

## 财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：财通基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告编制日期：二零二壹年四月二十三日

报告送出日期：二零二壹年五月十五日

## 一、重要提示

财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2018]57号《关于准予财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由财通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)负责公开募集。本基金的基金管理人为财通基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:

“本基金合同生效三年后的对应日所处开放期的最后一个工作日,若本基金资产净值低于两亿元,本基金合同自动终止,且无需召开基金份额持有人大会审议。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充时,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”本基金《基金合同》生效三年后的对应日所处开放期的最后一个工作日为2021年4月9日,截至2021年4月9日日终,本基金基金资产净值低于两亿元,满足《基金合同》约定的前述终止条件,本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序,而不需召开基金份额持有人大会。

本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见本基金基金管理人于2021年4月10日披露的《关于财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金清算期自2021年4月10日起至2021年4月23日止,由基金管理人财通基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所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,上海源泰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：财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

2、基金简称：财通福佑定开混合发起

3、基金代码：501055

4、基金运作方式：契约型、定期开放。本基金以定期开放方式运作，即本基金在一定期间内封闭运作，不接受基金的申购、赎回；在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本基金的申购、赎回等申请。

5、基金合同生效日：2018年4月8日

6、基金管理人：财通基金管理有限公司

7、基金托管人：中国农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：财通基金管理有限公司

报告截止日：2021年4月9日

单位：人民币元

资产	2021年4月9日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	22,431,015.70
存出保证金	54,258.75
交易性金融资产	10,298,821.78
应收利息	10,650.15
应收申购款	11,835.94
资产总计	32,806,582.32
负债：	
应付赎回款	595,627.71

应付管理人报酬	12,800.85
应付托管费	2,133.47
应付交易费用	147,766.48
其他负债	242,948.23
负债合计	1,001,276.74
所有者权益：	-
实收基金	20,514,185.69
未分配利润	11,291,119.89
所有者权益合计	31,805,305.58
负债和所有者权益总计	32,806,582.32

注：报告截止日 2021 年 4 月 9 日（基金最后运作日），基金份额净值 1.5504 元，基金份额总额 20,514,185.69 份。

#### 四、清盘事项说明

##### 1、基本情况

财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2018]57 号《关于准予财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由财通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》负责公开募集。本基金《基金合同》于 2018 年 4 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 72,241,485.60 份（含募集期间认购资金利息结转份额）。本基金为契约型、定期开放基金，存续期限不定，本基金的基金管理人为财通基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农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《基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:封闭期内,本基金投资于股票(含存托凭证)资产的比例为0~100%;开放期内,投资于股票(含存托凭证)资产的比例则为0~95%。开放期内,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,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。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率 $\times$ 55%+上证国债指数收益率 $\times$ 45%

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:

“本基金合同生效三年后的对应日所处开放期的最后一个工作日,若本基金资产净值低于两亿元,本基金合同自动终止,且无需召开基金份额持有人大会审议。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充时,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

## 2、清算原因

本基金《基金合同》生效三年后的对应日所处开放期的最后一个工作日为2021年4月9日,截至2021年4月9日日终,本基金基金资产净值低于两亿元,满足《基金合同》约定的前述终止条件,本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序,而不需召开基金份额持有人大会。

## 3、清算起始日

根据《基金合同》约定及《关于财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式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2021年4月10日。

由于本基金持有的流通受限股票无法确定变现时间，本基金计划将进行两次清算，其中第一次清算期间为 2021 年 4 月 10 日至 2021 年 4 月 23 日，本基金将于前述未变现资产全部变现后进入二次清算程序，并将清算后的全部剩余财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二次分配。

#### 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。于 2021 年 4 月 9 日(基金最后运作日)。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 10 日至 2021 年 4 月 23 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、资产处置情况

(1) 截至 2021 年 4 月 9 日银行存款为人民币 22,431,015.70 元。截至 2021 年 4 月 23 日银行存款为人民币 29,547,535.47 元，该活期银行存款存放于基金托管人中国农业银行股份有限公司。

