

中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年4月1日

清算报告送出日：2024年4月20日

一、重要提示

中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资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[2016]2787号《关于准予中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由中银国际证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规的规定和《中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定公开募集。经向中国证监会备案,《中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年1月25日正式生效。经中国证券监督管理委员会2020年5月8日证监许可[2020]890号文变更注册,中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来,且《中银证券瑞益灵活配置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》”)自2020年7月25日起生效。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中国建设银行股份有限公司。

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,连续二十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,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进行表决。”

截至2024年1月12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,为保护投资者利益,自2024年1月15日起至2024年1月19日止为本基金的赎回选择期,本基金自2024年1月20日起正式进入清算程序,无需召开基金份额持有人大会。

由基金管理人中银国际证券股份有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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1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	中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中银证券瑞益混合	
基金主代码	003980	
基金运作方式	契约型，开放式	
基金合同生效日	2020年7月25日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
基金最后运作日（2024年1月12日）基金份额总额	25,420,448.61份	
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极挖掘市场投资机会，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金通过资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略，以实现基金资产的稳健增值。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中债综合全价指数收益率×60%	
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。	
下属分级基金的基金简称	中银证券瑞益混合 A	中银证券瑞益混合 C
下属分级基金的交易代码	003980	003981
基金最后运作日（2024年1月12日）下属分级基金的份额总额	19,094,188.32份	6,326,260.29份

三、基金运作情况

中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金经证监许可[2016]2787号《关于准予中银证券瑞益定期开放灵活配置混合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。经中国证监会2020年5月8日证监许可[2020]890号文变更注册，本基金由中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来，本基金基金合同于2020年7月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为32,561,018.37份基金份额。自2020年7月25日至2024年1月12日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

截至 2024 年 1 月 12 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。为保护投资者利益,自 2024 年 1 月 15 日起至 2024 年 1 月 19 日止为本基金的赎回选择期,本基金自 2024 年 1 月 20 日起正式进入清算程序,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:中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2024 年 1 月 12 日

单位:人民币元

资产	本期末 2024 年 1 月 12 日 (最后运作日)	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产:		
货币资金	3,212,357.10	2,834,963.96
结算备付金	-	-
存出保证金	2,311.05	2,629.02
交易性金融资产	-	33,981,396.45
其中:股票投资	-	33,981,396.45
债券投资	-	-
买入返售金融资产	10,000,000.00	-
应收清算款	22,256,530.55	-
应收申购款	19,876.65	67,103.42
其他资产	-	-
资产总计	35,491,075.35	36,886,092.85

负债和净资产	本期末 2024年1月12日 (最后运作日)	上年度末 2023年12月31日
负债：		
卖出回购金融资产	-	-
应付清算款	-	-
应付赎回款	2,182,698.86	140,064.86
应付管理人报酬	6,890.95	18,327.61
应付托管费	1,148.50	3,054.58
应付销售服务费	1,328.66	3,493.40
应交税费	-	-
其他负债	163,574.74	110,081.86
负债合计	2,355,641.71	275,022.31
净资产：		
实收基金	25,420,448.61	27,158,553.81
未分配利润	7,714,985.03	9,452,516.73
净资产合计	33,135,433.64	36,611,070.54
负债和净资产总计	35,491,075.35	36,886,092.85

注：报告截止日 2024 年 1 月 12 日(最后运作日)，基金份额总额 25,420,448.61 份。

其中中银证券瑞益混合 A 类基金份额总额 19,094,188.32 份，基金份额净值 1.3135 元；

中银证券瑞益混合 C 类基金份额总额 6,326,260.29 份，基金份额净值 1.2734 元。

2、2024年1月1日至2024年1月12日（最后运作日）利润表（已审计）

会计主体：中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年1月12日

单位：人民币元

项目	本期 自2024年1月1日 至2024年1月12日 (最后运作日)止期 间	2023年度
一、营业总收入（损失以“-”填列）	-1,151,470.47	-24,975,296.94
1. 利息收入	372.73	19,765.18
其中：存款利息收入	372.73	19,765.18
债券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-24,586,879.36	-2,351,619.50
其中：股票投资收益	-24,586,879.36	-3,043,097.46
债券投资收益	-	163,115.81
股利收益	-	528,362.15
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	23,434,227.29	-22,736,928.73
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	808.87	93,486.11
减：二、营业总支出	37,181.82	584,179.82
1. 管理人报酬	6,890.95	331,775.41
2. 托管费	1,148.50	55,295.83
3. 销售服务费	1,328.66	67,393.91
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	-	0.85
8. 其他费用	27,813.71	129,713.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,188,652.29	-25,559,476.76
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,188,652.29	-25,559,476.76
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	-1,188,652.29	-25,559,476.76

