

信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇一八年八月六日

清算报告公告日期：二〇一八年九月二十七日

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[2015]1136 号文注册的信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金合同于 2015 年 6 月 29 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”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

鉴于市场环境的变化，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《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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《关于终止信诚新鑫回报灵活配置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 2018 年 7 月 31 日刊登在《证券日报》和基金管理人网站上的《中信保诚基金管理有限公司关于信诚新鑫回报灵活配置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《信诚新鑫回报灵活配置混合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。本基金的最后运作日定为 2018 年 7 月 30 日，并于 2018 年 7 月 31 日进入清算期。

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司、基金托管人招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）和通力律师事务所于 2018 年 7 月 31 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	信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	信诚新鑫混合
基金主代码	001494
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年06月29日
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略概述	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金主要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</p> <p>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成长前景、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</p>

	<p>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、固定收益投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、股指期货、权证等投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。</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>本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，构建交易组合。</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>
<p>风险收益特征</p>	<p>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。</p>

3、基金运作情况概述

信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]

1136 号文准予注册，由基金管理人自 2015 年 6 月 23 日至 2015 年 6 月 25 日止向社会公开发行募集，《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 29 日正式生效，募集规模为 1,201,572,430.13 份基金份额。

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《信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》有关规定，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《关于终止信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金的最后运作日为 2018 年 7 月 30 日，自 2018 年 7 月 31 日起进入清算期。

4、财务会计报告

4.1 资产负债表（已经审计）

会计主体：信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 7 月 30 日

金额单位：人民币元

资产	最后运作日 2018 年 7 月 30 日
资产：	
银行存款	819,263.49
结算备付金	6,210.64
存出保证金	525.21
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	16,298.79
应收股利	
应收申购款	
其他资产	184.90
资产总计	842,483.03
负债与所有者权益	最后运作日 2018 年 7 月 30 日

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	2,185.58
应付管理人报酬	13,696.81
应付托管费	4,565.62
应付销售服务费	2,218.05
应付交易费用	
应交税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	68,657.24
负债合计	91,323.30
所有者权益：	
实收基金	482,282.75
未分配利润	268,876.98
所有者权益合计	751,159.73
负债和所有者权益总计	842,483.03

4.2 利润表（已经审计）

会计主体：信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年7月30日

金额单位：人民币元

项目	本期累计
一、收入	1,714,796.72
1、利息收入	1,570,524.33
其中：存款利息收入	105,642.75
债券利息收入	1,323,190.57
资产支持证券利息收入	
买入返售金融资产收入	141,691.01
2、投资收益（损失以“-”填列）	-589,408.15
其中：股票投资收益	8,381.00
债券投资收益	-597,789.15
资产支持证券投资收益	
基金投资收益	
权证投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	

3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	733,601.88
4、其他收入（损失以“-”填列）	78.66
二、费用	505,171.91
1、管理人报酬	280,227.92
2、托管费	93,409.31
3、销售服务费	46,013.55
4、交易费用	1,772.63
5、利息支出	204.79
其中：卖出回购金融资产支出	204.79
6、其他费用	83,543.71
三、利润总额	1,209,624.81

5、基金财产分配

本基金自 2018 年 7 月 31 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

自 2018 年 7 月 31 日至 2018 年 8 月 6 日清算期间，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 16,283.15 元，应收清算备付金利息人民币 14.20 元，应收 TA 申购款利息 0.04 元，应收保证金利息人民币 1.40 元，其他应收款 184.90 元，共计人民币 16,483.69 元。

(2) 其他应收款为应收管理人承担的销售服务费。

(3) 本基金最后运作日结算备付金人民币 6,210.64 元，存出保证金人民币 525.21 元。结算备付金和存出保证金已于 2018 年 8 月 2 日划回托管户。

(4) 本基金于 2018 年 7 月 30 日收到申购申请，并于 2018 年 7 月 31 日确认申购申请，共计 6,404.76 份，确认金额为 9,985.02 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 13,696.81 元，该款项将于 2018 年 8 月 14 日后支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费人民币 4,565.62 元，该款项将于 2018 年 8

月 14 日后支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费人民币 2,218.05 元, 该款项将于 2018 年 8 月 14 日后支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回款 2,185.58 元, 该款项已于 2018 年 7 月 31 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债人民币 68,657.24 元, 其中应付审计费人民币 39,233.22 元, 该款项将于 2018 年 8 月 14 日后支付; 应付信息披露费人民币 29,424.02 元, 该款项将于 2018 年 8 月 14 日后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

项目	自 2018 年 7 月 31 日至 2018 年 8 月 6 日止清算 期间
一、清算收益	
利息收入 (注 1)	116.88
清算收入小计	116.88
二、清算费用	
1. 交易费用	-
2. 银行费用	-
清算费用小计	-
三、清算净收益	116.88

注 1: 利息收入计提的自 2018 年 7 月 31 日至 2018 年 8 月 6 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、应收 TA 申购款利息和存出保证金利息。

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 2018 年 7 月 30 日基金净资产	751,159.73
加: 清算期间净收益	116.88
加: 收到的应收申购款	9,985.02
减: 确认全额赎回金额	-
二、2018 年 8 月 6 日基金净资产	761,261.63

资产处置及负债清偿后, 于 2018 年 8 月 6 日本基金剩余财产为人民币

761,261.63 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 2018 年 7 月 31 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) 信诚新鑫回报灵活配置混合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新鑫回报灵活配置混合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至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

信诚新鑫回报灵活配置混合型证券投资基金
基金财产清算小组
2018 年 9 月 27 日