

建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资 基金（LOF）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:中国银行股份有限公司

报告出具日期: 2023 年 9 月 21 日

报告公告日期: 2023 年 10 月 12 日

一、重要提示

建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)由建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来,原基金经中国证监会《关于准予建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2016】1669号)注册,于2016年9月29日成立,并于2018年2月27日转型为本基金。基金托管人为中国银行股份有限公司。

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《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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《关于建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。基金份额持有人大会表决投票时间自2023年7月26日起,至2023年8月25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2023年8月30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2023年8月29日刊登在中国证监会规定媒介和基金管理人网站(<http://www.ccbfund.cn>)上的《关于建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金清算期自2023年8月30日起至2023年9月15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:建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。
- 2、基金运作方式:契约型开放式。
- 3、《基金合同》生效日:2018年2月27日。
- 4、投资目标:本基金主要在对公司股票投资价值的长期跟踪和深入分析的

基础上，利用多策略挖掘和把握国内经济结构调整和升级的大背景下的投资机会，力争基金资产的长期稳定增值。

5、投资策略：

（一）类别资产配置策略

本基金将按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置。

本基金将综合考量宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及国家财政、税收、货币、汇率各项政策，来动态调整大类资产的配置比例。

（二）股票投资策略

基金管理人通过“自上而下”和“自下而上”相结合的投资思路和定性分析与定量分析相佐证的分析方法，审慎制定投资方案。本基金采用多策略，包括：

（1）股东增持与回购策略

股份增持包括股东增持和高管增持，其中股东增持是指公司股东及其一致行动人增持股份行为；高管增持是指公司高管及其一致行动人增持股份的行为；股份回购是指公司按一定的程序购回发行或流通在外的本公司股份的行为。公司股权的变动不仅仅直接改变公司的资产结构，同时也会对企业未来在生产、经营、管理等多个方面产生影响。本基金通过定性和定量方法对股权变动可能带来的影响进行模拟分析，挑选具有绝对或相对估值吸引力的公司股票，再通过分析和评估股权变化，结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

（2）超预期业绩预告策略

超预期业绩预告是指公司披露的实际业绩显著超越过去 3 个月券商等研究机构的预测平均数的情况。此两种情况都显示公司经营上出现显著变化，本基金将通过筛选与分析业绩变化情况，自下而上评估，结合公司基本面情况，择优选取成长性好，安全边际高的公司进行投资。

（3）资产重组，包括重组、注入与并购策略

资产重组是企业与其他主体对企业资产的分布状态进行重新组合、调整、配置的过程，或对设在企业资产上的权利进行重新配置的过程。重组前后公司的估值往往会有明显的改变。

本基金在市场上收集公开的信息，对影响中的公司进行分析与估值，挑选具有吸引力的公司股票。

（4）定增策略

基金管理人通过“自上而下”和“自下而上”相结合的投资思路和定性分析与定量分析相佐证的分析方法，立足于上市公司的定增行为对上市公司估值重构、盈利提升的影响、上市公司市值管理需要、市场情绪特征、宏观经济环境等多方面的因素综合判断，把握定增事件的二级市场联动效应，审慎制定参与二级市场投资交易的投资方案。

（5）高分红及高转送策略

分红指公司以现金分红方式将盈余公积和当期应付利润的部分或全部发放给股东，是股东分享公司红利的重要方式，高分红是指公司分红比例较高的股票。高转送是实施较高比例的送股或者转股的股票。

本基金将通过筛选、分析和评估高分红，高转送股票；结合预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

（6）股权激励策略

股权激励包括员工持股、股票期权等不同形式，使企业经营者与所有者利益一致，利润与风险共担，起到改善公司治理，提升公司运营效率的作用。

本基金将对采用股权激励的公司进行调研，综合分析公司基本面、预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

（7）其他

其他包括但不限于公司发布对预期业绩及行业造成极大影响的重要产品或重大合同公告；有影响上下游公司的重大事项发生；公司遭遇重大危机；管理层发生重大变更等。此类事件会对公司的运营造成深远的影响，继而影响其市场估值。

本基金将通过筛选、分析和评估发生重大变动的股票，结合其预期盈利水平和成长潜力，择优选取安全边际较高、成长性较好的公司进行投资。

本基金可投资存托凭证，本基金将结合宏观经济状况、市场估值、发行人基本面情况等因素，通过定性分析和定量分析相结合的办法，精选出具有比较优势的存托凭证进行投资。

（三）股指期货投资策略

本基金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，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

（四）债券投资策略

根据流动性管理、资产配置等需要，本基金将进行国债、金融债、企业债等固定收益类证券的投资。债券投资策略包括利率策略、信用策略、久期策略等，由相关领域的专业研究人员提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略。

（五）权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

（六）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、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析、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，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

6、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率（全价）×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：建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 8 月 29 日

