

中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金

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《中华人民共和国民法典》第五百三十二条的规定，合同当事人名称变更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（以下或简称“基金管理人”）管理的中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金由信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金变更而成。信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金由中国证监会证监许可[2016]3001 号文准予注册，《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日生效。2021 年 4 月 6 日，信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决通过了《关于信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金变更注册有关事项的议案》，并同意将“信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金”更名为“中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金”（以下或简称“本基金”），上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2021 年 4 月 14 日起，《中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》（以下或简称“《基金合同》”）生效，《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司（以下或简称“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》的有关规定和《中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金管理人以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于终止中信保诚永益一年定期开放混合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 2021 年 6 月 1 日刊登在《中国证券报》、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中信保诚永益一年定期开放混合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》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。本基金的基金最后运作日定为 2021 年 6 月 7 日，并于 2021 年 6 月 8 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 2021 年 6 月 8 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、上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金
基金简称	信诚永益
基金主代码	004171
基金运作方式	契约型、定期开放式。本基金以定期开放方式运作，即本基金以封闭期和开放期相结合的方式运作。
基金合同生效日	2021 年 4 月 14 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

注：中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金由信诚永益一年定期开放混合型证券投资

资基金变更而成。《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日生效。

2.2 基金产品说明

<p>投资目标</p>	<p>在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争获得超越业绩比较基准的回报。</p>
<p>投资策略概述</p>	<p>1、资产配置策略 本基金主要通过通过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，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。</p> <p>2、股票投资策略 在灵活的类别资产配置的基础上，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。</p> <p>3、债券投资策略 本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。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、回购放大策略等策略进行主动投资。</p> <p>4、信用债投资策略 本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势。本基金根据债券发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、债券收益率、流动性等因素，评估其投资价值，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。</p> <p>本基金投资于主体评级 AA 级（含 AA 级）以上的信用债。其中，本基金投资于信用评级 AA 的信用债占基金总资产的比例不超过 20%；投资于信用评级 AA+ 的信用债占基金总资产的比例不超过 70%；投资于信用评级 AAA 的信用债占基金总资产的比例不低于 30%。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级（具体评级机构名单以基金管理人确认为准）。如出现同一时间多家评级机构所出具信用评级不同的情况或没有对应评级的信用债券，基金管理人需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定，以基金管理人的判断结果为准。受此评级和投资比例安排限制的信用债包括：金融债（不含政策性金融债）、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、次级债、证券公司短期公司债券、可转换债券、可交换债券等非国</p>

	<p>家信用的债券。因资信评级机构调整评级等基金管理人之外的因素致使本基金投资信用债比例不符合上述约定投资比例的，基金管理人应当在该信用债可交易之日起 3 个月内进行调整，中国证监会规定的特殊情形除外。如果由于市场流动性等原因导致难以调整的，管理人应在维护持有人利益的基础上对相关债券进行处置安排。</p> <p>5、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>7、股指期货投资策略</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>8、国债期货投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现委托财产的长期稳定增值。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×15%+中债综合财富（总值）指数收益率*85%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

3、基金运作情况概述

信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2016]3001号文批准，自2016年12月26日至2017年1月23日止通过各销售机构向社会公开募集。

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3,000,043,610.87元人民币，其中A类（基金代码：004171）2,999,999,199.88元人民币，C类（基金代码：004172）44,410.99元人民币；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计9.94元人民币，其中A类0.04元人民币，C类9.90元人民币。上述资金已于2017年1月25日全额划入本基金在基金托管人中信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385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认购份额为3,000,043,610.87份基金份额，其中A类2,999,999,199.88份，C类44,410.99份。利息结转的基金份额为9.94份基金份额，其中A类0.04份，C类9.90份。两项合计共3,000,043,620.81份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年1月25日生效。

2021年4月6日，信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决通过了《关于信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金变更注册有关事项的议案》，并同意将“信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金”更名为“中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自2021年4月14日起，《中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》生效，《信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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》的有关规定和《中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的约定，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《关于终止中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金的基金最后运

作日定为 2021 年 6 月 7 日，并于 2021 年 6 月 8 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	2021 年 6 月 7 日 最后运作日
资产：	
银行存款	1,292,985.93
结算备付金	1,566,666.67
存出保证金	134,236.30
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	-
应收利息	309,186.38
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
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	-
应付管理人报酬	11,575.23
应付托管费	1,929.19
应付销售服务费	1.76
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	267,016.89
负债合计	280,523.07
所有者权益：	
实收基金	3,018,077.87

未分配利润	4,474.34
所有者权益合计	3,022,552.21
负债和所有者权益总计	3,303,075.28

4.2 利润表（已经审计）

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年6月7日
一、收入	19,973,788.37
1.利息收入	22,866,609.98
其中：存款利息收入	589,351.25
债券利息收入	17,570,096.59
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售金融资产收入	4,707,162.14
2.投资收益（损失以“-”填列）	6,317,644.48
其中：股票投资收益	0.00
基金投资收益	0.00
债券投资收益	6,317,644.48
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）	-9,210,466.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.00
5.其他收入（损失以“-”号填列）	0.76
二、费用	6,110,535.42
1、管理人报酬	4,967,599.86
2、托管费	827,933.25
3、销售服务费	44.77
4、交易费用	31,493.92
5、利息支出	77,615.32
其中：卖出回购金融资产支出	77,615.32
6、税金及附加	5,980.44
7、其他费用	199,867.86
三、利润总额	13,863,252.95

5、基金财产分配

本基金自2021年6月8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 2021 年 6 月 8 日至 2021 年 6 月 15 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 166,656.80 元、应收清算备付金利息人民币 141,900.69 元、应收存出保证金利息人民币 628.89 元共计人民币 309,186.38 元。

(2) 本基金最后运作日清算备付金人民币 1,566,666.67 元、存出保证金人民币 134,236.30 元，共计人民币 1,700,902.97 元。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 11,575.23 元，该款项将于 2021 年 6 月 15 日后支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费人民币 1,929.19 元，该款项将于 2021 年 6 月 15 日后支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费人民币 1.76 元，该款项将于 2021 年 6 月 15 日后支付。

(4) 本基金最后运作日其他应付款人民币 400.00 元，为预提银行划款手续费，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。

(5) 本基金最后运作日预提费用人民币 266,616.89 元，其中审计费人民币 185,000.00 元；信息披露费人民币 51,616.89 元；律师费人民币 30,000.00 元。均将于 2021 年 6 月 15 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 2021 年 6 月 8 日至 2021 年 6 月 15 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）	819.20
清算收入小计	<u>819.20</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

819.20

注 1：利息收入计提的自 2021 年 6 月 8 日至 2021 年 6 月 15 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 2021 年 6 月 7 日基金净资产	3,022,552.21
加：清算期间净收益	819.20
收到的应收申购款	
减：支付应付赎回款	0.00
二、2021 年 6 月 15 日基金净资产	3,023,371.41

资产处置及负债清偿后，于 2021 年 6 月 15 日本基金剩余财产为人民币 3,023,371.41 元。

根据本基金《基金合同》的约定，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。如于清算划款日的应收利息余额、备付金、保证金余额等由基金管理人以自有资金先行垫付的，垫付资金将于清算期后返还给基金管理人。

清算结束日次日 2021 年 6 月 16 日至最后一次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) 中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金财务报表及审计报告

(2) 上海源泰律师事务所关于中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金清算事宜之法律意见

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。

中信保诚永益一年定期开放混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2021年6月29日