

中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金  
清算报告

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024 年 4 月 1 日

清算报告送出日：2024 年 4 月 17 日

## 一、重要提示

中银证券安瑞 6 个月持有期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【2021】3486 号文准予注册募集。本基金于 2022 年 3 月 30 日成立并正式运作,本基金的基金管理人为中银国际证券股份有限公司,本基金的基金托管人为浙商银行股份有限公司。

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》、《中银证券安瑞 6 个月持有期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,本基金出现了基金合同终止事由。中银国际证券股份有限公司(以下简称“基金管理人”)将根据相关法律法规、《基金合同》的约定对本基金进行清算,并终止《基金合同》,无需召开基金份额持有人大会审议。

根据基金管理人于 2024 年 2 月 20 日发布的《关于中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金自 2024 年 2 月 20 日起进入清算程序。由基金管理人中银国际证券股份有限公司、基金托管人浙商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于 2024 年 2 月 20 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由毕马威华振会计师事务所(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

|                                |  |
|--------------------------------|--|
| 基金名称                           | 中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金  |
| 基金简称                           | 中银证券安瑞 6 个月持有债券  |
| 基金主代码                          | 014337   |
| 基金运作方式                         | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日                        | 2022 年 3 月 30 日  |
| 基金管理人                          | 中银国际证券股份有限公司   |
| 基金托管人                          | 浙商银行股份有限公司   |
| 基金最后运作日(2024 年 2 月 19 日)基金份额总额 | 36,335,881.09 份  |
| 投资目标                           | 在严格控制风险的前提下,通过积极挖掘市场投资机会,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。                            |
| 投资策略                           | 本基金通过大类资产配置策略、类属配置策略、期限结构配置策略、信用债券投资策略、可转债和可交债投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略,以实现基金资产的长期稳健增值。 |

|                                     |   |                   |
|-------------------------------------|---|-------------------|
| 业绩比较基准                              | 中债综合全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%            |                   |
| 风险收益特征                              | 本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险低于股票型基金及混合型基金，高于货币市场基金。 |                   |
| 下属分级基金的基金简称                         | 中银证券安瑞 6 个月持有债券 A                           | 中银证券安瑞 6 个月持有债券 C |
| 下属分级基金的交易代码                         | 014337                                      | 014338            |
| 基金最后运作日（2024 年 2 月 19 日）下属分级基金的份额总额 | 25,952,467.50 份                             | 10,383,413.59 份   |

### 三、基金运作情况

本基金经证监许可【2021】3486号《关于准予中银证券安瑞6个月持有期债券型证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定向社会公开募集。本基金基金合同于2022年3月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为216,374,759.32份基金份额。自2022年3月30日至2024年2月19日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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》、《基金合同》的有关规定，本基金出现了基金合同终止事由。

根据《基金合同》“第五部分基金备案”中“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50个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止《基金合同》，无须召开基金份额持有人大会。”

截至2024年2月19日日终，本基金的基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止事由，《基金合同》自动终止，基金管理人将根据法律法规的规定及《基金合同》的约定对本基金进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

### 四、财务会计报告

#### 1、基金最后运作日资产负债表（已审计）

会计主体：中银证券安瑞6个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 2 月 19 日（最后运作日）

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2024 年 2 月 19 日<br>(最后运作日) | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-----------------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>      |                                   |                          |
| 货币资金            | 928,445.95                        | 768,967.66               |
| 结算备付金           | 119,784.26                        | 202,852.40               |
| 存出保证金           | 21,191.39                         | 23,673.76                |
| 交易性金融资产         | 38,086,418.36                     | 48,958,301.37            |
| 其中：股票投资         | 4,755,737.00                      | 7,648,370.00             |
| 债券投资            | 33,330,681.36                     | 41,309,931.37            |
| 应收清算款           | 998,059.16                        | 1,221,623.06             |
| 应收申购款           | -                                 | -                        |
| 其他资产            | -                                 | -                        |
| <b>资产总计</b>     | <b>40,153,899.12</b>              | <b>51,175,418.25</b>     |
|                 |                                   |                          |
| 负债和净资产          | 本期末<br>2024 年 2 月 19 日<br>(最后运作日) | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
| <b>负债：</b>      |                                   |                          |
| 卖出回购金融资产款       | 4,000,000.00                      | 2,000,331.02             |
| 应付清算款           | -                                 | 299,254.14               |
| 应付赎回款           | 1,468,692.04                      | 505,472.74               |
| 应付管理人报酬         | 11,512.69                         | 25,215.72                |
| 应付托管费           | 1,918.79                          | 4,202.61                 |
| 应付销售服务费         | 1,541.60                          | 2,939.56                 |
| 应交税费            | 668.54                            | 1,589.43                 |
| 其他负债            | 163,972.82                        | 157,870.86               |
| <b>负债合计</b>     | <b>5,648,306.48</b>               | <b>2,996,876.08</b>      |
| <b>净资产：</b>     |                                   |                          |
| 实收基金            | 36,335,881.09                     | 50,147,895.15            |
| 未分配利润           | -1,830,288.45                     | -1,969,352.98            |
| <b>净资产合计</b>    | <b>34,505,592.64</b>              | <b>48,178,542.17</b>     |
| <b>负债和净资产总计</b> | <b>40,153,899.12</b>              | <b>51,175,418.25</b>     |

