

建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金
二次清算报告

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 12 月 27 日

报告公告日期: 2022 年 12 月 30 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》。

本基金第一次清算期间为2022年8月10日至2022年8月25日。本基金的基金管理人于2022年10月1日对《建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金清算报告》进行了公告，并于2022年10月11日支付了首笔清算款。

本次清算为第二次清算，清算期间为2022年8月26日至2022年11月28日。

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25日

单位：人民币元

资产	基金第一次清算结束日（2022年8月25日）
资产：	
银行存款	10,803,650.72
结算备付金	28,708.43
存出保证金	48,932.41
交易性金融资产	1,792,814.88
其中：股票投资	1,792,814.88

资产总计	12,674,106.44
负债和所有者权益	
负债：	
其他负债	150,000.00
负债合计	150,000.00
所有者权益：	
实收基金	9,143,148.64
未分配利润	3,380,957.80
所有者权益合计	12,524,106.44
负债和所有者权益总计	12,674,106.44

注：报告截止日 2022 年 8 月 25 日（基金第一次清算结束日），基金份额总额 9,143,148.64 份，其中建信鑫利回报灵活配置混合 A 基金份额总额 5,277,280.96 份，基金份额净值 1.3661 元；建信鑫利回报灵活配置混合 C 基金份额总额 3,865,867.68 份，基金份额净值 1.3749 元。

四、清算情况

自 2022 年 8 月 26 日起至 2022 年 11 月 28 日止的第二次清算期间，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。

第二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) 本基金第一次清算结束日银行存款为人民币 10,803,650.72 元，其中包含应计银行存款利息人民币 6,820.78 元。第二次清算期间，银行存款共计提利息人民币 11,186.66 元，收到银行存款利息人民币 12,464.48 元。截至第二次清算期结

束日，应计银行存款利息余额为人民币 5,542.96 元。该款项已于 2022 年 12 月 21 日划至托管账户。

(2) 本基金第一次清算结束日结算备付金为人民币 28,708.43 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 114.90 元；应计深圳结算备付金利息为人民币 22.10 元。第二次清算期间上海结算备付金计提利息人民币 9.03 元。结算备付金已于第二次清算期间划入托管账户。

(3) 本基金第一次清算结束日存出保证金为人民币 48,932.41 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 66.05 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 83.60 元。第二次清算期间存出保证金计提利息人民币 15.40 元。存出保证金已于第二次清算期间划入托管账户。

(4) 本基金第一次清算结束日持有的交易性金融资产为人民币 1,792,814.88 元，全部为股票投资。该股票投资已于第二次清算期间处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 1,617,359.79 元，已于第二次清算期间划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金第一次清算结束日其他负债为人民币 150,000.00 元，为公司自有资金垫付款，将于第二次清算期结束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、第二次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

	自 2022 年 8 月 26 日起至 2022 年 11 月 28 日止的清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注 1）	11,327.54
处置交易性金融资产产生的净收益（注 2）	374,657.54
股利收益	51,372.59
股息红利税（注 3）	-13,972.58
公允价值变动损益	-551,606.13
清算收入小计	-128,221.04
二、清算期间费用	
审计费用	14,000.00
清算费用小计	14,000.00

三、清算净收益	-142,221.04
---------	-------------

注 1：利息收入系计提的自 2022 年 8 月 26 日起至 2022 年 11 月 28 日止第二次清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息及认申购款利息。

注 2：处置交易性金融资产产生的净收益系第二次清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票第一次清算结束日的股票估值总额及买卖股票产生的交易费用后的差额。

注 3：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。

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 25 日（第一次清算结束日）基金净资产	7,209,030.18
加：清算期间净收益	-81,864.13
减：2022 年 10 月 11 日首次清算实际划付款	6,227,361.14
二、2022 年 11 月 28 日基金资产净值	899,804.91

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 25 日（第一次清算结束日）基金净资产	5,315,076.26
加：清算期间净收益	-60,356.91
减：2022 年 10 月 11 日首次清算实际划付款	4,591,311.05
二、2022 年 11 月 28 日基金资产净值	663,408.30

注：资产处置及负债清偿后，2022 年 11 月 28 日（第二次清算期结束日），本基金剩余财产为人民币 1,563,213.21 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。

自第二次清算期结束日次日 2022 年 11 月 29 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，将于第二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。

五、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第二次清算报表审计报告》；

(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二次清算报告》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 12 月 27 日

报告公告日期：2022 年 12 月 30 日