

建信量化事件驱动股票型证券投资基金 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:中国国际金融股份有限公司

报告出具日期: 2023 年 9 月 15 日

报告公告日期: 2023 年 9 月 20 日

一、重要提示

建信量化事件驱动股票型证券投资基金（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”）2017年5月15日证监许可[2017]708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《建信量化事件驱动股票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，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

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《建信量化事件驱动股票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——中国国际金融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《关于终止建信量化事件驱动股票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2023年8月1日起，至2023年8月27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《关于建信量化事件驱动股票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》。

本基金清算期自2023年8月30日起至2023年9月8日止。由基金管理人建信基金管理有限责任公司、基金托管人中国国际金融股份有限公司、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：建信量化事件驱动股票型证券投资基金。
- 2、基金运作方式：契约型开放式。
- 3、《基金合同》生效日：2017年9月13日。

4、投资目标：在严格控制风险的基础上，力争获取稳定、持续超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。

5、投资策略：

本基金在积极把握宏观经济变迁、证券市场变化以及证券市场参与各方行为逻辑的基础上，将影响行业和公司投资价值的事件性因素作为投资的主线，以事件驱动为核心的投资策略；并且采用多因子量化分析模型，综合技术、财务、情绪等多方面指标，深入分析事件性因素冲击的标的股票，精选受益于事件影响，具有超额收益的股票进行投资，优化调整投资组合，力争实现高于业绩基准的投资收益和基金资产的长期增值。

1、资产配置策略

本基金以追求基金资产收益长期增长为目标，根据宏观经济趋势、市场政策、资产估值水平、外围主要经济体宏观经济和资本市场的运行状况等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态配置，力争获得与所承担的风险相匹配的收益。

2、股票投资组合策略

一般来说，标的资产重大事件信息，会对标的资产的自身价值产生冲击，而事件冲击的效果最终都会通过标的资产的市场价值体现出来。因此，本基金采用量化的方式分析市场公开的各类重大事件对股票的影响，再结合多因子量化模型综合分析股票的投资价值和成长能力，确定投资组合。

1) 量化分析事件影响

本基金广泛收集市场公开的各类重大事件信息，量化分析不同事件对于股票市场价值的影响，具体的事件包括但不限于重大资产重组、股权激励、股权变动、业绩预告与超预期、高分红高送转及其他影响公司的重大事项，从而系统性地把握公司经营在资产结构、投融资、业绩、激励等方面的改变所带来的超额收益。随着资本市场的不断发展和影响上市公司相关事件的不断演变，本基金将采用量化的方法动态调整事件信息对于标的资产市场价值的影响，勤勉谨慎分析各事件信息所带来的投资机会，以期实现基金资产的长期稳定增值。

①公司经营与资产重组

资产重组将重新调整企业与其他主体在资产、负债及所有者权益各项目之间的分布状态，重新配置设企业资产上的权利。资产重组前后公司的估值通常会

有明显的改变，对公司的运营产生深远的影响。

②公司经营与股权激励

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。

③公司经营与股权变动

公司股权变动直接改变公司的资产结构，包括但不限于定向增发、股份增持与股份回购等。股权变动对公司未来的生产、经营、管理等多个方面产生重大影响，通常对公司的发展具有较大的推动作用。。

④公司经营与业绩预告及超预期

业绩预告是指上市公司根据交易所规定所作出的关于净利润为负值、净利润增减幅度超过 50% 以上、或实现扭亏为盈等事项的公告；业绩超预期是指公司业绩披露后，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。这两种情形都代表着上市公司经营上出现了一些值得关注的变化因素，其股票市场表现也有一定的统计特征。

⑤公司经营与高分红及高转送

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。

⑥公司经营与其他影响公司的重大事项

其他事件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。

2) 量化策略构建股票投资组合

本基金在严控风险的基础上进一步采用多因子量化模型优选受益于事件影响，具有超额收益的股票构建股票投资组合，以争取在控制风险的基础上获得最大收益。

A、风险控制

本基金采用量化方法从多个维度严控风险，包括行业、市值以及风格等方面。

其中风格因子方面又包括长期动量、长期杠杆率以及长期 beta 等对个股的收益波动有较大解释力度的因子。本基金通过对这些因子的综合控制，使得基金整体风格与市场不至于偏离太大，以避免基金组合走极端，从而较好的控制组合在不利情况下的回撤。

B、多因子模型

在初选股票的基础上，本基金基于多因子选股模型攫取相对业绩基准的超额收益。多因子模型可以从全方位去评估一只个股的优劣，所包含的因子涵盖综合财务因子、综合动量因子和情绪因子这三大方面。其中综合财务因子包括企业的成长、质量、财务指标等方面，综合动量因子覆盖动量、市场相关性、波动率、流动性等方面，情绪因子包含估值和分析师情绪等因素，本基金将密切关注并分析个股在各个因子上的得分情况，择优选取基本面优良、契合市场或行业轮动特点等具有稳定业绩回报和投资价值的股票。

3) 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。

(2) 行业配置

本基金管理人将定期根据行业景气度、行业杠杆、行业动量等定量指标以及宏观经济环境、行业事件性因素等方面的定性分析，对各行业的发展前景和投资价值进行评估、排序，并根据评估结果确定本基金的行业配置。

