

# 建信瑞盛添利混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告出具日期: 2017年12月26日

报告公告日期: 2018年2月1日

## 一、重要提示

建信瑞盛添利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2424号《关于准予建信鑫和回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及证监许可[2016]1572号《关于准予建信鑫和回报灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据市场环境变化,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》和《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)的有关规定,本基金管理人——建信基金管理有限责任公司经与基金托管人——中信银行股份有限公司协商一致,提议并经本基金基金份额持有人大会投票表决,审议通过《关于终止建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金持有人大会表决投票时间自2017年11月9日起,至2017年12月1日17:00止。根据本基金基金份额持有人大会通过的议案及方案说明,自2017年12月7日起,本基金进入清算期。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见刊登在2017年12月7日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站(<http://www.ccbfund.cn>)上的《关于建信瑞盛添利混合型证券投资基金进入清算期及停止办理申购、赎回、转托管及基金转换业务的公告》。

本基金清算期为14个工作日,自2017年12月7日至2017年12月26日止。由基金管理人建信基金管理有限责任公司、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)和北京德恒律师事务所于2017年12月7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)对清算报告进行审计,北京德恒律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

1、基金名称：建信瑞盛添利混合型证券投资基金（A 类份额基金简称为建信瑞盛添利混合 A，代码：003057；C 类份额基金简称为建信瑞盛添利混合 C，代码：003058）。

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2016 年 9 月 13 日

4、投资目标：在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。

5、投资策略：本基金的投资策略分为两个层面：首先，依据基金管理人的大类资产配置策略动态调整基金资产在各大类资产间的分配比例；而后，进行各大类资产中的个股、个券精选。具体由大类资产配置策略、股票投资策略、固定收益类资产投资策略和金融衍生品投资策略四部分组成。

6、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×40% +中债综合指数（全价）收益率×60%。

7、风险收益特征：本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

8、基金管理人：建信基金管理有限责任公司

9、基金托管人：中信银行股份有限公司

## 三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：建信瑞盛添利混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 6 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 6 日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	1,717,042.47
存出保证金	107,288.67
应收利息	21,483.02

应收申购款	-
<b>资产总计</b>	<b>1,845,814.16</b>
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负 债：</b>	
应付赎回款	31,942.06
应付管理人报酬	178.53
应付托管费	59.53
应付销售服务费	11.20
其他负债	72,000.00
<b>负债合计</b>	<b>104,191.32</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	1,649,868.99
未分配利润	91,753.85
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,741,622.84</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,845,814.16</b>

注：

1. 报告截止日 2017 年 12 月 6 日（基金最后运作日），基金份额总额 1,649,868.99 份。其中建信瑞盛添利基金 A 类基金份额净值 1.0575 元，基金份额总额 1,046,305.86 份；建信瑞盛添利基金 C 类基金份额净值 1.0524 元，基金份额总额 603,563.13 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 6 日(基金最后运作日)。

## 四、清盘事项说明

### 1、基本情况

建信瑞盛添利混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2424 号《关于准予建信鑫和回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及证监许可[2016]1572 号《关于准予建信鑫和回报灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,020,157,462.35 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他依法上市的股票）、债券（包含国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票等权益类金融工具占基金资产的比例不超过 40%，债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例不低于 60%，其中每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+中债综合指数（全价）收益率×60%。

根据《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》以及建信基金管理有限责任公司于 2017 年 12 月 7 日发布的《关于建信瑞盛添利混合型证券投资基金进入清算期及停止办理申购、赎回、转托管及基金转换业务的公告》，自 2017 年 12 月 7 日起，本基金进入基金财产清算期，基金管理人已依据相关法律法规和本基金基金合同的规定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

