

信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）

清算报告

1、重要提示

信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）（以下或简称“本基金”）获中国证监会证监许可[2010]1217号文核准，《信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）基金合同》（以下或简称“《基金合同》”）于2010年12月17日生效。

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《基金合同》的约定，本基金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《关于终止信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）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2023年6月1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>）、深圳证券交易所（<http://www.szse.cn/>）上的《中信保诚基金管理有限公司关于信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金基金管理人按照《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2023年6月7日，并于2023年6月8日起进入清算程序。

本基金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、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2023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，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计、上海市通力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	信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）
基金简称	信诚四国配置（QDII-FOF-LOF）
基金主代码	165510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 17 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	通过对“金砖四国”各地区间的积极配置，以及对“金砖四国”相关 ETF 和股票的精选，在有效分散风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、拟投资 ETF 和个股的选择：（1）拟投资 ETF 的选择；（2）个股的选择；3、固定收益资产的投资；4、金融衍生品风险管理策略及流程。
业绩比较基准	标准普尔金砖四国（含香港）市场指数（总回报）
风险收益特征	本基金主要投资于与“金砖四国”相关的权益类资产。从所投资市场看，“金砖四国”属于新兴市场，其投资风险往往高于成熟市场；同时，“金砖四国”经济联动性和市场相关性存在日益加大的可能性，因此本基金国家配置的集中性风险也可能较其他分散化程度较高的新兴市场投资基金更高。从投资工具看，权益类投资的风险高于固定收益类投资的风险。因此，本基金是属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益水平高于一般的投资于全球或成熟市场的偏股型基金。

3、基金运作情况概述

信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）经中国证监会证监许可[2010]1217 号文核准，自 2010 年 11 月 8 日起至 2010 年 12 月 10 日止通过各销售机构向社会公开募集。

经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的净认购金额为 399,098,319.14 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 99,835.02 元人民币。上述资金已于 2010 年 12 月 16 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 3809 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 399,098,319.14 份基金份额，利息结转的基金份额为 99,835.02 份基金份额。两项合计共 399,198,154.16 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

《信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）基金合同》于 2010 年 12 月 17 日生效。

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《基金合同》的约定，本基金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《关于终止信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》。本基金的基金最后运作日定为 2023 年 6 月 7 日，并于 2023 年 6 月 8 日起进入清算程序。

4、财务会计报告

.1 资产负债表（已经审计）

单位：人民币元

资 产	2023 年 6 月 7 日 基金最后运作日
资 产：	
银行存款	7,457,199.00
结算备付金	—
存出保证金	—
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	—
贵金属投资	—
其他投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
其中：债券投资	—
资产支持证券投资	—

其他投资	-
应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	7,457,199.00
负债和净资产	2023年6月7日 基金最后运作日
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	-
应付清算款	-
应付赎回款	606,900.12
应付管理人报酬	22,956.75
应付托管费	3,935.44
应付销售服务费	-
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	1.58
负债合计	633,793.89
净资产：	
实收基金	11,082,444.70
未分配利润	-4,259,039.59
净资产合计	6,823,405.11
负债和净资产总计	7,457,199.00

5、基金财产分配

本基金自 2023 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

本基金清算期间（自 2023 年 6 月 8 日起至 2023 年 6 月 14 日止）未产生清算费用。

5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款及利息为人民币 7,457,199.00 元。其中境内人民币及利息 7,054,905.97 元、境内美元及利息折合人民币 22.64 元、境内港币及利息折合人民币 3.94 元、境外美元折合人民币 271,260.04 元、境外港币折合人民币 131,000.93 元、境外英镑折合人民币 5.48 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 606,900.12 元，截至 2023 年 6 月 14 日已支付 360,287.90 元，清算期间确认赎回款 149,233.13 元，剩余 395,845.35 元将于清算期结束后支付。

(2) 本基金最后运作日应付赎回费人民币 1.58 元，该款项已于 2023 年 6 月 14 日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 22,956.75 元，该款项将于清算期结束后支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费人民币 3,935.44 元，该款项将于清算期结束后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	清算期间（自 2023 年 06 月 08 日起至 2023 年 06 月 14 日止）
一、清算收益	
1、利息收入-银行存款利息收入（注 1）	478.61
2、汇兑收益	1,808.43
清算收入小计	2,287.04
二、清算费用	
1、交易费用	-
2、税金及附加	-
清算费用小计	-
三、清算期间收益	2,287.04

注：利息收入计提的清算期间（自 2023 年 06 月 08 日起至 2023 年 06 月 14 日止）的银行存款利息。

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 2023 年 06 月 07 日基金净资产	6,823,405.11
加：清算期间收益	2,287.04
减：基金赎回金额	149,233.13
二、清算结束日 2023 年 06 月 14 日基金净资产	6,676,459.02

资产处置及负债清偿后，于 2023 年 06 月 14 日本基金剩余财产为人民币 6,676,459.02 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。

清算期结束日次日 2023 年 06 月 15 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) 信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）财务报表及审计报告
- (2) 上海市通力律师事务所关于《信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）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。

信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）

基金财产清算小组

2023 年 6 月 29 日