

# 兴华瑞丰混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：兴华基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告出具日期：二〇二二年九月二十三日

报告公告日期：二〇二二年九月二十八日

# 1、重要提示

## 1.1 重要提示

兴华瑞丰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”）2020年12月3日证监许可[2020]3283号文准予注册，并经中国证监会2021年8月2日证监许可[2021]2577号文变更注册，基金管理人为兴华基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《兴华瑞丰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”之“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；……”。本基金基金管理人经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于2022年9月13日计票并表决通过了《关于终止兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金管理人于2022年9月14日在规定媒介就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告，详见《兴华瑞丰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》。

本基金自2022年9月15日起进入清算程序。本基金清算期为2022年9月15日至2022年9月21日，由本基金基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所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，上海市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

基金简称	兴华瑞丰混合	
基金主代码	010999	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年12月30日	
2022年9月14日日终基金份额总额	6,283,209.34份	
基金管理人	兴华基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴华瑞丰混合 A	兴华瑞丰混合 C
下属分级基金的交易代码	010999	011000
2022年9月14日日终下属分级基金的份额总额	1,197,626.24份	5,085,583.10份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，力争超越业绩比较基准，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中债国债总全价指数收益率*85%+沪深300指数收益率*15%(2021年11月2日之前) 中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20% (2021年11月2日之后)
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 3、基金运作情况说明

### 3.1 基金基本情况

本基金经中国证监会证监许可[2020]3283号《关于准予兴华瑞丰混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由兴华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华瑞丰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基金，

存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共计人民币 203,182,099.26 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 1143 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 12 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 203,216,053.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 33,954.07 份基金份额。本基金的基金管理人为兴华基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于 2021 年 11 月 1 日计票并表决通过了《关于兴华瑞丰混合型证券投资基金变更投资范围有关事项的议案》，内容包括修改投资范围、投资组合比例、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值对象及估值方法，并增加公开披露的基金信息等。上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，自 2021 年 11 月 2 日起，变更注册后的《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》生效。

根据《兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华瑞丰混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、证券公司短期公司债券、二级资本债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括股指期货、国债期货)以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-30%；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：

中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%。

### 3.2 清算原因

根据《兴华瑞丰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”之“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；……”。本基金基金管理人经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于 2022 年 9 月 13 日计票并表决通过了《关于终止兴华瑞丰混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金管理人于 2022 年 9 月 14 日在规定媒介就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告，详见《兴华瑞丰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》。

### 3.3 清算起始日

根据《兴华瑞丰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》，本基金于 2022 年 9 月 15 日起进入清算程序。

## 4、财务报告

### 4.1 资产负债表(已经审计)

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：兴华瑞丰混合型证券投资基金

报告截止日：2022年9月14日

单位：人民币元

资产	2022年9月14日 (基金最后运作日)
<b>资产：</b>	
银行存款	5,809,131.92
存出保证金	282.54
<b>资产总计</b>	<b>5,809,414.46</b>
<b>负债：</b>	
应付赎回款	78.10
应付管理人报酬	1,430.36
应付托管费	476.78
应付销售服务费	770.46
其他负债	59,750.00

负债合计	<b>62,505.70</b>
所有者权益：	
实收基金	6,283,209.34
未分配利润	-536,300.58
所有者权益合计	<b>5,746,908.76</b>
负债和所有者权益总计	<b>5,809,414.46</b>

注：1. 报告截止日 2022 年 9 月 14 日(基金最后运作日)，基金份额总额 6,283,209.34 份。

其中兴华瑞丰混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 0.9198 元，基金份额总额 1,197,626.24 份；兴华瑞丰混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 0.9134 元，基金份额总额 5,085,583.10 份。

2. 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。基金管理人编制清算报表是为了供兴华瑞丰混合型证券投资基金全体持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。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数据列示。

## 5、清算情况

### 5.1 资产负债清算情况

清算期间自 2022 年 9 月 15 日至 2022 年 9 月 21 日止，兴华瑞丰混合型证券投资基金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。各项资产负债清算情况如下：

#### 5.1.1 资产处置情况

1、本基金最后运作日银行存款及其应计利息总和为人民币 5,809,131.92 元，其中托管户存款为 5,808,092.78 元，应计银行存款利息 1,039.14 元。应计利息已于 2022 年 9 月 21 日结息时收到。

2、本基金最后运作日存出保证金及其应计利息总和为人民币 282.54 元，其中应计券商保证金利息 282.54 元，应计利息已于 2022 年 9 月 20 日结息时收到。

#### 5.1.2 负债的清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 78.10 元，该款项已于 2022 年 9 月 15 日支付。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,430.36 元，该款项已于 2022 年 9 月 16 日支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 476.78 元，该款项已于 2022 年 9 月 16 日支付。

4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 770.46 元，该款项已于 2022 年 9 月 16 日支付。

5、本基金最后运作日其他负债为人民币 59,750.00 元，包含预提的审计费、律师费、账户维护费和汇划手续费。其中，预提审计费为人民币 20,000.00 元，该款项预计 2022 年 9 月 26 日安排支付；预提律师费为人民币 35,000.00 元，已于 2022 年 9 月 16 日支付人民币 30,000.00 元，剩余人民币 5,000.00 元预计 2022 年 9 月 26 日安排支付；预提账户维护费为人民币 4,500.00 元，该款项预计 2022 年 9 月 26 日支付；预提汇划手续费人民币 250.00 元，与托管户开户行协商，2022 年 9 月 16 日之后手续费减免，已于 2022 年 9 月 19 日冲回人民币 210.58 元，剩余汇划手续费人民币 39.42 元预计销户时支付。

## 5.2 清算损益表

项目	2022 年 9 月 15 日至 2022 年 9 月 21 日 (清算期间)
<b>一、清算收益</b>	<b>1,509.37</b>
1. 利息收入	1,508.13
2. 其他收入	1.24
<b>二、清算费用</b>	<b>-210.58</b>
1. 汇划费	-210.58
<b>三、清算收益（损失）总额</b>	<b>1,719.95</b>

注：1. 利息收入系计提的自 2022 年 9 月 15 日至 2022 年 9 月 21 日止清算期间的银行存款利息收入、存出保证金利息收入。其中，银行存款利息收入人民币 1,508.08 元；存出保证金利息收入人民币 0.05 元。

2. 其他收入系清算期间本基金收到的归入基金资产的赎回费。

## 5.3 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排

项目	金额
<b>一、最后运作日 2022 年 9 月 14 日 基金净资产</b>	<b>5,746,908.76</b>
加：清算期间净收益	1,719.95
减：基金净赎回金额（于 2022 年 9 月 15 日确认的投资者赎回申请）	949,472.25
<b>二、2022 年 9 月 21 日基金净资产</b>	<b>4,799,156.46</b>

截至本次清算期结束日 2022 年 9 月 21 日，本基金剩余财产为人民币 4,799,156.46 元。

自本次清算期结束日次日 2022 年 9 月 22 日至清算款划出前一日的收益和费用由基金份额

持有人享有和承担。为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金对未到账的应收利息进行垫付。

#### **5.4 清算报告的告知安排**

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分析。

## **6、备查文件目录**

### **6.1 备查文件目录**

- 6.1.1 兴华瑞丰混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 6.1.2 关于《兴华瑞丰混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

### **6.2 存放地点**

基金管理人处

### **6.3 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

兴华瑞丰混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二二年九月二十三日