

建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金
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:国信证券股份有限公司

公告日期:2016年12月3日

一、重要提示

建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金（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]1132号《关于准予建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金注册的批复》注册，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《建信中证申万有色金属指数分级发起式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，基金托管人为国信证券股份有限公司。

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《建信中证申万有色金属指数分级发起式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——国信证券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《关于终止建信中证申万有色金属指数分级发起式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2016年9月19日起，至2016年9月30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2016年10月17日起，本基金进入财产清算期。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见刊登在2016年10月13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《关于建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金进入清算期及停止办理申购、赎回、转托管、基金转换及配对转换业务的公告》。

自2016年10月17日至2016年10月28日止对除停牌股票外的所有基金财产进行清算。由基金管理人建信基金管理有限责任公司、基金托管人国信证券股份有限公司、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2016年10月17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）对运作期最后一日的财务报告进行审计，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：建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金（基金简称：建信有色金属分级，场内简称：有色金属，基金代码：165316；建信有色 A：150333；建信有色 B：150334）。

2、基金运作方式：契约型开放式、发起式

3、基金合同生效日：2015年8月6日

4、投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

5、投资策略：本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

6、业绩比较基准：中证申万有色金属指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

7、风险收益特征：本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。从本基金所分拆的两类基金份额来看，建信有色 A 份额具有低风险且预期收益相对较低的特征；建信有色 B 份额具有高风险且预期收益相对较高的特征。

8、基金管理人：建信基金管理有限责任公司

9、基金托管人：国信证券股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金

报告截止日：2016年10月25日

单位：人民币元

资产	2016年10月25日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	53,300,466.92
存出保证金	42,506.29
股票投资	4,118,772.00
应收证券清算款	942,311.21
应收利息	16,526.50
资产总计	58,420,582.92
负债和所有者权益	
负债：	
应付交易费用	878.54
负债合计	878.54
所有者权益：	
实收基金	57,330,743.05
未分配利润	1,088,961.33
所有者权益合计	58,419,704.38
负债和所有者权益总计	58,420,582.92

注：1、报告截止日2016年10月25日（基金最后运作日），基金份额总额57,933,576.52份。其中建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金之A类份额的份额净值1.0541元，基金份额总额1,380,078.00份；建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金之B类份额的份额净值0.9627元，基金份额总额1,380,078.00份；建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金之基础份额的份额净值1.0084元，基金份额总额55,173,420.52份。

2、因清算期间基金管理人将部分股票卖出，所以基金最后运作日为该类股票卖出之日，即2016年10月25日。截止2016年10月25日，除停牌股票外其余股票均已卖出。

四、清盘事项说明

1、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。

2、清算起始日

根据《关于中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金清算起始日为2016年10月17日。

3、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，剩余停牌股票的清算价格按最后运作日的公允价值计价。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。

五、清算情况

自2016年10月17日至2016年10月28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《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金基金合同》第二十五部分“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、中债账户维护费和交易单元佣金外，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证券清算款人民币 942,311.21 元，该款项已于 2016 年 10 月 26 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收利息人民币 16,526.50 元，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 2016 年 10 月 27 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

本基金最后运作日应付交易费用人民币 878.54 元，该款项已于 2016 年 10 月 26 日进行了支付。

4、清算日的清算损益情况

项目	自 2016 年 10 月 26 日至 2016 年 10 月 28 日 止清算期间
一、清算收益	
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	5,214.14
清算收入小计	<u>5,214.14</u>
二、清算费用	
中债账户维护费（注 2）	3,000.00
交易费用（注 3）	3,700.00
清算费用小计	<u>6,700.00</u>
三、清算净收益	<u>-1,485.86</u>

注 1：利息收入系计提的自 2016 年 10 月 26 日至 2016 年 10 月 28 日止清算期间的银行存款利息。

注 2：中央国债登记结算有限责任公司对开户会员按季收取中债账户维护费，该笔费用为 2016 年 10 月至 11 月（办理销户手续期间）产生的费用。

注 3：该笔费用为预估现有停牌股票在未来复牌后卖出所产生的交易单元佣金费用。

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 2016 年 10 月 25 日基金净资产	58,419,704.38
加：清算期间净收益	-1,485.86
二、2016 年 10 月 28 日基金资产净值	58,418,218.52

资产处置及负债清偿后，2016年10月28日本基金剩余财产为人民币58,418,218.52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并已于2016年10月27日划入托管账户人民币21,740.64元，用以垫付应收利息（包括本基金最后运作日应收利息人民币16,526.50元和清算期间利息收入5,214.14元），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。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。

基金管理人以自有资金垫付基金未能变现的股票资产，待停牌股票复牌后基金管理人将股票变现卖出，若变现金额高于基金管理人垫付的金额，则将差额按基金份额持有人的基金份额比例追偿给基金份额持有人；若变现金额小于基金管理人垫付的金额，则由基金管理人承担相应损失。

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) 《建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《建信中证申万有色金属指数分级发起式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。

建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金财产清算小组

2016年12月3日