

# 建信量化优享定期开放灵活配置混合型 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:中国光大银行股份有限公司

报告出具日期: 2022 年 12 月 23 日

报告公告日期: 2022 年 12 月 24 日

## 一、重要提示

建信量化优享定期开放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”)2018年1月18日证监许可[2018]154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《建信量化优享定期开放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《建信量化优享定期开放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——中国光大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《关于终止建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会表决投票时间自2022年10月31日起，至2022年11月15日17:00时止。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2022年11月18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11月17日中国证监会规定媒介和基金管理人网站（<http://www.ccbfund.cn>）上的《关于建信量化优享定期开放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》。

本基金清算期为32个自然日，自2022年11月18日起至2022年12月19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：建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金。
- 2、基金运作方式：契约型、定期开放式。

3、《基金合同》生效日：2018年8月24日。

4、投资目标：本基金在严格控制风险并保持资产流动性的前提下，充分利用量化投资策略，力争为投资者提供持续、稳定的回报。

5、投资策略：

(1) 封闭期投资策略

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；然后，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、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略五个部分组成。

(2) 开放运作期投资策略

开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。

6、业绩比较基准： $50\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 50\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

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，属于中高预期收益/预期风险特征的基金。

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：建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年11月17日

单位：人民币元

资产	本期末 2022 年 11 月 17 日（基金最后运作日）
资产：	
银行存款	2,715,926.43
结算备付金	17,681,705.07
存出保证金	2,301.21
证券清算款	10,000,612.33
资产总计	30,400,545.04

负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	160,233.92
其他负债	67,347.68
负债合计	227,581.60
所有者权益：	
实收基金	21,299,617.72
未分配利润	8,873,345.72
所有者权益合计	30,172,963.44
负债和所有者权益总计	30,400,545.04

注：报告截止日 2022 年 11 月 17 日（基金最后运作日），基金份额总额 21,299,617.72 份，基金份额净值 1.4166 元。

## 四、清盘事项说明

### 1、基本情况

建信量化优享定期开放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”）2018 年 1 月 18 日证监许可[2018]154 号文注册募集，由建信基金管理有限责任公司于 2018 年 7 月 16 日至 2018 年 8 月 22 日向社会公开募集，《基金合同》于 2018 年 8 月 24 日生效。首次设立募集规模为 212,984,224.63 份基金份额。

本基金运作方式为契约型、定期开放式。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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要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（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、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、可交换债、中期票据、短期融资券）、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、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：封闭期内，本基金投资于股票资产的比例为 0~100%；开放期内，投资于股票资产的比例则为 0~95%。开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，封闭期可不受上

述 5%的比例限制。在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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 2022 年 11 月 16 日表决通过了《关于终止建信量化优享定期开放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《关于建信量化优享定期开放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 2022 年 11 月 18 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量化优享定期开放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 2022 年 11 月 18 日起至 2022 年 12 月 19 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《建信量化优享定期开放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财产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) 本基金最后运作日银行存款为人民币 2,715,926.43 元，其中包含应计利息人民币 2,143.09 元。清算期间，银行存款共计提利息人民币 19,121.69 元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币 29,892,656.26 元，其中应计银行存款利息余额为人民币 21,264.78 元。该款项将由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，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。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 17,681,705.07 元，其中上海结算备付金为人民币 256,250.00 元，应计上海结算备付金利息为人民币 520.06 元。应计深圳结算备付金利息为人民币 9.68 元。期货结算备付金为人民币 17,403,743.23 元，应计期货结算备付金利息为人民币 21,182.10 元。清算期间，上海结算备付金共计提利息人民币 334.4 元。截至清算期结束日，结算备付金余额为人民币 214,500.50 元。期货结算备付金人民币 17,403,743.23 元已于 2022 年 11 月 18 日划入托管账户；应计期货结算备付金利息人民币 21,182.10 元已于 2022 年 11 月 21 日划入托管账户。该款项将由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，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) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 2,301.21 元，其中上海存出保证金为人民币 1,254.00 元，上海存出保证金应计利息为人民币 3.06 元；深圳存出保证金为人民币 1,042.09 元，深圳存出保证金应计利息为人民币 2.06 元。清算期间上海存出保证金账户计提利息人民币 0.84 元，深圳存出保证金账户计提利息人民币 0.7 元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币 6.66 元，存出保证金人民币 2,296.09 元已于 2022 年 12 月 2 日划入托管账户。该款项将由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，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。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 10,000,612.33 元，已于清算期间划入托管账户。

## 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日其他负债为人民币 67,347.68 元，应付审计费人民币 65,000.00 元；应付账户维护费人民币 2,347.68 元，上述款项已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 160,233.92 元，该款项已于清算期间从本基金托管账户划付给基金份额持有人。

#### 4、清算日的清算损益情况

单位：人民币元

	自 2022 年 11 月 18 日起 至 2022 年 12 月 19 日止的清算期间
一、清算收益	
利息收入（注 1）	19,914.68
其他收入（注 2）	4.50
清算收入小计	19,919.18
二、清算费用	
清算费用小计	652.32
其他费用（注 3）	652.32
三、清算净收益	19,266.86

注 1：利息收入包括银行活期存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息、直销申购款利息。

注 2：其他收入系基金赎回和转出业务产生的归属于基金财产的赎回费和补差费。

注 3：其他费用为账户维护费。

#### 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

建信量化优享定期开放混合(基金代码：004546)

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 11 月 17 日基金净资产	30,172,963.44
加：清算期间收益	19,919.18
加：2022 年 11 月 18 日确认的应收申购款	9.99
减：清算期间费用	652.32
减：2022 年 11 月 18 日确认的应付赎回款	85,076.87
二、2022 年 12 月 19 日基金资产净值	30,107,163.42

注：资产处置及负债清偿后，2022 年 12 月 19 日本基金剩余财产为人民币

30,107,163.42 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。

基金管理人建信基金管理有限责任公司以自有资金垫付人民币 235,764.83 元（包括本基金清算期末应收利息人民币 21,264.78 元，结算备付金人民币 214,500.05 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)《建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2)上海市通力律师事务所关于《建信量化优享定期开放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。

建信量化优享定期开放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 23 日

报告公告日期：2022 年 12 月 24 日