

# 中银消费活力混合型证券投资基金

## 第二次清算报告

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：2020年6月19日

清算报告公告日：2020年7月7日

## 一、重要提示

中银消费活力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【2019】737号文注册募集，于2019年6月14日成立并正式运作，本基金的基金管理人为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”），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《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《中银消费活力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5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止《基金合同》，并按照《基金合同》的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会。”。截至2020年2月24日日终，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，已于2020年2月25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2020年2月25日《证券时报》和基金管理人网站（www.bocim.com）的《中银基金管理有限公司关于中银消费活力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》。

本基金于2020年2月25日进入清算期，由基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于2020年2月25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。

本基金首次清算期间为2020年2月25日至2020年4月8日。本基金的基金管理人于2020年6月4日对《中银消费活力混合型证券投资基金清算报告》进行了公告，并于2020年6月5日支付了第一次清算款。

本次清算为本基金第二次清算，清算期间为2020年4月9日至2020年6月5日。本清算报告已经基金托管人复核，在经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计、上海市通力律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案。

## 二、基金概况

1、基金名称：中银消费活力混合型证券投资基金（基金简称：中银消费活力混合；基金代码：007334）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2019年6月14日

4、首次清算起始日：2020年2月25日

5、首次清算起始日基金份额总额：7,717,603.23份

6、投资目标：本基金通过深入研究并积极投资于消费活力相关的优质上市公司，在力争严格控制风险和保持良好流动性的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。

7、投资范围：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括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）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、央行票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债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）。

8、投资策略：本基金的投资策略由大类资产配置策略、消费活力相关的上市公司范畴的界定、股票投资策略、债券投资策略、港股投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略等七部分组成。

9、业绩比较基准：

沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%

10、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高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

本基金将投资港股通标的股票，将面临需承担汇率风险以及境外市场风险港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

11、基金管理人：中银基金管理有限公司

12、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

中银消费活力混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证监会证监许可【2019】737 号文《关于准予中银消费活力混合型证券投资基金注册的批复》，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2019 年 6 月 14 日正式生效，首次设立募集规模为 205,560,175.91 份基金份额。

根据《中银基金管理有限公司关于中银消费活力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 2020 年 2 月 25 日起，本基金进入清算程序，停止办理申购（含定投）、赎回、转换等业务。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费等费用。

### 四、财务会计报告

1、2020 年 6 月 5 日(基金清算结束日)资产负债表（经审计）  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

资 产	本期末 2020年6月5日 (基金清算结束日)	上期末 2020年2月24日 (基金最后运作日)
<b>资 产:</b>		
银行存款	1,501,337.25	3,124,913.37
结算备付金	-	-
存出保证金	-	41,279.14
交易性金融资产	-	14,910,430.32
其中: 股票投资	-	13,771,684.82
债券投资	-	1,138,745.50
应收证券清算款	-	12,212,420.39
应收利息	8,045.89	42,244.07
应收申购款	-	494,263.24
<b>资产总计</b>	<b>1,509,383.14</b>	<b>30,825,550.53</b>
<b>负债和所有者权益</b>		
<b>负 债:</b>		
应付赎回款	-	12,529,272.38
应付管理人报酬	-	32,347.97
应付托管费	-	5,391.32
应付交易费用	-	19,410.89
其他负债	-	157,510.16
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>12,743,932.72</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,361,969.88	15,586,180.95
未分配利润	147,413.26	2,495,436.86
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,509,383.14</b>	<b>18,081,617.81</b>
<b>负债和所有者权益 总计</b>	<b>1,509,383.14</b>	<b>30,825,550.53</b>

注:

1. 报告截止日 2020 年 6 月 5 日(基金清算结束日), 基金份额净值 1.1082 元, 基金份额总额 1,361,969.88 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 2 月 25 日(基金最后运作日次日)至 2020 年 6 月 5 日(基金清算结束日)止期间。

2、2020 年 2 月 25 日(基金最后运作日次日)至

2020 年 6 月 5 日(基金清算结束日)止期间的利润表 (经审计)