3、债券投资组合策略

本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：

(1) 久期调整策略

根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。

(2) 收益率曲线配置策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，从长、中、短期

债券的相对价格变化中获利。

(3) 债券类属配置策略

根据国债、金融债、公司债、可转债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。其中，随着债券市场的发展，基金将加强对公司债、可转债、资产支持证券等新品种的投资，主要通过信用风险、内含选择权的价值分析和风险管理，获取超额收益。

4、权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

5、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、个券选择和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，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

6、可转换债券、可交换债券投资策略

本基金管理人将对可转换债券、可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等，并参考同类公司的估值水平，研判对应公司的投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券、可交换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券、可交换债券进行定价分析，制定可转换债券、可交换债券的投资策略。

7、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

8、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

若未来法律法规或监管部门有新规定的，本基金将按最新规定执行。

6、业绩比较基准：中证 800 指数收益率×85%+商业银行活期存款利率×15%。

7、风险收益特征：本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

8、基金管理人：建信基金管理有限责任公司。

9、基金托管人：中国国际金融股份有限公司。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：建信量化事件驱动股票型证券投资基金

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	14,716,097.24
结算备付金	508,823.61
交易性金融资产	17,442,946.49
应收申购款	784.83
资产总计	32,668,652.17
负债和所有者权益	
负债：	
应付管理人报酬	23,949.89
应付托管费	3,991.64
其他负债	398,403.56
负债合计	426,345.09
净资产：	
实收基金	24,313,783.50
未分配利润	7,928,523.58
所有者权益合计	32,242,307.08

负债和所有者权益总计	32,668,652.17
------------	----------------------

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 24,313,783.50 份，基金份额净值 1.3261 元。

四、清盘事项说明

1、基本情况

建信量化事件驱动股票型证券投资基金（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”）2017 年 5 月 15 日证监许可[2017]708 号文注册募集，由建信基金管理有限责任公司于 2017 年 8 月 3 日至 2017 年 9 月 8 日向社会公开募集，《基金合同》于 2017 年 9 月 13 日生效。首次设立募集规模为 243,494,235.54 份基金份额。

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，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

本基金的投资范围为具有较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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货、国债期货以套期保值为目的，股指期货、国债期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×85%+商业银行活期存款利率×15%。

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《关于终止建信

量化事件驱动股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，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《关于建信量化事件驱动股票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 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量化事件驱动股票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 2023 年 8 月 30 日起至 2023 年 9 月 8 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《建信量化事件驱动股票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”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 14,716,097.24 元，其中包含应计利息人民币 4,989.39 元。清算期间，银行存款共计提利息人民币 6,031.85 元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币 32,058,477.95 元，其中应计银行存款利息余额为人民币 11,021.24 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 508,823.61 元，其中上海结算备付金为人民币 31,973.48 元，应计上海结算备付金利息为人民币 139.31 元；深圳结算备付金为人民币 25,603.34 元，应计深圳结算备付金利息为人民币 106.48 元；期货备付金为人民币 451,001.00 元。清算期间上海结算备付金增加人民币 218.63 元，上海结算备付金计提利息为人民币 14.41 元；深圳结算备付金增加人民币 1,030.91 元，深圳结算备付金计提利息为人民币 11.55 元；期货备付金人民币 451,001.00 元划入托管账户。截至清算期结束日，结算备付金为人民币 59,098.11 元，其中上海结算备付金为人民币 32,192.11 元，应计上海结算备付金利息为人民币 153.72 元；深圳结算备付金为人民币 26,634.25 元，应计深圳结算备付金利息为人民币 118.03 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) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 17,442,946.49 元，全部为股票投资。该股票投资已于清算期间处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 17,487,147.67 元，已于清算期间划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 784.83 元，清算期间产生应收申购款为人民币 179.73 元，已于清算期间划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 23,949.89 元，该款项已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,991.64 元，该款项已于清算期间支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币 398,403.56 元，其中应付交易费用为人民币 303,595.09 元，全部为应付席位佣金；预提审计费为人民币 55,000.00 元，预提信披费为人民币 39,808.47 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 8 日止的清算期间
一、清算收益	
利息收入（注 1）	6,057.81
处置交易性金融资产产生的净收益（注 2）	27,760.67
股息红利税（注 3）	-16,203.36
其他收入（注 4）	10.98
清算收入小计	17,626.10
二、清算费用	
银行手续费	120.78
清算费用小计（注 5）	120.78
三、清算净收益	17,505.32

注 1：利息收入系计提的自 2023 年 8 月 30 日至 2023 年 9 月 8 日止清算期间的银行存款利息及结算备付金利息。

注 2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票最后运作日的股票估值总额及买卖股票产生的交易费用后的差额。

注 3：股息红利税系根据《股息红利差别化纳税会计核算细则》（中基协发[2012]21 号），于转让交割股票后的次一交易日，根据中登公司按投资者实际持股期限计算的应缴税额计提应缴税款而确认的红字股利收益。

注 4：其他收入为赎回费收入和补差费收入。

注 5：按照《建信量化事件驱动股票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”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

建信量化事件驱动股票型证券投资基金

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 8 月 29 日基金净资产	32,242,307.08
加：清算期间净收益	17,505.32
减：2023 年 8 月 30 日确认的净赎回	142,236.34
二、2023 年 9 月 8 日基金资产净值	32,117,576.06

注：资产处置及负债清偿后，2023年9月8日（清算结束日）本基金剩余财产为人民币 32,117,576.06 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) 《建信量化事件驱动股票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《建信量化事件驱动股票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。

建信量化事件驱动股票型证券投资基金基金财产清算小组

报告出具日期：2023年9月15日

报告公告日期：2023年9月20日