

圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合
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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年8月13日

清算报告公告日：2024年8月31日

一、重要提示

圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合型证券投资基金（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，由中国工商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[2017]1295号文核准募集，基金合同于2017年12月13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》、《圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合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：“在任一开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止：

（1）基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于5000万元。

（2）基金份额持有人人数少于200人。

法律法规另有规定时，从其规定。”

截至2024年3月15日（本基金最近一个开放期的最后一日）日终，本基金基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于5000万元，已触发《基金合同》中约定的基金终止条款。本基金根据《基金合同》约定进入清算程序并终止，且无需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2024年3月15日，自2024年3月16日起进入清算程序。

本基金由基金管理人圆信永丰基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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	圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	圆信永丰双利优选
基金交易代码	005108
基金运作方式	契约型、定期开放式
《基金合同》生效日	2017年12月13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	中国工商银行股份有限公司

2、基金产品说明

投资目标	本基金在精选个股和严格控制组合风险的基础上，通过积极主动的资产配置，力争获取超越业绩比较基准的中长期稳定收益。
投资策略	本基金遵循“自上而下”的资产配置思路：首先是大类资产配置，基金管理人采取积极主动的资产配置策略，根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例；其次是行业配置和个股配置，即根据经济发展的内在逻辑，主要关注政府深化改革、经济转型、经济体制不断完善所带来的产业投资机会。本基金的投资策略包括资产配置策略、股票配置策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略、开放期投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。

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[2017]1295号文准予注册，由基金管理人圆信永丰基金管理有限公司于2017年11月10日至2017年12月8日向社会公开发行募集，《基金合同》于2017年12月13日正式生效，首次设立

募集规模为 798,394,109.59 份基金份额。

根据《基金合同》以及圆信永丰基金管理有限公司于2024年3月16日发布的《关于圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，截至2024年3月15日（本基金最近一个开放期的最后一日）日终，本基金基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额已低于5000万元，本基金根据基金合同约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金的最后运作日为2024年3月15日，最后运作日的下一日起基金进入清算程序，停止办理申购、赎回、转换转入和转换转出等业务，并且之后不再恢复。自2024年3月16日起，本基金进入清算程序，停止收取基金管理费、基金托管费、销售服务费。

四、财务会计报告（经审计）

基金最后运作日资产负债表

会计主体：圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年3月15日（基金最后运作日）

金额（单位：人民币元）

资产	本期末 2024年3月15日（基金最后运作日）
资产：	
货币资金	36,591.02
结算备付金	122,915.34
存出保证金	15,025.86
交易性金融资产	43,293,196.56
其中：股票投资	38,088,799.05
债券投资	5,204,397.51
买入返售金融资产	369,915.41
应收清算款	5,515,998.41
资产总计	49,353,642.60
负债和净资产	
负债：	
卖出回购金融资产款	1,840,000.00
应付赎回款	9,046,847.93
应付管理人报酬	25,616.36

应付托管费	4,269.41
应付销售服务费	21,346.94
应交税费	30.71
其他负债	91,496.67
负债合计	11,029,608.02
净资产：	
实收基金	33,888,009.93
未分配利润	4,436,024.65
净资产合计	38,324,034.58
负债和净资产总计	49,353,642.60

注 1：报告截止日 2024 年 3 月 15 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.1309 元，基金份额总额 33,888,009.93 份。

注 2：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 15 日(基金最后运作日)止期间。

五、清算情况

自 2024 年 3 月 16 日至 2024 年 8 月 13 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为人民币 122,915.34 元（含应计利息），已于清算期间划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 15,025.86 元（含应计利息），已于清算期间划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 43,293,196.56 元（含

应计利息),其中股票投资为38,088,799.05元,已最晚于2024年8月9日全部变现,相关证券清算款已最晚于2024年8月12日划入托管账户;债券投资为5,204,397.51元(含应计利息),已最晚于2024年7月11日全部完成变现,相关证券清算款已于清算期间划入托管账户。

(5)本基金最后运作日持有的买入返售金融资产为人民币369,915.41元(含应计利息),已于清算期间划入托管账户。

(6)本基金最后运作日应收清算款为人民币5,515,998.41元,已于清算期间划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1)本基金最后运作日持有的卖出回购金融资产款为人民币1,840,000.00元,该款项已于2024年3月19日支付。

(2)本基金最后运作日应付赎回款为人民币9,046,847.93元,该款项分别已于2024年3月18日、2024年3月19日支付。

(3)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币25,616.36元,该款项已于2024年4月3日支付。

(4)本基金最后运作日应付托管费为人民币4,269.41元,该款项已于2024年4月3日支付。

(5)本基金最后运作日应付销售服务费为人民币21,346.94元,该款项已于2024年4月3日支付。

(6)本基金最后运作日应交税费为30.71元,该款项已于2024年4月8日支付。

(7)本基金最后运作日其他负债为人民币91,496.67元,其中:

应付交易费用为人民币31,250.92元,该款项已于2024年4月18日支付;

预提审计费为人民币60,245.75元，其中50,000.00元为2023年审计费，该款项已于2024年4月25日支付；10,245.75元为清盘审计费，该款项已于2024年8月12日支付。

4、清算期间的损益情况

单位：人民币元

项目	自2024年3月16日至2024年8月13日止 清算期间
一、清算期间收益	
利息收入（注1）	8,417.78
投资收益（损失以“-”填列）（注2）	-20,501,434.89
公允价值变动收益（损失以“-”填列）（注3）	16,002,256.96
清算收入小计	-4,490,760.15
二、清算期间费用	
利息支出（注4）	97.55
其他费用（注5）	635.12
税金及附加	11.86
清算费用小计	744.53
三、清算期间净收益	-4,491,504.68

注1：利息收入系清算期间计提的银行存款利息收入、存出保证金利息收入、结算备付金利息收入以及买入返售金融资产利息收入。

注2：投资收益系清算期间持有的交易性金融资产产生的股利收入、处置交易性金融资产成交金额与初始计量金额的差额及处置时产生的交易费用。

注3：公允价值变动收益系清算期间本基金持有的交易性金融资产公允价值变动收益。

注4：利息支出系清算期间持有的卖出回购金融资产产生的利息支出。

注5：其他费用系清算期间所产生的银行汇划费。

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 2024 年 3 月 15 日基金净资产	38,324,034.58
加：清算期间净收益	-4,491,504.68
减：基金净赎回金额（于2024年3月18日确认的投资者赎回）	10,783,264.64
二、2024 年 8 月 13 日基金净资产	23,049,265.26

资产处置及负债清偿后，本基金于2024年8月13日剩余财产为人民币23,049,265.26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2024年3月16日至清算款划出日前一日的存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息亦属基金份额持有人所有，由基金管理人以自有资金垫付。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算结束待结息后返还给基金管理人。除清算划款以及负债清偿产生的银行汇划费从基金资产中支付外，其他与本次清算相关产生的银行汇款费由基金管理人承担。

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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1)《圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合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《圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合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及基金托管人办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，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）查阅。

圆信永丰双利优选定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二四年八月十三日