

建信鑫利回报灵活配置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:中国光大银行股份有限公司

报告出具日期: 2022 年 9 月 27 日

报告公告日期: 2022 年 10 月 1 日

## 一、重要提示

建信鑫利回报灵活配置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”)2017年5月2日证监许可[2017]628号文注册募集，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《建信鑫利回报灵活配置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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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《建信鑫利回报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》”）的有关规定，建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）出现了《基金合同》终止事由，且建信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）应当在上述事由出现后终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。自2022年8月10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2022年8月10日中国证监会规定媒介和基金管理人网站（<http://www.ccbfund.cn>）上的《关于建信鑫利回报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》。

本基金清算期自2022年8月10日起至2022年8月25日止。由基金管理人建信基金管理有限责任公司、基金托管人中国光大银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成的基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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、基金名称：建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金。
- 2、基金运作方式：契约型开放式。
- 3、《基金合同》生效日：2018年1月10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、债券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：

本基金以自上而下的投资策略，灵活配置大类资产，动态控制组合风险，力求实现基金资产的持续稳定增值。

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、股指期货投资策略、国债期货投资策略和权证投资策略六部分组成。

6、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50% +中债综合指数（全价）收益率×50%。

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：中国光大银行股份有限公司。

### 三、财务会计报告

#### 资产负债表（经审计）

会计主体：建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 8 月 9 日

单位：人民币元

资产	本期末 2022 年 8 月 9 日（基金最后运作日）
资产：	
银行存款	1,221,089.36
结算备付金	28,687.79
存出保证金	48,897.21
交易性金融资产	1,667,913.52
其中：股票投资	1,667,913.52
应收证券清算款	10,213,878.90
应收申购款	138.68
资产总计	<b>13,180,605.46</b>
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	379,528.28
其他负债	583,641.76

负债合计	<b>963,170.04</b>
所有者权益：	
实收基金	9,149,003.59
未分配利润	3,068,431.83
所有者权益合计	<b>12,217,435.42</b>
负债和所有者权益总计	<b>13,180,605.46</b>

注：报告截止日 2022 年 8 月 9 日（基金最后运作日），基金份额总额 9,149,003.59 份，其中建信鑫利回报灵活配置混合 A 基金份额总额 5,277,146.29 份，基金份额净值 1.3317 元；建信鑫利回报灵活配置混合 C 基金份额总额 3,871,857.30 份，基金份额净值 1.3403 元。

## 四、清盘事项说明

### 1、基本情况

建信鑫利回报灵活配置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”）2017 年 5 月 2 日证监许可[2017]628 号文注册募集。由建信基金管理有限责任公司于 2017 年 11 月 1 日至 2018 年 1 月 5 日向社会公开募集，《基金合同》于 2018 年 1 月 10 日生效。首次设立募集规模为 218,164,944.73 份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人及登记机构均为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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、存托凭证及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、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）、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证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。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%，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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

## 2、清算原因

本基金出现了《基金合同》终止事由，且建信基金管理有限责任公司应当在上述事由出现后终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。

## 3、清算起始日

根据《关于建信鑫利回报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》，本基金自 2022 年 8 月 10 日起进入清算程序，由于本基金持有的流通受限股票无法确定变现时间，本基金计划将进行两次清算，其中第一次清算期间为 2022 年 8 月 10 日至 2022 年 8 月 25 日，第二次清算期间将根据流通受限股票的变现时间确定。

## 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《资产管理产品相关会计处理规定》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。管理人编制本清算报表是为了建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组报送建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金全体持有人以及中国证券监督管理委员会使用。因此，本清算报表可能不适用于其他用途。

## 五、清算情况

自 2022 年 8 月 10 日起至 2022 年 8 月 25 日止的第一次清算期间，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。

第一次清算期间具体清算情况如下：

### 1、清算费用

按照《建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”这个部分的规定，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和清算审计费外，自清算起始日起，与本基金清算相关的律师费将由基金管理人代为支付。

