

中银产业精选混合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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年10月25日

清算报告公告日：2023年11月9日

一、重要提示

中银产业精选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〔2018〕667号文注册募集，于2019年4月30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”），基金托管人为招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《中银产业精选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2023年9月14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，已于2023年9月15日进入基金财产清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见2023年9月15日刊登在《证券日报》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产业精选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》。

本基金本次清算期间为2023年9月15日至2023年10月25日，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）、上海源泰律师事务所于2023年9月15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：中银产业精选混合型证券投资基金（基金简称：中银产业精选混合；基金代码：A类 005029、C类 005030）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2019年4月30日

4、清算起始日：2023年9月15日

5、基金最后运作日基金份额总额：19,071,414.05 份

6、投资目标：本基金将重点关注我国的优势产业，深入研究行业个股，在严格控制风险的前提下，为基金投资人寻求基金资产的长期稳健增值。

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）、存托凭证、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、中小企业私募债券、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、权证、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）。

本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 60%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票及存托凭证的比例占基金资产的 60-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的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。

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。

8、投资策略：本基金的投资策略由大类资产配置策略、股票投资策略、债券

投资策略、资产支持证券投资策略和衍生品投资策略五部分组成。

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、境外市场风险以及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：招商银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

中银产业精选混合型证券投资基金，系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[2017]1348 号文《关于准予中银康利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2018]667 号文《关于准予中银康利灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》注册，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 4 月 30 日正式生效，首次设立募集规模为 259,660,625.54 份基金份额。

根据《中银基金管理有限公司关于中银产业精选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 2023 年 9 月 15 日起，本基金进入清算程序，停止办理申购、赎回、转换及定期定额投资等业务。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费、销售服务费等费用。

四、财务会计报告

1、2023 年 9 月 14 日(基金最后运作日)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	上年度末
-----	-----	------

	2023年9月14日 (基金最后运作日)	2022年12月31日
资产:		
货币资金	4,877,604.84	855,270.09
结算备付金	89,465.29	117,678.06
存出保证金	28,741.16	13,256.91
交易性金融资产	17,616,456.75	50,704,727.63
其中: 股票投资	16,400,638.78	47,673,581.60
债券投资	1,215,817.97	3,031,146.03
应收清算款	7,362,465.80	270,664.74
应收申购款	3,730.86	3,106.04
资产总计	29,978,464.70	51,964,703.47
负债和净资产		
负债:		
应付清算款	-	310,332.82
应付赎回款	7,614,236.02	180,716.95
应付管理人报酬	19,239.79	64,913.48
应付托管费	3,206.61	10,818.93
应付销售服务费	33.80	55.45
其他负债	162,826.11	209,807.05
负债合计	7,799,542.33	776,644.68
净资产:		
实收基金	19,071,414.05	36,021,418.46
未分配利润	3,107,508.32	15,166,640.33
净资产合计	22,178,922.37	51,188,058.79
负债和净资产总计	29,978,464.70	51,964,703.47

注:

1. 报告截止日2023年9月14日(基金最后运作日),基金份额总额19,071,414.05份,其中A类基金份额净值1.1629元,基金份额19,062,442.95份;C类基金份额净值1.1586元,基金份额8,971.10份。
2. 本财务报表的实际编制期间为2023年1月1日至2023年9月14日(基金最后运作日)止期间。

2、2023年1月1日至2023年9月14日(基金最后运作日)止期间的利润表
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

项目	本期 2023年1月1日至2023 年9月14日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
一、营业总收入	-8,623,262.21	-14,875,551.37

利息收入	12,972.30	16,911.81
其中：存款利息收入	8,363.87	16,911.81
其他利息收入	4,608.43	-
投资收益(损失以“-”填列)	-5,438,072.75	-20,644,665.12
其中：股票投资收益	-5,769,538.42	-21,267,098.85
债券投资收益	34,814.81	68,000.26
股利收益	296,650.86	554,433.47
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-3,209,816.63	5,574,648.64
其他收入(损失以“-”号填列)	11,654.87	177,553.30
减：二、营业总支出	623,133.35	949,116.30
管理人报酬	489,009.56	699,016.49
托管费	81,501.51	116,502.71
销售服务费	1,002.67	55.50
其他费用	51,619.61	133,541.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-9,246,395.56	-15,824,667.67
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-9,246,395.56	-15,824,667.67
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	-9,246,395.56	-15,824,667.67

3、2023年1月1日至2023年9月14日(基金最后运作日)止期间的净资产(基金净值)变动表(除特别注明外,金额单位为人民币元)

项 目	本期 2023年1月1日至2023年9月14日(基金最后 运作日)		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	36,021,418.46	15,166,640.33	51,188,058.79
二、本期期初净资产(基金净值)	36,021,418.46	15,166,640.33	51,188,058.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,950,004.41	-12,059,132.01	-29,009,136.42
(一)、综合收益总额	-	-9,246,395.56	-9,246,395.56
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-16,950,004.41	-2,812,736.45	-19,762,740.86
其中：1.基金申购款	3,747,356.92	1,333,307.15	5,080,664.07
2.基金赎回款	-20,697,361.33	-4,146,043.60	-24,843,404.93
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	19,071,414.05	3,107,508.32	22,178,922.37

