

建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资 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:上海银行股份有限公司

报告出具日期: 2026 年 8 月 18 日

报告公告日期: 2026 年 8 月 22 日

一、重要提示

建信兴晟优选一年持有期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”）2022年3月18日证监许可[2022]582号文注册募集。本基金的基金合同于2022年9月27日正式生效。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”），基金托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）“基金备案”章节中“基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，则直接进入基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议”。截至2026年8月4日，本基金已经连续50个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，不需召开基金份额持有人大会，本基金管理人可以依法履行基金财产清算程序并终止基金合同。详见本基金管理人于2026年8月5日发布的《关于建信兴晟优选一年持有期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》。

本基金最后运作日为2026年8月4日，自2026年8月5日起，本基金进入清算程序，本基金清算期自2026年8月5日起至2026年8月18日止。由基金管理人建信基金管理有限责任公司、基金托管人上海银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2026年8月5日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰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：**建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金（基金主代码：015521）

2、**基金运作方式：**契约型开放式

3、**基金合同生效日：**2022年9月27日

4、投资目标：本基金将积极发挥选股优势，在严格控制风险的前提下，通过专业化研究分析，力争实现基金资产的长期稳定增值。

5、投资策略：

本基金投资策略由资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、股票期权投资策略、存托凭证投资策略和融资策略九部分组成，具体策略如下：

（1）资产配置策略

本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

（2）股票投资策略

1）行业配置策略

本基金将主要遵循“自上而下”的投资理念，结合当前宏观经济运行情况及发展趋势、国家政策等因素，考察行业运行周期、发展空间等，重点关注具有良好发展前景的行业。

2）个股选择策略

本基金依托于基金管理人的投资研究平台，努力挖掘质地优秀、具备长期价值增长潜力的上市公司，以期通过基金管理人的选股能力获得长期可重复的超额收益（Alpha 收益）。

本基金结合定性分析和定量分析的方法选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资。定性分析主要基于投研团队对公司的案头研究和实地调研，包括所属细分行业情况、市场供求、商业模式、核心技术等内容，深入分析公司的治理结构、经营管理、竞争优势，综合考虑公司的估值水平和未来盈利空间。定量分析主要根据相关财务指标，如营业利润率、净利率、每股收益（EPS）增长、主营业务收入增长等，分析公司经营情况、财务情况等，并综合利用市盈率法（P/E），市净率法（P/B）、折现现金流法（DCF）等方法对公司进行合理估值。

3）港股投资策略

本基金将通过内地与香港股票市场互联互通机制投资于香港股票市场，将综

合比较并选择港股市场中优质股票进行投资。本基金将重点关注：

a) A 股稀缺性行业个股，包括优质中资公司（如国内互联网及软件企业、国内部分消费行业领导品牌等）、A 股缺乏投资标的行业；

b) 具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头；

c) 符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；

d) 与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。

（3）债券投资策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：

1) 久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

2) 收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

3) 债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。并通过信用风险、内含选择权的价值分析和管理的，获取适当的收益。

4) 可转换债券投资策略

本基金将着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的转债进行重点选择，并在对应可转换债券估值合理的前提下集中投资，以分享正股上涨带来的收益。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面判断上市公司对转股价的修正和转股意愿。

（4）股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

（5）国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与国债期货的投资。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。本基金构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，严控风险，最大限度保证基金资产安全。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

（6）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

（7）股票期权投资策略

基金管理人在进行股票期权投资前将建立股票期权投资决策小组，负责股票期权投资管理的相关事项。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。本基金将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。

（8）存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

（9）融资策略

为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可参与融资业务。未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

6、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%

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高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将通过港股通投资于香港市场股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

8、基金管理人：建信基金管理有限责任公司

9、基金托管人：上海银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 8 月 4 日

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 8 月 4 日（基金最后运作日）
资产：	
货币资金	9,271,122.03
结算备付金	10,289.21
存出保证金	-
交易性金融资产	12,600,599.12
其中：股票投资	12,600,599.12
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
买入返售金融资产	-
应收清算款	3,032,474.22
应收股利	11,864.25
应收申购款	-
其他资产	-

资产总计	24,926,348.83
负债：	
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	4,424,737.30
应付管理人报酬	-
应付托管费	-
应付销售服务费	-
应交税费	-
其他负债	54,142.88
负债合计	4,478,880.18
净资产：	
实收基金	23,643,652.92
未分配利润	-3,196,184.27
净资产合计	20,447,468.65
负债和净资产总计	24,926,348.83

注：报告截止日 2026 年 8 月 4 日（基金最后运作日），基金份额总额 23,643,652.92 份，其中建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金 A 类基金份额总额 18,932,270.71 份，基金份额净值人民币 0.8675 元；建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金 C 类基金份额总额 4,711,382.21 份，基金份额净值人民币 0.8540 元。

