

中银证券鸿瑞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：青岛银行股份有限公司

清算报告出具日：2026 年 7 月 28 日

清算报告送出日：2026 年 8 月 31 日

一、重要提示

中银证券鸿瑞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【2024】876号文准予注册募集。本基金于2024年8月21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青岛银行股份有限公司。

中银证券鸿瑞债券型证券投资基金依据《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《中银证券鸿瑞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,以通讯方式召开了基金份额持有人大会,于2026年7月23日表决通过了《关于中银证券鸿瑞债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》,于2026年7月24日发布了《中银国际证券股份有限公司关于以通讯开会方式召开中银证券鸿瑞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》。

本基金自2026年7月24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、基金托管人青岛银行股份有限公司、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2026年7月24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	中银证券鸿瑞债券型证券投资基金
基金简称	中银证券鸿瑞债券
基金主代码	021732
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年8月21日
基金管理人	中银国际证券股份有限公司
基金托管人	青岛银行股份有限公司
基金最后运作日(2026年7月23日)基金份额总额	1,752,728.21份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的稳健回报。
投资策略	本基金通过久期管理策略、类属配置策略、期限结构配置策略、信用债券(含资产支持证券)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	
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	中银证券鸿瑞债券 A	中银证券鸿瑞债券 C
下属分级基金的交易代码	021732	021733
基金最后运作日（2026 年 7 月 23 日）下属分级基金的份额总额	1,517,864.65 份	234,863.56 份

三、基金运作情况

本基金经证监许可【2024】876 号《关于准予中银证券鸿瑞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 2024 年 8 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,013,678.69 份基金份额。自成立以来，本基金按基金合同约定正常运作。

自 2026 年 5 月 14 日起，本基金基金资产净值低于 5000 万元。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《中银证券鸿瑞债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人经与基金托管人青岛银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金终止基金合同有关事项的议案。

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：中银证券鸿瑞债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 7 月 23 日(最后运作日)

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 7 月 23 日 (最后运作日)
资产：	
货币资金	110,366.29
结算备付金	-
存出保证金	8,497.30
交易性金融资产	1,815,270.88
股票投资	-
债券投资	1,815,270.88
买入返售金融资产	-
应收清算款	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	1,934,134.47
负债和净资产	本期末 2026 年 7 月 23 日 (最后运作日)
负债：	
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	52.20
应付管理人报酬	966.32
应付托管费	322.08
应付销售服务费	69.25
应交税费	12,904.15
其他负债	80,848.00
负债合计	95,162.00
净资产：	
实收基金	1,752,728.21
未分配利润	86,244.26
净资产合计	1,838,972.47
负债和净资产总计	1,934,134.47

注：报告截止日 2026 年 7 月 23 日（最后运作日），基金份额总额 1,752,728.21 份。其中

中银证券鸿瑞债券 A 基金份额总额 1,517,864.65 份，基金份额净值人民币 1.04945279 元；
中银证券鸿瑞债券 C 基金份额总额 234,863.56 份，基金份额净值人民币 1.04760900 元。

2、2026 年 1 月 1 日至 2026 年 7 月 23 日（基金最后运作日）利润表（已审计）

会计主体：中银证券鸿瑞债券型证券投资基金

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 7 月 23 日 (最后运作日)止期间
一、营业总收入(损失以“-”填列)	20,155,285.68
1. 利息收入	120,116.97
其中： 存款利息收入	94,178.81
债券利息收入	-
买入返售金融资产收入	25,938.16
2. 投资收益(损失以“-”填列)	13,481,501.61
其中： 股票投资收益	-
债券投资收益	13,481,501.61
基金投资收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6,553,650.46
4. 其他收入(损失以“-”号填列)	16.64
减：二、营业总支出	2,515,328.70
1. 管理人报酬	1,711,120.62
2. 托管费	570,373.53
3. 销售服务费	69.25
4. 投资顾问费	-
5. 利息支出	121,437.68
其中：卖出回购金融资产支出	121,437.68
6. 信用减值损失	-
7. 税金及附加	6,679.62
8. 其他费用	105,648.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	17,639,956.98
减：所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	17,639,956.98
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	17,639,956.98

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，注册会计师倪益、谢晶菁签字出具了毕马威华振审字第 2626892 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 2026 年 7 月 24 日（清算开始日）至 2026 年 7 月 28 日（清算结束日）止清算期间，本基金的资产及负债的具体清算情况如下：

1、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 110,366.29 元，于清算结束日货币资金余额为人民币 1,934,237.56 元。

（2）本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 8,497.30 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 75.47 元。

（3）本基金最后运作日交易性金融资产余额为人民币 1,815,270.88 元，于清算结束日交易性金融资产余额为人民币 0.00 元。

2、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 52.20 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 966.32 元，于清算结束日应付管理人报酬余额为人民币 966.32 元。

（3）本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 322.08 元，于清算结束日应付托管费余额为人民币 322.08 元。

（4）本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 69.25 元，于清算结束日应付销售服务费余额为人民币 69.25 元。

（5）本基金最后运作日应交税费余额为人民币 12,904.15 元，于清算结束日应交税费余额为人民币 12,906.20 元。

（6）本基金最后运作日其他负债余额为人民币 80,848.00 元，于清算结束日其他负债余额为人民币 80,848.00 元。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2026 年 7 月 24 日 (清算开始日) 至 2026 年 7 月 28 日 (清算结束日)止期间
清算收入	
1. 利息收入	169.81

其中： 存款利息收入	169.81
买入返售金融资产收入	-
2. 投资收益 (损失以“- ”填列)	39.32
其中： 股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	39.32
股利收益	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“- ”号填列)	30.00
4. 其他收入 (损失以“- ”号填列)	-
清算收入合计 (损失以“- ”号填列)	239.13
减：清算费用	
1. 税金及附加	0.21
2. 其他费用	
清算费用合计	0.21
清算净收益 (损失以“- ”号填列)	238.92

4、净资产情况

本基金最后运作日净资产余额为人民币 1,838,972.47 元，清算期间净收益人民币 238.92 元，清算期间赎回款为人民币 10.21 元，于清算结束日净资产余额为人民币 1,839,201.18 元。

5、清算结束日的资产负债及剩余资产分配情况

清算结束日本基金剩余财产为人民币 1,839,201.18 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 2026 年 7 月 28 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 1,934,237.56 元，存出保证金余额为人民币 75.47 元。

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)《中银证券鸿瑞债券型证券投资基金自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 7 月 23 日（最后运作日）止期间财务报表及审计报告》

(2) 上海源泰律师事务所关于《中银证券鸿瑞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 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、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 查阅。

中银证券鸿瑞债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2026 年 8 月 31 日