注：（1）报告截止日 2024 年 2 月 19 日（最后运作日），基金份额总额 36,335,881.09 份。

其中中银证券安瑞 6 个月持有债券 A 类基金份额总额 25,952,467.50 份，基金份额净值 0.9512 元；中银证券安瑞 6 个月持有债券 C 类基金份额总额 10,383,413.59 份，基金份额净值 0.9458 元。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 2 月 19 日（基金最后运作日）止期间。

## 2、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 2 月 19 日（基金最后运作日）利润表（已审计）

会计主体：中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2024年2月19日

单位：人民币元

| 项目                         | 本期<br>自2024年1月1日<br>至2024年2月19日<br>(最后运作日)止期间 | 上年度可比期间<br>2023年度 |
|----------------------------|---|-------------------|
| <b>一、营业总收入（损失以“-”填列）</b>   | -532,898.00                                   | -42,474.69        |
| 1. 利息收入                    | 798.83  | 22,348.19         |
| 其中：存款利息收入                  | 798.83  | 12,594.63         |
| 债券利息收入                     | -   | -                 |
| 买入返售金融资产收入                 | -   | 9,753.56          |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | -1,179,120.92                                 | -304,542.91       |
| 其中：股票投资收益                  | -1,046,277.35                                 | -1,708,195.13     |
| 债券投资收益                     | -132,843.57                                   | 1,240,619.70      |
| 股利收益                       | -   | 163,032.52        |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 645,424.09                                    | 239,720.03        |
| 4. 其他收入（损失以“-”号填列）         | -   | -                 |
| <b>减：二、营业总支出</b>           | 76,513.34                                     | 940,070.21        |
| 1. 管理人报酬                   | 35,309.39                                     | 428,350.28        |
| 2. 托管费                     | 5,884.90                                      | 71,391.68         |
| 3. 销售服务费                   | 4,272.13                                      | 63,581.66         |
| 4. 投资顾问费                   | -   | -                 |
| 5. 利息支出                    | 9,611.26                                      | 207,288.02        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 9,611.26                                      | 207,288.02        |
| 6. 信用减值损失                  | -   | -                 |
| 7. 税金及附加                   | 235.66  | 6,258.57          |
| 8. 其他费用                    | 21,200.00                                     | 163,200.00        |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | -609,411.34                                   | -982,544.90       |
| 减：所得税费用                    | -   | -                 |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | -609,411.34                                   | -982,544.90       |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       | -   | -                 |
| <b>六、综合收益总额</b>            | -609,411.34                                   | -982,544.90       |

注：本财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师黄小熠、倪益签字出具了毕马威华振审字第2406004号无保留意见带强调事项段和其他事项段的审计报告。

## 五、清算情况

自2024年2月20日至2024年4月1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，具体清算情况如下：

### 1、清算费用

按照《中银证券安瑞6个月持有期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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日货币资金余额为人民币 928,445.95 元，清算期间货币资金净流入人民币 32,103,653.32 元，清算期间计提银行存款利息人民币 2,972.94 元，于清算结束日货币资金余额为 33,035,072.21 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 119,784.26 元，清算期间结算备付金净流入人民币 13,413.35 元，清算期间计提结算备付金利息人民币 240.58 元，于清算结束日结算备付金余额为人民币 133,438.19 元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 21,191.39 元，清算期间存出保证金净流入人民币 261.19 元，清算期间计提存出保证金利息人民币 40.39 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 21,492.97 元。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产余额为人民币 38,086,418.36 元，均于清算期间处置变现，处置价款人民币 38,188,555.08 元。清算期间确认公允价值变动收益人民币 130,775.70 元，确认投资损失人民币 28,638.98 元，于清算结束日交易性金融资产余额为人民币 0.00 元。

(5) 本基金最后运作日应收清算款余额为人民币 998,059.16 元，清算期间净收到应收清算款人民币 998,059.16 元，于清算结束日应收清算款余额为 0.00 元。

(6) 本基金最后运作日买入返售金融资产余额为人民币 0.00 元，清算期间购入买入返售金融资产人民币 9,500,000.00 元，清算期间处置买入返售金融资产人民币 9,502,857.49 元，确认利息收入人民币 2,857.49 元，于清算结束日买入返售金融资产余额为人民币 0.00 元。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 1,468,692.04 元，清算期间计提应付赎回款人民币 1,454,034.80 元，支付应付赎回款人民币 2,922,726.84 元，于清算结束日应付赎回款余额为人民币 0.00 元。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬余额为人民币 11,512.69 元，均于清算期间支