四、清盘事项说明

1、基本情况

建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会 2022 年 3 月 18 日证监许可[2022]582 号文注册募集。本基金的基金合同于 2022 年 9 月 27 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 312,693,423.36 份。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国内依法发行和上市的国债、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、公开发行的次级债券、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）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、

债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例不超过全部股票资产的 50%。本基金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，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，在履行适当程序后本基金的投资比例将做相应调整。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

2、清算原因

根据《基金合同》“基金备案”章节中“基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，则直接进入基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议”。截至 2026 年 8 月 4 日，本基金已经连续 50 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，不需召开基金份额持有人大会，本基金管理人可以依法履行基金财产清算程序并终止基金合同。详见本基金管理人于 2026 年 8 月 5 日发布的《关于建信兴晟优选一年持有期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》。

3、清算起始日

根据《关于建信兴晟优选一年持有期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 2026 年 8 月 5 日起进入清算程序。

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。基金管理人编制清算报表是为了呈报建信兴晟优选一年持有期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。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 2026 年 8 月 5 日起至 2026 年 8 月 18 日止的清算期间，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《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”的约定，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) 本基金于最后运作日的货币资金余额为人民币 9,271,122.03 元，其中银行存款活期存款本金为人民币 4,948,100.60 元，应计银行存款活期存款利息为人民币 1,009.97 元；存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金本金为人民币 4,321,685.90 元，应计证券交易结算资金利息为人民币 325.56 元。本基金于清算结束日的货币资金余额为人民币 18,390,201.92 元，其中银行存款活期存款本金为人民币 18,387,991.08 元，应计银行存款活期存款利息为人民币 1,904.72 元；存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金余额为人民币 306.12 元，均为应计证券交易结算资金利息。由于该证券经纪商基金专用证券账户和银行尚未结息，应计证券交易结算资金利息和应计银行存款活期存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担，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。

（2）本基金于最后运作日的结算备付金余额为人民币 10,289.21 元，其中期货备付金为人民币 10,278.01 元，应计期货备付金利息为人民币 11.20 元，均已于清算期间划入托管账户。

（3）本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 12,600,599.12 元，全部为股票投资。该股票投资已于清算期间处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 13,223,530.25 元，已于清算期间划入托管账户。

（4）本基金最后运作日的应收股利为人民币 11,864.25 元。由于相关上市公司尚未派发股利，应收股利将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际收到股利金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

（5）本基金最后运作日的应收清算款为人民币 3,032,474.22 元，已于清算期间划入托管账户。

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 4,424,737.30 元，清算期间产生应付赎回款为人民币 2,667,383.94 元，全部款项已于清算期间支付。

（2）本基金最后运作日其他负债为人民币 54,142.88 元，其中应付审计费为人民币 6,800.00 元，应付信息披露费为人民币 47,342.88 元。应付审计费全部款项已于 2026 年 8 月 14 日支付。应付信息披露费全部款项已于 2026 年 8 月 18 日支付。

4、 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

	自 2026 年 8 月 5 日起 至 2026 年 8 月 18 日止的清算期间
一、清算收益	
利息收入（注 1）	1,033.47
处置交易性金融资产产生的净收益（注 2）	629,932.26
股息红利税（注 3）	-1,966.34
清算收入小计	628,999.39
二、清算费用	
其他费用（注 4）	16.80
清算费用小计	16.80
三、清算净收益	628,982.59

注 1：利息收入系自 2026 年 8 月 5 日起至 2026 年 8 月 18 日止清算期间计提的银行存款利息收入、存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入和结算备付金利息收入。

注 2：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，加上清算期间产生的股利收入。

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），于转让交割股票后的次一交易日，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 4：其他费用系在清算期间发生的证券组合费。

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

建信兴晟优选一年持有混合 A

项目	金额
一、最后运作日 2026 年 8 月 4 日基金净资产	16,423,936.77
加：清算期间净损益	493,322.91
加：清算期间基金份额交易产生的净值影响	-2,478,680.87
二、清算结束日 2026 年 8 月 18 日基金资产净值	14,438,578.81

建信兴晟优选一年持有混合 C

项目	金额
一、最后运作日 2026 年 8 月 4 日基金净资产	4,023,531.88
加：清算期间净损益	135,659.68
加：清算期间基金份额交易产生的净值影响	-188,703.07
二、清算结束日 2026 年 8 月 18 日基金资产净值	3,970,488.49

注：资产处置及负债清偿后，2026 年 8 月 18 日（清算结束日）本基金剩余财产为人民币 18,409,067.30 元。其中建信兴晟优选一年持有混合 A 清算分配金额人民币 14,438,578.81 元，建信兴晟优选一年持有混合 C 清算分配金额人民币 3,970,488.49 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，按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金管理人以自有资金垫付的资金将于清算款划出前划入托管账户，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。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。清算期结束日后至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息属份额持有人所有，在支付清算款时将一并计算并支付给份额持有人。

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) 《建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 关于建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金清算事宜之法律意见。

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。

建信兴晟优选一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

报告出具日期：2026年8月18日

报告公告日期：2026年8月22日