## **2、清算原因**

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人利益，经基金份额持有人大会决定终止基金合同。

## **3、清算起始日**

根据《关于建信瑞盛添利混合型证券投资基金进入清算期及停止办理申购、赎回、转托管及基金转换业务的公告》，本基金清算起始日为 2017 年 12 月 7 日。

## **4、清算报表编制基础**

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资

产、负债均按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的数据列示。

## **五、清算情况**

自 2017 年 12 月 7 日至 2017 年 12 月 26 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《建信瑞盛添利混合型证券投资基金基金合同》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。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，除银行直接扣付的划款手续费外，自清盘起始日起，与本基金的清算相关的清算费用将由基金管理人代为支付。

### **2、资产处置情况**

(1) 本基金最后运作日应收利息人民币 21,483.02 元，该款项已由托管银行于 12 月 21 日结算入账。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币 107,288.67 元，是由中国证券登记结算公司上海分公司和深圳分公司收取并保管的结算保证金。该款项由基金管理人建信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于 2017 年 12 月 21 日划入托管账户。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。

### **3、负债清偿情况**

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 31,942.06 元，该款项已于 2017 年 12 月 8 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 178.53 元，该款项已于 2017 年 12 月 8 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 59.53 元，该款项已于 2017 年 12 月 8 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 11.20 元，该款项已于 2017

年 12 月 8 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 72,000.00 元，为预提审计费用，该款项已于 2017 年 12 月 25 日进行了支付。

#### 4、清算日的清算损益情况

单位：人民币元  
自 2017 年 12 月 7 日至  
2017 年 12 月 26 日  
止清算期间

项目

一、清算收益	
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	1,534.67
利息收入-结算保证金利息收入（注 2）	96.32
清算收入小计	<u>1,630.99</u>
二、清算费用	
银行划款手续费（注 3）	40.00
清算费用小计	40.00
三、清算净收益	<u>1,590.99</u>

注 1：利息收入系计提的自 2017 年 12 月 7 日至 2017 年 12 月 26 日止清算期间的银行存款利息。

注 2：利息收入系计提的自 2017 年 12 月 7 日至 2017 年 12 月 26 日止清算期间的结算保证金利息。

注 3：经本基金管理人建信基金管理有限责任公司确认，除银行直接扣付的划款手续费外，自清盘起始日起，与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

#### 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

(1) 建信瑞盛添利混合 A（基金代码：003057）

项 目	金 额
一、最后运作日 2017 年 12 月 6 日基金净资产	1,106,453.65
加：清算期间收益	1,036.14
减：清算期间费用	25.41
二、2017 年 12 月 26 日基金资产净值	1 107,464.38

(2) 建信瑞盛添利混合 C（基金代码：003058）

项 目	金 额
一、最后运作日 2017 年 12 月 6 日基金净资产	635,169.19
加：清算期间收益	594.85
减：清算期间费用	14.59

二、2017年12月26日基金资产净值	635,749.45
---------------------	------------

注：清算期间 A 类和 C 类份额每日的收益按照 2017 年 12 月 7 日到 2017 年 12 月 26 日各类份额每日的净值占比进行分配；A 类和 C 类份额每日的费用按照 2017 年 12 月 7 日到 2017 年 12 月 26 日各类份额每日的净值占比进行分摊。

资产处置及负债清偿后，2017 年 12 月 26 日本基金剩余财产为人民币 1,743,213.83 元，包括建信瑞盛添利混合 A 人民币 1,107,464.38 元和 建信瑞盛添利混合 C 人民币 635,749.45 元。2017 年 12 月 27 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。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在清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金管理人建信基金管理有限责任公司以自有资金垫付应收结算保证金人民币 107,288.67 元以及从 2017 年 12 月 21 日至 2017 年 12 月 26 日止期间的利息收入人民币 513.84 元，并已于 2017 年 12 月 21 日划入托管账户。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到帐日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

## 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，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- (1) 《建信瑞盛添利混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《建信瑞盛添利混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

建信瑞盛添利混合型证券投资基金财产清算小组

2018 年 2 月 1 日