(2) 截至 2021 年 4 月 9 日结算保证金为人民币 54,258.75 元。截至 2021 年 4 月 23 日结算保证金为人民币 54,258.75 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司分别收取并保管。

(3) 截至 2021 年 4 月 9 日股票投资为人民币 10,298,821.78 元。其中可变现的股票投资为人民币 8,160,530.74 元，限售期的股票投资为人民币 2,138,291.04 元。截至 2021 年 4 月 23 日股票投资为人民币 2,090,123.12 元，均为限售期股票。

截至 2021 年 4 月 23 日因新股限售而未能变现的流通受限股票，明细如下：

股票代码	股票名称	预计可流通日期	估值单价	数量 (单位: 股)	成本总额	估值总额
601995	中金公司	2021-05-06	51.94	24,951	718,089.78	1,295,954.94
300884	狄耐克	2021-05-12	39.87	324	8,057.88	12,917.88
300894	火星人	2021-07-01	51.93	545	7,668.15	28,301.85
300900	广联航空	2021-04-29	34.23	574	10,257.38	19,648.02
300902	国安达	2021-04-29	28.98	551	8,474.38	15,967.98
300907	康平科技	2021-05-18	31.28	473	6,763.9	14,795.44
300908	仲景食品	2021-05-23	71.93	153	6,080.22	11,005.29
300910	瑞丰新材	2021-05-27	90.65	217	6,566.42	19,671.05
300917	特发服务	2021-06-21	40.05	281	5,277.18	11,254.05
300918	南山智尚	2021-06-22	10.44	1,063	5,283.11	11,097.72
300920	润阳科技	2021-06-25	39.95	2,002	53,913.86	79,979.9
300922	天秦装备	2021-06-25	30.43	287	4,606.35	8,733.41
300925	法本信息	2021-06-30	33.43	293	5,883.44	9,794.99
300926	博俊科技	2021-07-07	23.95	359	3,862.84	8,598.05
300927	江天化学	2021-07-07	29.07	217	2,905.63	6,308.19
300929	华骐环保	2021-07-20	29.19	183	2,538.21	5,341.77
300930	屹通新材	2021-07-21	24.25	322	4,221.42	7,808.5
300931	通用电梯	2021-07-21	14.65	672	2,896.32	9,844.8
300933	中辰股份	2021-07-22	11.77	1,112	3,747.44	13,088.24
300937	药易购	2021-07-27	44.04	244	2,989.00	10,745.76
300940	南极光	2021-08-03	33.18	307	3,917.32	10,186.26
300941	创识科技	2021-08-09	52.29	280	5,966.8	14,641.2

300942	易瑞生物	2021-08-09	21.01	443	2,352.33	9,307.43
300943	春晖智控	2021-08-10	19.15	255	2,496.45	4,883.25
300945	曼卡龙	2021-08-10	15.16	474	2,161.44	7,185.84
300948	冠中生态	2021-08-25	29.41	216	2,808	6,352.56
300950	德固特	2021-09-03	32.89	219	1,841.79	7,202.91
300952	恒辉安防	2021-09-13	22.32	340	3,984.8	7,588.8
300953	震裕科技	2021-09-20	56.35	240	6,904.8	13,524
300956	英力股份	2021-09-27	21.31	371	4,767.35	7,906.01
300957	贝泰妮	2021-09-27	168.75	159	7,525.47	26,831.25
300958	建工修复	2021-09-29	23.44	300	2,559	7,032
300960	通业科技	2021-09-29	23.16	234	2,826.72	5,419.44
300961	深水海纳	2021-09-30	22.88	394	3,341.12	9,014.72
688183	生益电子	2021-08-25	14.01	6,131	76,147.02	85,895.31
688350	富淼科技	2021-07-28	19.07	2,552	34,656.16	48,666.64
688456	有研粉材	2021-09-17	22.32	3,396	36,065.52	75,798.72
688578	艾力斯	2021-06-02	26.47	2,795	63,530.35	73,983.65
688633	星球石墨	2021-09-24	45.05	1,506	50,631.72	67,845.30