单位：人民币元

资产	本期末 2023 年 8 月 29 日（基金最后运作日）
资产：	

银行存款	51,707,418.15
结算备付金	9,914.87
存出保证金	14,449.88
资产总计	51,731,782.90
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	77,052.94
应付管理人报酬	55,422.41
应付托管费	9,237.07
其他负债	125,131.30
负债合计	266,843.72
净资产：	
实收基金	38,360,360.20
未分配利润	13,104,578.98
所有者权益合计	51,464,939.18
负债和所有者权益总计	51,731,782.90

注：报告截止日 2023 年 8 月 29 日（基金最后运作日），基金份额总额 38,360,360.20 份，基金份额净值 1.3416 元。

四、清盘事项说明

1、基本情况

建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)由建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来,原基金经中国证监会《关于准予建信丰裕定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可【2016】1669号)注册募集,由建信基金管理有限责任公司于2016年8月15日至2016年9月22日向社会公开募集,《基金合同》于2016年9月29日生效。原基金首次设立募集规模为640,857,885.49份基金份额。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深圳证券交易所深证上[2017]635号核准,原基金于2017年10月13日在深交所挂牌交易。原基金于2018年2月27日转型为本基金。

本基金运作方式为契约型开放式。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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含主板、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等)、债券(包括国债、金融债、

企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、次级债等）、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、股指期货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）。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

在封闭期，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-100%；开放运作后，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，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以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%。

2、清算原因

本基金基金份额持有人大会于 2023 年 8 月 28 日表决通过了《关于建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。

3、清算起始日

根据《关于建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 2023 年 8 月 30 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丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 2023 年 8 月 30 日起至 2023 年 9 月 15 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《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节的规定，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 51,707,418.15 元，其中包含应计利息人民币 18,198.87 元。清算期间，银行存款共计提利息人民币 8,487.29 元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币 51,249,920.22 元，其中应计银行存款利息余额为人民币 26,686.16 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 9,914.87 元，其中上海结算备付金为人民币 5,474.56 元，应计上海结算备付金利息为人民币 5.50 元；深圳结算备付金为人民币 4,426.42 元，应计深圳结算备付金利息为人民币 8.39 元。清算期间上海结算备付金减少人民币 5,474.56 元，上海结算备付金计提利息为人民币 2.25 元；深圳结算备付金减少人民币 4,426.42 元，深圳结算备付金计提利息为人民币 1.80 元。截至清算期结束日，结算备付金为人民币 17.94 元，其中应计上海结算备付金利息为人民币 7.75 元，应计深圳结算备付金利息为人民币 10.19 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。

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币 14,449.88 元，其中上海存出保证金为人民币 8,876.63 元，应计上海存出保证金利息为人民币 18.47 元；深圳存出保证金为人民币 5,542.96 元，应计深圳存出保证金利息为人民币 11.82 元。清算期间上海存出保证金减少人民币 1,088.26 元，上海存出保证金计提利息为人民

币 6.20 元；深圳存出保证金减少人民币 654.28 元，深圳存出保证金计提利息为人民币 3.89 元。截至清算期结束日，存出保证金为人民币 12,717.43 元，其中上海存出保证金为人民币 7,788.37 元，应计上海存出保证金利息为人民币 24.67 元；深圳存出保证金为人民币 4,888.68 元，应计深圳存出保证金利息为人民币 15.71 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。

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 77,052.94 元，清算期间产生应付赎回款为人民币 210,317.13 元，该款项已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 55,422.41 元，该款项已于清算期间支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 9,237.07 元，该款项已于清算期间支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 125,131.30 元，其中应付赎回费为人民币 116.71 元，预提审计费为人民币 55,000.00 元，预提信披费为人民币 33,014.59 元，预提公证费为人民币 12,000.00 元，预提律师费为人民币 25,000.00 元。清算期间产生应付赎回费为人民币 347.89 元，上述款项均已于清算期间支付。

4、 清算日的清算损益情况

单位：人民币元

	自 2023 年 8 月 30 日起 至 2023 年 9 月 15 日止的清算期间
一、清算收益	
利息收入（注 1）	8,501.43
其他收入（注 2）	201.15
清算收入小计	8,702.58
二、清算费用	
银行手续费	120.00
清算费用小计（注 3）	120.00
三、清算净收益	8,582.58

注 1：利息收入系计提的自 2023 年 8 月 30 日至 2023 年 9 月 15 日止清算期

间的银行存款利息、结算备付金及存出保证金利息。

注 2：其他收入为赎回费收入。

注 3：按照《基金合同》“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”章节的规定，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，与本基金的清算相关的清算费用将由基金管理人代为支付。

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

建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 8 月 29 日基金净资产	51,464,939.18
加：清算期间净收益	8,582.58
减：2023 年 8 月 30 日确认的应付赎回款	210,866.17
二、2023 年 9 月 15 日基金资产净值	51,262,655.59

注：资产处置及负债清偿后，2023 年 9 月 15 日（清算结束日）本基金剩余财产为人民币 51,262,655.59 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)《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)清算审计报告》;
- (2)上海市通力律师事务所关于《建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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。

建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金财产清算小组

报告出具日期：2023年9月21日

报告公告日期：2023年10月12日