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

项 目	本期 2020年2月25日 (基金最后运作日次日) 至 2020年6月5日 (基金清算结束日)
一、收入	-337,517.13

利息收入	12,681.81
其中：存款利息收入	11,260.63
债券利息收入	1,421.18
投资收益(损失以“-”填列)	1,506,365.49
其中：股票投资收益	1,515,239.50
债券投资收益	-6,204.01
股利收益	-2,670.00
公允价值变动收益	-1,859,216.93
其他收入	2,652.50
<b>减：二、费用</b>	<b>62,426.98</b>
交易费用	27,045.73
其他费用	35,381.25
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>-399,944.11</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>-399,944.11</b>

## 五、基金财产分配

由于本基金于 2020 年 4 月 8 日（第一次清算结束日）仍持有限售股票导致部分资产尚未变现，故需进行第二次清算。

本次清算为第二次清算，清算期间为 2020 年 4 月 9 日至 2020 年 6 月 5 日，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。

截至本次清算期结束日（2020 年 6 月 5 日）各项资产负债清算情况如下：

### 1、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，根据基金合同的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 2、资产处置情况

（1）本基金于 2020 年 5 月 26 日将 2020 年 4 月 8 日（第一次清算结束日）持有的锁定期内新股变现，变现金额为人民币 1,493,962.13 元。

（2）本基金于 2020 年 4 月 8 日（第一次清算结束日）存出保证金余额：人民币 13,815.96 元，分别于 2020 年 5 月 7 日、2020 年 6 月 2 日经调整存出保证金而划入本基金托管账户 3,642.91 元、10,173.05 元。

### 3、负债清偿情况

（1）本基金于 2020 年 4 月 8 日（第一次清算结束日）应付佣金余额为人民币 30,428.25 元，已于 2020 年 4 月 16 日支付；自 2020 年 4 月 9 日至 2020 年 6 月 5 日止第二次清算期间发生的应付佣金人民币 1,392.84 元，已于 2020 年 6 月 3 日支付。

（2）本基金最后运作日已计提的应付信息披露费 110,000.00 元已于 2020 年 6 月 3 日支付。

### 4、清算期间的清算损益情况

项目	自2020年4月9日至2020年6月5日止清算期间 金额（单位：人民币元）
一、收益	
1、存款利息收入（注1）	5,448.61

2、投资收益	-501,555.93
3、公允价值变动损益	430,232.42
收益小计	-65,874.90
二、费用	
1、银行汇划费	48.00
2、交易费用	3,021.12
3、清算期间费用（注2）	5,000.00
费用小计	8,069.12
三、清算期间净收益	-73,944.02

注1：存款利息收入系以当前适用的利率计提的自2020年4月9日至2020年6月5日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息。

注2：本基金清算期间的审计费由基金承担。

#### 5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额（单位：人民币元）
一、第一次清算结束日2020年4月8日基金净资产	8,627,280.79
加：第二次清算期间净收益	-73,944.02
减：第一次清算款	7,043,953.63
二、2020年6月5日基金净资产	1,509,383.14

本基金已于2020年6月5日支付了第一次清算款，并根据本基金的基金合同约定按照基金份额持有人持有的基金份额比例进行了分配。

第二次清算期间资产处置及负债清偿后，本基金于2020年6月5日全部剩余财产为人民币1,509,383.14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可供分配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。

本基金清算结束日已确认的应收存出保证金利息48.78元以及应收活期存款利息7,997.11元，尚未划入托管账户，将于下一个结息日划入。自2020年6月5日（基金清算结束日）次日起至第二次清算款划出前一日止期间，本基金由银行存款产生的利息收入归基金份额持有人所有，后续产生的各类与第二次清算款划付相关的手续费由基金份额持有人承担。

#### 6、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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。



## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

- (1)《中银消费活力混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《中银消费活力混合型证券投资基金清算报告》的法律意见
- (3)《中银消费活力混合型证券投资基金第二次清算审计报告》
- (4)《中银消费活力混合型证券投资基金第二次清算报告》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。

中银消费活力混合型证券投资基金基金财产清算小组

2020年7月7日