根据《基金合同》第十五部分“基金资产估值”的约定，首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

由于交易性金融资产流通受限，因此基金管理人参考《证券投资基金投资流通受限股票估值指引》，在同一股票交易所估值价格基础上应用流动性折扣调整其估值。



待股票可流通后，基金管理人将及时变现流通股票，本基金将进入二次清算程序，并将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二次分配。

(4) 截至 2021 年 4 月 9 日应收利息为人民币 10,650.15 元。其中活期存款利息为人民币 10,627.67 元，结算保证金利息为人民币 22.48 元。截至 2021 年 4 月 23 日应收利息为人民币 17,364.93 元。其中活期存款利息为人民币 17,308.15 元，结算保证金利息为人民币 56.78 元。

(5) 截至 2021 年 4 月 9 日应收申购款为人民币 11,835.94 元。

## 2、负债清偿情况

(1) 截至 2021 年 4 月 9 日应付管理人报酬为人民币 12,800.85 元，该款项已于 2021 年 4 月 20 日支付。

(2) 截至 2021 年 4 月 9 日应付托管费为人民币 2,133.47 元，该款项已于 2021 年 4 月 20 日支付。

(3) 截至 2021 年 4 月 9 日应付交易费用为人民币 147,766.48 元，该款项已于 2021 年 4 月 13 日支付。截至 2021 年 4 月 23 日应付交易费用为人民币 5,858.99 元。该款项预计将于 2021 年 7 月 12 日支付。

(4) 截至 2021 年 4 月 9 日应付赎回款为人民币 595,627.71 元，该款项已于 2021 年 4 月 12 日支付。

(5) 截至 2021 年 4 月 9 日其他负债为人民币 242,948.23 元，其中应付审计费用为人民币 20,000.00 元待收到审计费发票后再行支付，应付律师费为人民币 20,000.00 元待收到律师费发票后再行支付，其他应付款 400.00 元为沪深股卡费用已于 2021 年 4 月 20 日支付，预提费用 202,548.23 元（其中预提 2020 年和 2021 年信息披露费用 152,548.23 元待收到上海证券报发票后再行支付，预提 2020 年和 2021 年审计费用共计 66,273.62 元，因 2021 年审计费不再由基金资产支付，预提的 16,273.62 已于 2021 年 4 月 9 日冲回基金资产。剩余 50,000.00 元已于 2021 年 4 月 23 日支付）。截至 2021 年 4 月 23 日预提费用为人民币 152,548.23 元。

### 3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项 目	自 2021 年 4 月 10 日至 2021 年 4 月 23 日止期间
一、清算收益	
1.利息收入	6,714.78
2.投资收益	1,065,512.09
3.公允价值投资损益	-1,211,892.18
清算收益小计	-139,665.31
二、清算费用	
1.交易费用	14,645.08
2.其他费用	0
清算费用小计	14,645.08
三、清算净收益	-154,310.39

### 4、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

项目	金 额
一、2021 年 4 月 9 日所有者权益	31,805,305.58
加：清算期间净收益	-154,310.39
减：基金净赎回金额	140,120.14
二、2021 年 4 月 23 日所有者权益	31,510,875.05

资产处置及负债清偿后，于 2021 年 4 月 23 日本基金可分配财产为人民币 29,249,128.25 元，根据账面银行存款（29,547,535.47）扣除负债合计（198,407.22）及预留款项（100,000.00）计算所得。根据本基金的《基金合同约定以及《关于财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，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。

本基金将于剩余资产变现后进行二次清算。

#### 5、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监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) 财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021年1月1日至2021年4月9日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告

(2) 关于《财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式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。

财通多策略福佑定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2021年4月23日