付，于清算结束日应付管理人报酬余额为人民币 0.00 元。

(3) 本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 1,918.79 元，均于清算期间支付，于清算结束日应付托管费余额为人民币 0.00 元。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 1,541.60 元，均于清算期间支付，于清算结束日应付销售服务费余额为人民币 0.00 元。

(5) 本基金最后运作日卖出回购金融资产款余额为人民币 4,000,000.00 元，清算期间购入卖出回购金融资产款人民币 2,400,000.00 元，清算期间支付卖出回购金融资产款人民币 6,402,115.79 元，清算期间计提卖出回购金融资产款利息人民币 2,115.79 元，于清算结束日卖出回购金融资产款余额为人民币 0.00 元。

(6) 本基金最后运作日应交税费余额为人民币 668.54 元，清算期间计提应交税费人民币 1,299.43 元，清算期间支付应交税费人民币 980.34 元，于清算结束日应交税费余额为人民币 987.63 元。

(7) 本基金最后运作日其他负债余额为人民币 163,972.82 元，清算期间冲回其他负债人民币 3,100.00 元，清算期间支付其他负债人民币 131,347.82 元，于清算结束日其他负债余额为人民币 29,525.00 元。

#### 4、清算期间清算损益情况

单位：人民币元

|  |            |
|--|------------|
| 一、清算期间（自 2024 年 2 月 20 日至 2024 年 4 月 1 日止）收入   | 108,248.12 |
| 1. 利息收入  | 6,111.40   |
| 其中：货币资金利息收入                                    | 2,972.94   |
| 结算备付金利息收入                                      | 240.58     |
| 存出保证金利息收入                                      | 40.39      |
| 债券利息收入   | -          |
| 买入返售金融资产收入                                     | 2,857.49   |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列)                              | -28,638.98 |
| 其中：股票投资收益                                      | 15,712.30  |
| 债券投资收益(1)                                      | -44,351.28 |
| 股利收益   | -          |
| 3. 公允价值变动收益                                    | 130,775.70 |
| 4. 其他收入  | -          |
| 二、减：清算期间（自 2024 年 2 月 20 日至 2024 年 4 月 1 日止）费用 | 315.22     |
| 1. 利息支出  | 2,115.79   |

|               |            |
|---------------|------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 2,115.79   |
| 2. 税金及附加      | 1,299.43   |
| 3. 其他费用（2）    | -3,100.00  |
| 三、清算期间净收益     | 107,932.90 |

注：（1）债券投资收益

（a）债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 清算期间<br>(自 2024 年 2 月 20 日至 2024 年 4 月 1 日止) |
|------------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入                 | 74,589.73                                    |
| 债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入 | -118,941.01                                  |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -  |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -  |
| 合计                           | -44,351.28                                   |

（b）债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 清算期间<br>(自 2024 年 2 月 20 日至 2024 年 4 月 1 日止) |
|------------------------|--|
| 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额   | 33,429,846.98                                |
| 减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额 | 32,899,491.90                                |
| 减：应收利息总额               | 649,121.09                                   |
| 减：交易费用                 | 175.00                                       |
| 买卖债券差价收入               | -118,941.01                                  |

（2）其他费用为预提银行间账户维护费 12,400.00 元与 2024 年 3 月 28 日实际支付金额 9,300.00 元之间的差额。

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            |
|----------------------|---------------|
| 最后运作日2024年2月19日基金净资产 | 34,505,592.64 |
| 加：清算期间净收益            | 107,932.90    |
| 加：期间申购影响             | -             |
| 减：期间赎回影响             | 1,454,034.80  |
| 2024年4月1日基金净资产       | 33,159,490.74 |

注：2024年2月19日(基金最后运作日)提出申请并于2024年2月20日确认的应付赎回款及应付转出金额为1,454,034.80元，该款项已从本基金托管账户划付给基金份额持有人。

截至本次清算期结束日 2024 年 4 月 1 日，本基金剩余财产为 33,159,490.74 元。自本次清算期结束次日（2024 年 4 月 2 日）至本次清算款划出前一日所产生的利息（含基金管



理人垫付资金产生利息），归基金份额持有人所有。

本基金所有剩余财产在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。

#### 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，将与会计师事务所出具的审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将根据法律法规及本基金的基金合同约定及时进行基金剩余财产的分配。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

(1) 《中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 2 月 19 日(最后运作日)止期间财务报表及审计报告》

(2) 《关于中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金清算事宜之法律意见》

### 2、存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人基金网站 [www.bocifunds.com](http://www.bocifunds.com)、中国证监会基金电子披露网站 <http://eid.csrc.gov.cn/fund>。

### 3、查阅方式

投资者可以在开放时间内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，也可登陆基金管理人基金网站 [www.bocifunds.com](http://www.bocifunds.com) 查阅。

中银证券安瑞 6 个月持有期债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2024 年 4 月 17 日