

中银理财 21 天债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2016 年 7 月 29 日

清算报告公告日：2016 年 8 月 24 日

一、重要提示

中银理财 21 天债券型证券投资基金（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【2013】319 号文核准募集，于 2013 年 12 月 19 日成立并正式运作，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，中银基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”）依据《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《中银理财 21 天债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间自 2016 年 6 月 20 日起，至 2016 年 7 月 14 日 17:00 结束。2016 年 7 月 15 日，在本基金的基金托管人的授权代表的监督下，基金管理人对本次大会表决进行了计票，会议审议表决并通过了《关于终止中银理财 21 天债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，该议案自该日起生效。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见 2016 年 7 月 18 日刊登在《证券时报》和基金管理人网站（www.bocim.com）上的《中银理财 21 天债券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》。

本基金清算期为 2016 年 7 月 19 日至 2016 年 7 月 29 日，由基金管理人、基金托管人、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于 2016 年 7 月 18 日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：中银理财 21 天债券型证券投资基金（基金简称：中银理财 21 天债券。中银理财 21 天债券 A，基金代码：000132；中银理财 21 天债券 B，基金代码：000133）

2、基金运作方式：契约型开放式

（1）每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请

对于每份基金份额，第一个运作期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日次三周的对日（即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起，至基金合同生效日或基金份额申购申请日次六周的对日（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。

每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。

（2）每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请

每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一工作日起该基金份额进入下一个运作期。

在基金份额对应的每个运作期到期日，基金管理人办理该基金份额对应的未支付收益的结转。

基金份额持有人在运作期到期日申请赎回的，基金管理人按照招募说明书的约定为基金份额持有人办理赎回事宜。

3、基金合同生效日：2013年12月19日

4、清算起始日：2016年7月19日

5、投资目标：本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，努力追求绝对收益，为基金份额持有人谋求资产的稳定增值

6、投资策略：本基金将采用积极管理型的投资策略，将投资组合的平均剩余期限控制在141天以内，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益

7、业绩比较基准：七天通知存款税后利率

8、风险收益特征：本基金属于债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场型证券投资基金

9、基金管理人：中银基金管理有限公司

10、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可【2013】319号文核准，由基金管理人于2013年12月6日至2013年12月17日向社会公开发行人募集，基金合同于2013年12月19日正式生效，首次设立募集规模为3,071,062,921.70份基金份额。自2013年12月19日至2016年7月18日期间，本基金按《基金合同》的约定正常运作。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，中银基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”）依据《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《中银理财21天债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间自2016年6月20日起，至2016年7月14日17:00结束。2016年7月15日，在本基金的基金托管人的授权代表的监督下，基金管理人对本次大会表决进行了计票，会议审议并通过了《关于终止中银理财21天债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，该议案自该日起生效。本基金自2016年7月19日起进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：中银理财21天债券型证券投资基金

报告截止日：2016年7月18日

单位：人民币元

	最后运作日 2016年7月18日
资产：	
银行存款	192,795,802.45
结算备付金	-
应收利息	492,062.02
资产总计	193,287,864.47
负债：	

应付管理人报酬	27,272.37
应付托管费	8,080.73
应付销售服务费	11,939.01
应付交易费用	2,913.36
应付利润	188,007.63
其他负债	89,500.00
负债合计	327,713.10
所有者权益：	
实收基金	192,960,151.37
未分配利润	-
所有者权益合计	192,960,151.37
负债和所有者权益总计	193,287,864.47

五、基金财产分配

1、清算费用

根据《中银理财 21 天债券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，由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

本基金清算费用明细如下下表所示：

单位：人民币元

项目	金额
银行汇划费	71.00
清算费用系清算期间审计费及律师费	35,000.00
费用小计	35,071.00

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日应收利息人民币 492,062.02 元，其中人民币 268,550.00 元已于 2016 年 7 月 27 日划入托管户；人民币 208,416.53 元已于 2016 年 7 月 28 日划入托管户；人民币 15,079.02 元将由基金管理人中银基金管理有限

公司以自有资金垫付，于清算款划出日当天划入托管账户。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) 本基金最后运作日定期存款人民币 160,000,000.00 元，其中已于 2016 年 7 月 27 日收到本金人民币 100,000,000.00 元；已于 2016 年 7 月 28 日收到本金人民币 60,000,000.00 元。

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 27,272.37 元，该款项已于 2016 年 7 月 22 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 8,080.73 元，该款项已于 2016 年 7 月 22 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 11,939.01 元，该款项已于 2016 年 7 月 22 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 2,913.36 元，其中人民币 1,380.00 元已于 2016 年 7 月 19 日支付；人民币 1,533.36 元已于 2016 年 7 月 22 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付利润为人民币 188,007.63 元，该款项已于 2016 年 7 月 19 日结转为基金份额。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 89,500.00 元，其中人民币 4,500.00 元已于 2016 年 7 月 19 日支付；人民币 35,000.00 元已于 2016 年 7 月 20 日支付；人民币 50,000.00 元已于 2016 年 7 月 22 日支付。

4、清算日的清算损益情况

项目	自2016年7月19日 至2016年7月29日 止清算期间
一、收益	
1、利息收入（注1）	128,942.05
收益小计	128,942.05
二、费用	
2、银行汇划费	71.00

3、清算费用（注2）	35,000.00
费用小计	35,071.00
三、清算期间净收益	<u>93,871.05</u>

注1：利息收入系计提的自2016年7月19日至2016年7月29日止清算期间的银行存款利息。

注2：清算费用系清算期间审计费及律师费。

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

项目	金额
一、最后运作日2016年7月18日基金净资产	192,960,151.37
加：自2016年7月19日至2016年7月29日止清算期间净收益	93,871.05
加：应付利润结转实收基金	188,007.63
减：2016年7月29日尚未结转实收基金的应付利润	(93,871.05)
基金净赎回金额	(519,490.37)
-于2016年7月18日确认的投资者赎回申请	
二、2016年7月29日基金净资产	192,628,668.63

资产处置及负债清偿后，于2016年7月29日本基金剩余财产为人民币192,722,539.68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。

清算起始日2016年7月19日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。截至2016年7月29日止的应收利息共计人民币30,582.04元（以当前适用的利率预估），将由基金管理人以自有资金垫付，于清算款划出日当天划入托管账户。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。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1)《中银理财 21 天债券型证券投资基金清算审计报告》

(2)《中银理财 21 天债券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。

中银理财 21 天债券型证券投资基金基金财产清算小组

2016 年 7 月 29 日