

建信鑫悦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:兴业银行股份有限公司

报告出具日期: 2018 年 4 月 27 日

报告公告日期: 2018 年 6 月 26 日

一、重要提示

建信鑫悦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”)证监许可[2016]2600号《关于准予建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,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《建信鑫悦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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《建信鑫悦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”或“《基金合同》”)的有关规定:“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 万元的,基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的,基金管理人将根据基金合同第十九部分的约定进行清算并终止,而无需召开基金份额持有人大会”。截至 2018 年 4 月 2 日,本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。为维护基金份额持有人利益,根据基金合同约定,本基金满足基金合同终止条件,于 2018 年 4 月 3 日进入财产清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见刊登在 2018 年 4 月 3 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站

(<http://www.ccbfund.cn>)上的《关于建信鑫悦回报灵活配置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》。

本基金清算期为 19 个工作日,自 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 4 月 27 日止。由基金管理人建信基金管理有限责任公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于 2018 年 4 月 3 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(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：建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：建信鑫悦回报灵活配置混合，基金代码：003830）。

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2016年12月02日

4、投资目标：在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、债券等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。

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，力求实现基金资产的持续稳定增值。

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、国债期货投资策略和权证投资策略六部分组成。

6、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50% +中债综合指数（全价）收益率×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：兴业银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年4月2日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年4月2日 (基金最后运作日)
-----	-------------------------------

资产：	
银行存款	4,774,484.98
存出保证金	73,446.03
应收利息	3,067.33
应收申购款	-
资产总计	4,850,998.34
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	4,671,082.55
应付管理人报酬	1.40
应付托管费	0.24
应付销售服务费	0.24
其他负债	137,015.00
负债合计	4,808,099.43
所有者权益：	
实收基金	36,709.49
未分配利润	6,189.42
所有者权益合计	42,898.91
负债和所有者权益总计	4,850,998.34

注：

1. 报告截止日 2018 年 4 月 2 日（基金最后运作日），基金份额总额 36,709.49 份。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 4 月 2 日(基金最后运作日)。

四、清盘事项说明

1、基本情况

建信鑫悦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”)证监许可[2016]2600号《关于准予建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，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《建信鑫悦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。本基金为契约型开放式，存续期限不定，经向中国证监会备案，《建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 500,117,450.00 份，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》和《建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有较好流动性的金融工具，包括包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中

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、可交换债券、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、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。本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%,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,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%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 X 50% + 中债综合指数(全价)收益率 X 50%。

根据《建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及建信基金管理有限责任公司于 2018 年 4 月 3 日发布的《关于建信鑫悦回报灵活配置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》,自 2018 年 4 月 3 日起,本基金进入基金财产清算期,基金管理人已依据相关法律法规和本基金基金合同的规定,组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

2、清算原因

当连续 60 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,符合基金合同约定的基金合同终止条件。

根据基金合同规定基金合同终止,进入清算程序。

3、清算起始日

根据《关于建信鑫悦回报灵活配置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》,本基金清算起始日为 2018 年 4 月 3 日。

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。自本基金最后运作日起,资产、负债均按清算价格计价。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 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 4 月 27 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《建信鑫悦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外，自清盘起始日起，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) 本基金最后运作日应收利息人民币 3,067.33 元，该款项由基金管理人建信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 4 月 16 日划入托管账户。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。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币 73,446.03 元，是由中国证券登记结算公司上海分公司和深圳分公司收取并保管的结算保证金。其中 10,244.25 元于 2018 年 4 月 3 日返还至本基金账户，其余 63,201.78 元由基金管理人建信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 4 月 16 日划入托管账户。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。

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 4,671,082.55 元，该款项已于 2018 年 4 月 3 日支付；另 2018 年 4 月 3 日有一笔赎回确认，应付赎回款金额为 23.37 元，该款项已于 2018 年 4 月 9 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1.40 元，该款项已于 2018 年 4 月 16 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 0.24 元，该款项已于 2018 年 4 月 16 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0.24 元，该款项已于 2018 年 4 月 16 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 137,015.00 元，预提审计费用 137,000.00 元已于 2018 年 4 月 16 日进行了支付，预提银行划款手续费 15.00 元将于 2018 年 5 月 2 日进行支付。

4、清算日的清算损益情况

单位：人民币元
自 2018 年 4 月 3 日至
2018 年 4 月 27 日
止清算期间

项目	
一、清算收益	
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	59.80
利息收入-结算保证金利息收入（注 2）	71.25
清算收入小计	131.05
二、清算费用	
银行划款手续费（注 3）	128.42
清算费用小计	128.42
三、清算净收益	2.63

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 4 月 27 日止清算期间的银行存款利息。

注 2：利息收入系计提的自 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 4 月 27 日止清算期间的结算保证金利息。

注 3：经本基金管理人建信基金管理有限责任公司确认，除银行直接扣付的划款手续费外，自清盘起始日起，与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

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

建信鑫悦回报灵活配置混合（基金代码：003830）

项 目	金 额
一、最后运作日 2018 年 4 月 2 日基金净资产	42,898.91
加：清算期间收益	131.05
减：清算期间费用	128.42
减：2018 年 4 月 3 日确认的应付赎回款	23.37
二、2018 年 4 月 27 日基金资产净值	42,878.17

注：资产处置及负债清偿后，2018 年 4 月 27 日本基金剩余财产为人民币 42,878.17 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。

基金管理人建信基金管理有限责任公司以自有资金垫付应收结算保证金人民币 63,201.78 元，应收利息人民币 3,198.38 元（包括本基金最后运作日应收利息人民币 3,067.33 元和清算期间利息收入 131.05 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) 《建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《建信鑫悦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。

建信鑫悦回报灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2018 年 6 月 26 日