

兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：兴银基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年9月22日

清算报告公告日：2023年9月26日

一、重要提示

兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金(原名“华福大健康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证监许可(2015)1615号注册募集。《华福大健康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年8月27日正式生效。根据2017年3月30日《兴银基金管理有限责任公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华福大健康灵活配置混合型证券投资基金自2017年4月5日起更名为兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金首次募集规模为人民币534,705,888.33份基金份额。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：(二)决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：(二)基金份额持有人大会决定终止”。根据《兴银大健康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》”或“基金合同”)第十九部分约定，“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”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议了《关于终止兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，议案于2023年8月28日表决通过，并自该日起本次基金份额持有人大会决定的事项生效，详见基金管理人于2023年8月29日刊登在《上海证券报》和基金管理人官网(www.hffunds.cn)的《关于兴银大健康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》。

本基金最后运作日为2023年8月28日，自2023年8月29日起进入清算程序，清算期间为自2023年8月29日至2023年9月5日止。基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2023年8月29日成立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)对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、基金概况

| | |
|----------------------------|---|
| 基金名称 | 兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 兴银大健康 |
| 基金主代码 | 001730 |
| 交易代码 | 001730 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年08月27日 |
| 最后运作日（2023-8-28） 基金份额总额 | 9,012,954.97份 |
| 投资目标 | 本基金为混合型基金，主要投资于大健康相关产业，在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。 |
| 业绩比较基准 | 中证健康产业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。 |
| 基金管理人 | 兴银基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2015]1615号文准予注册，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2015年8月10日至2015年8月21日向社会公开募集。基金合同于2015年8月27日起正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为534,705,888.33份（含募集期间利息结转的份额）。根据2017年3月30日兴银基金管理有限责任公司于公司网站上公示的《兴银基金管理有限责任公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华福大健康灵活配置混合型证券投资基金自2017年4月5日起更名为兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金。本

基金为契约型开放式基金，存续期限不定。自 2015 年 8 月 27 日至 2023 年 8 月 28 日本基金按基金合同约定正常运作。

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》、《兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，经本基金份额持有人大会 2023 年 8 月 28 日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。详见基金管理人于 2023 年 8 月 29 日刊登在《上海证券报》和基金管理人官网（www.hffunds.cn）的《关于兴银大健康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》，本基金最后运作日为 2023 年 8 月 28 日，本基金从 2023 年 8 月 29 日起进入清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

四、财务会计报告

1、清算期间

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金

清算资产负债表（经审计）

单位：人民币元

| 项目 | 2023 年 8 月 28 日 (最后运作日) |
|-------------|----------------------------|
| 资 产: | |
| 银行存款 | 7,665,628.45 |
| 结算备付金 | 3,255.69 |
| 存出保证金 | 7,724.09 |
| 股票投资 | 1,032.00 |
| 应计利息 | 5,125.68 |
| 资产总计 | 7,682,765.91 |
| 负 债: | |
| 应付赎回款 | 247,755.60 |
| 应付赎回费 | 43.42 |
| 应付管理人报酬 | 9,794.58 |
| 应付托管费 | 1,632.44 |
| 应付交易费用 | 9,497.05 |

| | |
|-------------------|---------------------|
| 其他应付款 | 10.00 |
| 负债合计 | 268,733.09 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 9,012,954.97 |
| 未分配利润 | -1,598,922.15 |
| 所有者权益合计 | 7,414,032.82 |
| 负债与所有者权益总计 | 7,682,765.91 |

注：

- 1、本基金最后运作日 2023 年 8 月 28 日，基金份额总额 9,012,954.97 份。
- 2、本基金截至最后运作日的财务报表以清算基础编制。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

五、清算情况

自 2023 年 8 月 29 日至 2023 年 9 月 5 日止为清算期间，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、根据《关于兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金清算期间终止办理赎回业务的提示性公告》，本基金自 2023 年 8 月 29 日起，停止收取基金管理费、基金托管费。

2、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，按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

3、资产处置情况

（1）本基金最后运作日银行存款 7,665,628.45 元，存储于基金托管人兴业银行股份有限公司；

（2）本基金最后运作日结算备付金 3,255.69 元，已于 2023 年 9 月 8 日全部到账；

（3）本基金最后运作日存出保证金 7,724.09 元，将于 2023 年 10 月 10 日全部到账；

（4）本基金最后运作日股票投资 1,032.00 元，其中劲仔食品已于 2023 年 8 月 29 日全部卖出，已于清算期间全部处置变现；

（5）本基金最后运作日应收利息为人民币 5,125.68 元，包含应收银行活期存款利息人民币 5,066.45 元、应收备付金利息人民币 39.97 元、应收保证金利息人民币 19.26 元，于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将根据清算款划出日期实际情况需要以自有资金先行垫付尚未收讫的利息（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）。

4、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款 247,755.60 元, 应付赎回费 43.42, 该款项已于 2023 年 8 月 30 日全额支付;

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬 9,794.58 元, 该款项已于 2023 年 9 月 5 日支付;

(3) 本基金最后运作日应付托管费 1,632.44 元, 该款项已于 2023 年 9 月 5 日支付;

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为 9,497.05 元, 该笔费用为佣金费用, 该款项已于 2023 年 9 月 14 日支付;

(5) 本基金最后运作日其他应付款 10.00 元, 均为银行汇划费, 该款项已于 2023 年 9 月 1 日支付。

5、清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

| 项目 | 自 2023 年 8 月 29 日至 2023 年 9 月 5 日止清算期间 |
|----------------|--|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入 | 580.51 |
| 2、差价收入 | -322.81 |
| 3、公允价值变动 | 330.44 |
| 4、赎回费收入 | 5.97 |
| 清算收入小计 | 594.11 |
| 二、清算费用 | |
| 1、银行汇划费 | 5.00 |
| 清算费用小计 | 5.00 |
| 三、清算净收益 | 589.11 |

注:

- 1、利息收入是清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息;
- 2、差价收入是清算期间股票投资变现的差价收入;
- 3、公允价值变动损益是清算期间持有的股票投资产生的公允价值变动;
- 4、银行汇划费是清算期间支付各类费用产生的银行汇划费。

6、剩余财产分配

单位：人民币元

| 项目 | 金额 |
|--|--------------|
| 一、最后运作日 2023 年 8 月 28 日基金净资产 | 7,414,032.82 |
| 加：清算期间净收益 | 589.11 |
| 减：基金净赎回转出金额（于 2023 年 8 月 29 日确认的投资者赎回转出申请） | 8,349.75 |
| 二、清算结束日 2023 年 9 月 5 日基金净资产 | 7,406,272.18 |

根据本基金基金合同的约定，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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

截至本基金清算报告期结束日 2023 年 9 月 5 日，本基金剩余财产为人民币 7,406,272.18 元。自清算报告期结束日次日（2023 年 9 月 6 日）至本次清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。

7、本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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 《兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《关于<兴银大健康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

基金管理人处。

3、查阅方式

- (1) 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。
- (2) 投资者可访问基金管理人公司网站（www.hffunds.cn）查阅。

兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组
2023 年 9 月 22 日

兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金清算报告签署页

兴银基金管理有限责任公司（盖章）

授权代表（签字）

兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金清算报告签署页

兴业银行股份有限公司（盖章）

授权代表（签字）