚年年有余定期开放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《关于终止信诚年年有余定期开放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 10 月 21 日刊登在《证券时报》、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年年有余定期开放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《信诚年年有余定期开放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。本基金的运作终止日定为 2020 年 10 月 27 日，并于 2020 年 10 月 28 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)和通力律师事务所于 2020 年 10 月 28 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)对本基金进行清算审计、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	信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金
基金简称	信诚年年有余定期开放债券
基金主代码	000360
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 27 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,力争实现基金资产长期增值并为投资人实现稳定的定期回报。
投资策略概述	<p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、固定收益类资产的投资策略</p> <p>(1)类属资产配置策略</p>

	<p>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。</p> <p>(2) 普通债券投资策略</p> <p>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、流动性管理、相对价值配置、杠杆策略等策略进行主动投资。</p> <p>(3) 资产支持证券的投资策略</p> <p>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债券的价格走势,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。</p> <p>3、其他金融工具的投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、开放期投资策略</p> <p>开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率(税后)+2%
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较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

### 3、基金运作情况概述

信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可【2013】874号文批准,于2013年10月21日起通过各销售机构向社会公开募集,截至2013年11月22日,基金募集工作已顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资,本次募集的净认购金额为260,480,588.31元人民币,其中A类(基金代码:000360)149,020,482.31元,B类(基金代码:000361)111,460,106.00元;认购款项在基金验资确认日

之前产生的银行利息共计 72,816.93 人民币，其中 A 类 39,194.49 元，B 类 33,622.44 元。上述资金已于 2013 年 11 月 26 日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为 1,296 户。按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，募集发售期募集的有效份额为 260,480,588.31 份基金份额，其中 A 类 149,020,482.31 份，B 类 111,460,106.00 份。利息结转的基金份额为 72,816.93 份基金份额，其中 A 类 39,194.49 份，B 类 33,622.44 份。两项合计共 260,553,405.24 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

本基金的基金合同已于 2013 年 11 月 27 日正式生效。

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《信诚年年有余定期开放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《关于终止信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金的运作终止日定为 2020 年 10 月 27 日，并于 2020 年 10 月 28 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：元

资产	2020 年 10 月 27 日 运作终止日
资产：	
银行存款	5,238,456.69
结算备付金	36,818.37
存出保证金	12.84
交易性金融资产	35,264.32
其中：股票投资	0.00
基金投资	0.00
债券投资	35,264.32
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	4,147.22
应收股利	0.00
应收申购款	0.00
其他资产	0.00
资产总计	5,314,699.44
负债与持有人权益	
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	1,074,792.00
应付管理人报酬	5,444.25
应付托管费	1,555.49
应付销售服务费	174.11
应付交易费用	162.50
应交税费	9.07
应付利息	0.00
应付利润	0.00
其他负债	14,155.45
负债合计	1,096,292.87
所有者权益：	
实收基金	3,383,085.25
未分配利润	835,321.32
所有者权益合计	4,218,406.57
负债和所有者权益总计	5,314,699.44

#### 4.2 利润表（已经审计）

单位：元

项目	本期 2020年1月1日至 2020年10月27日
一、收入	355,246.70
1. 利息收入	273,794.64
其中：存款利息收入	1,933.35
债券利息收入	250,440.11
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售金融资产收入	21,421.18
2. 投资收益（损失以“-”填列）	225,167.74
其中：股票投资收益	0.00

基金投资收益	0.00
债券投资收益	225,167.74
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）	-145,216.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.00
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,501.30
二、费用	114,715.51
1、管理人报酬	64,955.17
2、托管费	18,558.64
3、销售服务费	2,292.90
4、交易费用	581.81
5、利息支出	4,785.94
其中：卖出回购金融资产支出	4,785.94
6、税金及附加	12.39
7、其他费用	23,528.66
三、利润总额	240,531.19

## 5、基金财产分配

本基金自 2020 年 10 月 28 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 10 月 28 日至 2020 年 10 月 30 日止清算期间未产生清算费用。

### 5.2 资产处置情况

(1) 截止 2020 年 10 月 27 日，本基金仍有系因停牌而未能变现的流通受限债券，明细如下：

债券代码	债券名称	到期日期	停牌原因	期末估值单价	数量（张）	期末成本总额	期末估值总额
112294	15 海伟 02	2020 年 11 月 18 日	公司存在重大事项	48.44	728	74,098.77	35,264.32

为了保护基金份额持有人利益，加快清算进程，基金管理人将以自有资金先行垫付。

(2) 本基金最后运作日应收银行存款利息人民币 563.63 元、应收清算备付金利息人民币 70.47 元、应收存出保证金利息人民币 0.21 元，应收债券利息 3,512.91 元，共计人民币 4,147.22 元。

(3) 本基金最后运作日清算备付金人民币 36,818.37 元、存出保证金人民币 12.84 元，共计人民币 36,831.21 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 1,074,792.00 元，该款项已于 2020 年 10 月 28 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 5,444.25 元，该款项已于 2020 年 10 月 28 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费人民币 1,555.49 元，该款项已于 2020 年 10 月 28 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费人民币 174.11 元，该款项已于 2020 年 10 月 28 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费人民币 162.50 元，该款项将于 2020 年 10 月 30 日后支付。

(6) 本基金最后运作日应付税金人民币 9.07 元，该款项已于 2020 年 10 月 28 日支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债人民币 14,155.45 元，为预提银行划款手续费人民币 400.00 元、审计费人民币 10,655.45 元和中债上清账户维护费及查询费人民币 3100.00 元。预提银行划款手续费人民币 400.00 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。审计费人民币 10,655.45 元，该款项将于 2020 年 10 月 30 日后支付。中债上清账户维护费及查询费人民币 3,100.00 元，该款项已于 2020 年 10 月 28 日支付。

### 5.4 清算期间的清算损益情况

项目	单位：人民币元
	自 2020 年 10 月 28 日至 2020 年 10 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）	136.72
清算收入小计	136.72
二、清算费用	
1、交易费用	0
2、税金及附加	0
清算费用小计	0
三、清算净收益	136.72

注1：利息收入计提的自2020年10月28日至2020年10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10月27日基金净资产	4,218,406.57
加：清算期间净收益	136.72
收到的应收申购款	
减：支付应付赎回款	72,089.31
二、2020年10月30日基金净资产	4,146,453.98

由于最后运作日2020年10月27日当日仍有投资者赎回，2020年10月28日赎回确认后产生了应付赎回款人民币72,089.31元。应付赎回款已于2020年10月29日支付完毕。

资产处置及负债清偿后，于2020年10月30日本基金剩余财产为人民币4,146,453.98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10月28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) 信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金财务报表及审计报告
- (2) 通力律师事务所关于信诚年年有余定期开放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。

信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金  
基金财产清算小组  
2020年11月13日