## 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 1,221,089.36 元，其中包含应计利息为人民币 3,323.94 元。清算期间，银行存款共计提利息人民币 3,496.84 元。截至本次清算期结束日，银行存款余额为人民币 10,803,650.72 元，其中应计银行存款利息余额为人民币 6,820.78 元，该款项已于 2022 年 9 月 21 日划至托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 28,687.79 元，其中上海结算备付金为人民币 28,571.43 元，应计上海结算备付金利息为人民币 94.26 元；应计深圳结算备付金利息为人民币 22.10 元。清算期间上海结算备付金计提利息为人民币 20.64 元。截至本次清算期结束日，结算备付金余额为人民币 28,708.43 元。结算备付金人民币 28,571.43 元已于 2022 年 9 月 2 日划入托管账户；应计结算备付金利息人民币 137.00 元，该款项已于 2022 年 9 月 21 日划至托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 48,897.21 元，其中上海存出保证金为人民币 21,529.05 元，上海存出保证金应计利息为人民币 50.53 元；深圳存出保证金为人民币 27,253.71 元，深圳存出保证金应计利息为人民币 63.92 元。清算期间上海存出保证金计提利息为人民币 15.52 元，深圳存出保证金计提利息为人民币 19.68 元。截至本次清算期结束日，存出保证金余额为人民币 48,932.41 元。存出保证金人民币 48,782.76 元已于 2022 年 9 月 2 日划入托管账户；存出保证金应计利息人民币 149.65 元，该款项已于 2022 年 9 月 21 日划至托管账户。

(4) 本基金最后运作日持有交易性金融资产为人民币 1,667,913.52 元，全部为股票投资，除因尚处于锁定期内无法卖出的股票，本基金所持其余股票均已处置变现，处置收益为人民币 57,585.38 元，变现产生的证券清算款为人民币 186,440.95 元，已于清算期间划入托管账户。截至 2022 年 8 月 25 日，本基金仍持有锁定期限售股票人民币 1,792,814.88 元。待锁定期限售股票变现后，基金管理人将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(5) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 138.68 元，该款项已于清算期间划入基金托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 10,213,878.90 元，该款项已于清算期间划入基金托管账户。

### 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 379,528.28 元，该款项已于清算期间从本基金托管账户划付给基金份额持有人。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币 583,641.76 元，包含应付交易费用人民币 295,983.59 元，清算期间产生应付交易费用人民币 172.68 元，合计人民币 296,156.27 元，全部为应付席位佣金；应付审计费人民币 65,000.00 元；应付信息披露费人民币 72,658.17 元，上述款项已于清算期间支付。截至 2022 年 8 月 25 日，其他应付款为人民币 150,000.00 元，为公司自有资金垫付款，将于清算期后返还给基金管理人，该款项自进入清算期起孳生的利息归基金管理人所有。

### 4、清算损益情况

单位：人民币元

	自 2022 年 8 月 10 日起至 2022 年 8 月 25 日止的清算期间
一、清算期间收益	
利息收入（注 1）	3,552.68
股息红利税（注 2）	-202.74
处置交易性金融资产产生的净收益（注 3）	57,585.38
公允价值变动损益	253,584.25
清算收入小计	314,519.57
清算费用小计	0.00
三、清算净收益	314,519.57

注 1：利息收入系计提的自 2022 年 8 月 10 日起至 2022 年 8 月 25 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。

注 2：股息红利税系根据《股息红利差别化纳税会计核算细则》（中基协发[2012]21 号），于转让交割股票日的次一交易日，根据中登公司按投资者实际持股期限计算的应缴税额计提应缴税款而确认的红字股利收益。

注 3：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出股票成交金额减去

卖出股票最后运作日的股票估值总额及买卖股票产生的交易费用后的差额。

## 5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

建信鑫利回报灵活配置混合 A (基金代码：004652)

单位：人民币元

项目	金额
一、2022年8月9日（基金最后运作日）基金净资产	7,027,809.48
加：清算期间净收益	181,041.36
加：2022年8月10日确认的申购款	179.34
二、2022年8月25日基金资产净值	7,209,030.18

建信鑫利回报灵活配置混合 C (基金代码：004653)

单位：人民币元

项目	金额
一、2022年8月9日（基金最后运作日）基金净资产	5,189,625.94
加：清算期间收益	133,478.21
加：2022年8月10日确认的申购款	101.76
减：2022年8月10日确认的赎回款	8,129.65
二、2022年8月25日基金资产净值	5,315,076.26

注：资产处置及负债清偿后，2022年8月25日（清算期结束日），本基金剩余财产为人民币12,524,106.44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在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。

于本次清算期结束日2022年8月25日，本基金剩余财产中包含尚未变现的交易性金融资产人民币1,792,814.88元，该金额为锁定期限售股票于本次清算结束日的估值金额，与锁定期限售股票流产后实际变现金额可能存在差异。上述剩余未变现的资产将根据变现情况在第二次清算时按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日 2022 年 8 月 26 日至本次清算款划出前一日银行存款利息亦属份额持有人所有，将于本次清算期结束后按基金份额持有人持有的基金份额比例分配。

## **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) 《建信鑫利回报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《建信鑫利回报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**

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。

建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

报告出具日期：2022 年 9 月 27 日

报告公告日期：2022 年 10 月 1 日