项 目	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	28,399,872.04	28,879,407.42	57,279,279.46
二、本期期初净资产(基金净值)	28,399,872.04	28,879,407.42	57,279,279.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,621,546.42	-13,712,767.09	-6,091,220.67
(一)、综合收益总额	-	-15,824,667.67	-15,824,667.67
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	7,621,546.42	2,111,900.58	9,733,447.00
其中：1.基金申购款	29,559,544.45	13,724,199.10	43,283,743.55
2.基金赎回款	-21,937,998.03	-11,612,298.52	-33,550,296.55
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	36,021,418.46	15,166,640.33	51,188,058.79

五、清盘事项说明

1、清算原因

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,“《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。”

自基金合同生效以来,截至 2023 年 9 月 14 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。

2、清算起始日

根据《中银基金管理有限公司关于中银产业精选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 2023 年 9 月 15 日起,本基金进入清算程序。

故本基金清算起始日为 2023 年 9 月 15 日。

3、清算报告编制基础

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，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表为截至本基金最后运作日的资产负债表，并无比较期间的相关数据列示。

六、基金财产分配

自 2023 年 9 月 15 日至 2023 年 10 月 25 日止的清算期间，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行本次清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

1、清算费用

根据《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。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 **89,465.29** 元（含应计利息），其中结算备付金 72,943.83 元已于 2023 年 10 月 16 日划入托管账户，剩余结算备付金将于本次清算期后划入托管账户，应计利息 1,991.51 元已于 2023 年 9 月 21 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 **28,741.16** 元（含应计利息），其中存出保证金 25,854.85 元已于 2023 年 10 月 10 日划入托管账户，深港通存出保证金 2,801.77 元已于 2023 年 9 月 15 日划入托管账户，应计利息 84.54 元已于 2023 年 9 月 21 日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 **17,616,456.75** 元，其中股票投资 **16,400,638.78** 元，已于清算期间对全部股票投资进行处置变现，变现产生的清算款合计为 16,617,797.40 元，已于清算期间划入基金托管账户；债券投资 **1,215,817.97** 元，已于清算期间对全部债券投资进行处置变现，变现产生

的清算款合计为 1,216,124.05 元，已于清算期间划入基金托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 7,362,465.80 元，已于清算期间划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 3,730.86 元（含应计利息），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 19,239.79 元，该款项已于 2023 年 9 月 20 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,206.61 元，该款项已于 2023 年 9 月 20 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 33.80 元，该款项已于 2023 年 9 月 20 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 7,614,236.02 元，该款项已于 2023 年 9 月 15 日划付给基金份额持有人。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 162,826.11 元，其中应付赎回费 779.97 元已于 2023 年 9 月 15 日支付，应付账户维护费 4,500.00 元已于 2023 年 9 月 19 日支付，应付交易费用 124,353.67 元已于 2023 年 9 月 20 日支付，应付信息披露费 32,800.00 元已于 2023 年 9 月 22 日支付，应付银行汇划费 392.47 元已于 2023 年 10 月 13 日支付。

(6) 自 2023 年 9 月 15 日本基金进入清算期至本财务报表批准报出日(2023 年 10 月 25 日)止期间，产生清算审计费用为人民币 15,000.00 元，将于本次清算期后支付。

(7) 自 2023 年 9 月 15 日本基金进入清算期至本财务报表批准报出日(2023 年 10 月 25 日)止期间，产生清算律师费用为人民币 15,000.00 元，将于本次清算期后支付。

4、清算期间的清算损益情况

项目	自2023年9月15日至2023年10月25日止清算期间 金额（单位：人民币元）
一、收益	

利息收入（注1）	8,463.69
交易性金融资产公允价值变动损益	-496,873.48
交易性金融资产投资收益	689,939.25
其他收入（注2）	63.24
收益小计	201,592.70
二、费用	
1、其他费用（注3）	30,298.74
费用小计	30,298.74
三、清算期间净收益	171,293.96

注1：利息收入系清算期间计提的银行存款利息收入、存出保证金利息收入以及结算备付金利息收入。

注2：其他收入系清算期间归入基金资产的赎回费收入、转换费收入。

注3：其他费用系清算期间计提的清算审计费、清算律师费以及产生的银行汇划费。

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、最后运作日 2023 年 9 月 14 日基金净资产	22,178,922.37
加：清算期间净收益	171,293.96
减：清算期间支付赎回款	1,325,483.35
二、2023 年 10 月 25 日基金净资产	21,024,732.98

资产处置及负债清偿后，本基金于2023年10月25日剩余财产为人民币21,024,732.98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2023年9月15日至清算款划出日前一日的存款利息、结算备付金、存出保证金利息亦属基金份额持有人所有。该部分利息以及未到账的结算备付金、存出保证金将由基金管理人以自有资金垫付。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。

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。

七、备查文件

1、备查文件目录

(1) 中银产业精选混合型证券投资基金清算审计报告

(2) 上海源泰律师事务所关于中银产业精选混合型证券投资基金清算事宜之法律意见

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。

中银产业精选混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023年11月9日