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2405990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 1 月 13 日（最后运作日后一日）至 2024 年 4 月 1 日（清算结束日）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《中银证券瑞益灵活配置混合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 3,212,357.10 元，清算期间货币资金净流入人民币 11,731,837.01 元，清算期间计提货币资金利息人民币 11,764.86 元，于清算结束日货币资金余额为 14,955,958.97 元。

（2）本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 0.00 元，清算期间计提结算备付金利息人民币 59.45 元，清算期间结算备付金结息人民币 59.45 元，于清算结束日结算备付金余额为人民币 0.00 元。

（3）本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 2,311.05 元，清算期间存出保证金净流入人民币 4,909.72 元，清算期间计提存出保证金利息人民币 21.19 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 7,241.96 元。

（4）本基金最后运作日买入返售金融资产余额为人民币 10,000,000.00 元，均于清算期间处置变现，处置价款人民币 10,000,612.33 元。清算期间确认买入返售金融资产利息收入人民币 612.33 元，于清算结束日买入返售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 22,256,530.55 元，清算期间收到证券清算款人民币 22,256,530.55 元，于清算结束日应收清算款余额为人民币 0.00 元。

（6）本基金最后运作日应收申购款余额为人民币 19,876.65 元，清算期间收到应收申购款人民币 19,876.65 元，于清算结束日应收申购款余额为人民币 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 2,182,698.86 元，清算期间计提应付赎回款人民币 18,212,377.78 元，支付应付赎回款人民币 20,395,076.64 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 6,890.95 元，均未于清算期间支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为人民币 6,890.95 元。

（3）本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 1,148.50 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 1,328.66 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) 本基金最后运作日应交税费余额为人民币 0.00 元,清算期间计提应交税费人民币 19.99 元,支付应交税费人民币 19.99 元,于清算结束日应交税费余额为人民币 0.00 元。

(6) 本基金最后运作日其他负债余额为人民币 163,574.74 元,主要为信息披露费、审计费、账户维护费、应付佣金等。清算期间计提应付赎回费人民币 5,027.29 元,计提汇划费人民币 10.00 元,计提其他应付款人民币 19,034.62 元,清算期间支付信息披露费、审计费、账户维护费等共计人民币 142,758.46 元,于清算结束日其他负债余额为人民币 44,888.19 元,主要为信息披露费、审计费等,该款项将于 2024 年 4 月 1 日(清算结束日)之后支付。

4、清算期间清算损益情况

单位:人民币元

项目	自 2024 年 1 月 13 日至 2024 年 4 月 1 日 (清算期间)
一、清算收益	12,457.83
1. 利息收入	12,457.83
其中: 存款利息收入	11,845.50
买入返售金融资产收入	612.33
二、清算费用	24,091.90
1. 税金及附加	19.99
2. 其他费用	24,071.91
三、清算收益(损失)总额	-11,634.07

5、净资产情况

本基金最后运作日净资产余额为人民币 33,135,433.64 元,清算期间净收益人民币 -11,634.07 元,确认赎回款人民币 18,212,377.78 元,于清算结束日净资产余额为人民币 14,911,421.79 元。

6、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1月12日基金净资产	33,135,433.64
加：清算期间净收益	-11,634.07
减：期间赎回影响	18,212,377.78
2024年4月1日基金净资产	14,911,421.79

清算结束日本基金剩余财产为人民币 14,911,421.79 元，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。

截至 2024 年 4 月 1 日（清算结束日）止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户货币资金余额为人民币 14,955,958.97 元，存出保证金余额为人民币 7,241.96 元。

7、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）中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- （2）关于中银证券瑞益灵活配置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。

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 查阅。

中银证券瑞益灵活配置混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2024 年 4 月 20 日