

建信鑫丰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:中国民生银行股份有限公司

报告出具日期: 2021 年 6 月 18 日

报告公告日期: 2021 年 6 月 30 日

一、重要提示

建信鑫丰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”）2015年5月25日证监许可[2015]988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《建信鑫丰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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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《建信鑫丰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，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——中国民生银行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《关于终止建信鑫丰回报灵活配置混合型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2021年3月25日起，至2021年4月19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2021年4月22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2021年4月21日中国证监会规定媒介和基金管理人网站（<http://www.ccbfund.cn>）上的《关于建信鑫丰回报灵活配置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2021年4月22日至2021年5月31日止对除锁定期股票、存出保证金及应收利息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、基金托管人中国民生银行股份有限公司、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于2021年4月22日组成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：建信鑫丰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：2015年6月16日

4、投资目标：力争每年获得较高的绝对回报。

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，力争长期、稳定的绝对回报。

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、股指期货投资策略和权证投资策略四部分组成。

6、业绩比较基准：6%/年。

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：中国民生银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年4月21日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2021 年 4 月 21 日（基金最后运作日） |
|----------|------------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 13,890,739.93 |
| 存出保证金 | 224,781.53 |
| 交易性金融资产 | 1,378,088.09 |
| 其中：股票投资 | 1,378,088.09 |
| 应收利息 | 23,158.87 |
| 应收申购款 | 119.83 |
| 资产总计 | 15,516,888.25 |
| 负债和所有者权益 | |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | |
| 应付托管费 | |
| 应付交易费用 | 437.85 |
| 其他负债 | |

| | |
|------------|----------------------|
| 负债合计 | 437.85 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 12,879,182.29 |
| 未分配利润 | 2,637,268.11 |
| 所有者权益合计 | 15,516,450.40 |
| 负债和所有者权益总计 | 15,516,888.25 |

注：报告截止日 2021 年 4 月 21 日（基金最后运作日），基金份额总额 12,879,182.29 份，建信鑫丰回报灵活配置混合 A 份额 12,861,780.08 份，基金份额净值 1.2048 元。建信鑫丰回报灵活配置混合 C 份额 17,402.21 份，基金份额净值 1.1939 元。

四、清盘事项说明

1、基本情况

建信鑫丰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”）2015 年 5 月 25 日证监许可[2015]988 号文注册，由建信基金管理有限责任公司于 2015 年 6 月 8 日至 2015 年 6 月 12 日向社会公开募集，基金合同于 2015 年 6 月 16 日生效。首次设立募集规模为 632,657,955.89 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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、中期票据、短期融资券）、股指期货、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%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-100%，其中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股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年

以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、清算原因

本基金基金份额持有人大会于 2021 年 4 月 20 日表决通过了《关于终止建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

3、清算起始日

根据《关于建信鑫丰回报灵活配置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 2021 年 4 月 22 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《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呈报建信鑫丰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相关数据列示。

五、清算情况

自 2021 年 4 月 22 日起至 2021 年 5 月 31 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《建信鑫丰回报灵活配置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”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交易单元佣金外，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) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 224,781.53 元。清算期间共减

少存出保证金人民币 21,805.99 元，其中上海存出保证金划入基金托管账户人民币 11,504.11 元，深圳存出保证金划入基金托管账户人民币 10,301.88 元，截至 2021 年 5 月 31 日存出保证金余额为人民币 202,975.54 元。

(2) 本基金最后运作日持有交易性金融资产人民币 1,378,088.09 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卖出，并产生应收证券清算款人民币 1,073,695.27 元，该款项已于 2021 年 5 月 31 日前划入基金托管账户。截至 2021 年 5 月 31 日，本基金仍持有锁定期限售股票人民币 55,875.20 元。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 23,158.87 元，其中银行存款利息为 22,789.75 元，上海备付金利息为人民币 11.52 元，上海保证金利息为人民币 169.36 元，深圳保证金利息为人民币 188.24 元。截至 2021 年 5 月 31 日，应收利息为人民币 29,148.80 元，其中银行存款利息为 28,399.53 元，上海备付金利息为人民币 11.52 元，上海保证金利息为人民币 366.21 元，深圳保证金利息为人民币 371.54 元。

(4) 本基金最后运作日应收申购款人民币 119.83 元，该款项于 2021 年 4 月 22 日划入基金托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 437.85 元，清算期间增加应付交易费用人民币 980.34 元，截至 2021 年 5 月 31 日，应付交易费用余额为人民币 1,418.19 元。

4、清算日的清算损益情况

单位：人民币元

| | 自 2021 年 4 月 22 日起 至 2021 年 5 月 31 日止的清算期间 |
|----------------------|---|
| 一、清算收益 | |
| 利息收入-银行存款利息收入（注 1） | 5,989.93 |
| 股利收入 | 376.80 |
| 处置交易性金融资产产生的净收益（注 2） | -247,347.49 |
| 其他收入（注 3） | 10.07 |
| 清算收入小计 | -240,970.69 |
| 二、清算费用 | |
| 银行汇划费用（注 4） | 5.00 |
| 交易费用（注 5） | 2,150.47 |
| 清算费用小计 | 2,155.47 |
| 三、清算净收益 | -243,126.16 |

注 1：利息收入系计提的自 2021 年 4 月 22 日起至 2021 年 5 月 31 日止清算期间的银行活期存款利息和存出保证金利息。

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后的差额。

注 3：其他收入系 4 月 22 日确认的赎回费归资产所产生的收入。

注 4：银行汇划费用系清算期间产生的银行划款手续费。

注 5：交易费用系清算期间卖出股票所产生的交易单元佣金费用和交易所交易费用。

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

建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金 A

| 项目 | 金额 |
|------------------------------|---------------|
| 一、最后运作日 2021 年 4 月 21 日基金净资产 | 15,495,674.08 |
| 加：清算期间收益 | -240,679.26 |
| 减：清算期间费用 | 2,152.86 |
| 加：2021 年 4 月 22 日确认的申购款 | 99.85 |
| 减：2021 年 4 月 22 日确认的赎回款 | 5,953.31 |
| 二、2021 年 5 月 31 日基金资产净值 | 15,246,988.50 |

建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金 C

| 项目 | 金额 |
|------------------------------|-----------|
| 一、最后运作日 2021 年 4 月 21 日基金净资产 | 20,776.32 |
| 加：清算期间收益 | -291.43 |
| 减：清算期间费用 | 2.61 |
| 减：2021 年 4 月 2 日确认的赎回款 | 2,014.26 |
| 二、2021 年 5 月 31 日基金资产净值 | 18,468.02 |

资产处置及负债清偿后，2021 年 5 月 31 日本基金剩余财产为人民币 15,265,456.52 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。本基金清算分配金额为剩余财产扣除尚未变现的股票资产、尚未退还的保证金及应收利息后的金额人民币 14,977,456.98 元，建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金 A 清算分配金额 14,959,337.38 元，建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金 C 清算分配金额 18,119.60 元。

本基金于 2021 年 5 月 31 日仍持有的锁定期限售股票，将在锁定期结束后变现卖出，变现资产及全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行再次分配。同时，基金管理人将以自有资金垫付未退还的保证金和应收利息，垫付资产及上述股票变现资产一同进行分配。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。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) 《建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 关于《建信鑫丰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。

建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2021年6月30日