

中银诚利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：恒丰银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年11月30日

清算报告公告日：2021年12月24日

一、重要提示

中银诚利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〔2021〕263号文注册募集，于2021年6月21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”），基金托管人为恒丰银行股份有限公司（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《中银诚利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。”

截至2021年11月2日日终，本基金已出现连续50个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。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2021年11月3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刊登在2021年11月3日《中国证券报》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诚利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》。

本基金清算期为2021年11月3日至2021年11月30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）、上海市通力律师事务所于2021年11月3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。

二、基金概况

1、基金名称：中银诚利混合型证券投资基金（基金简称：中银诚利混合；基金代码：中银诚利混合 A：011679、中银诚利混合 C：011680）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2021 年 6 月 21 日

4、清算起始日：2021 年 11 月 3 日

5、清算起始日基金份额总额：3,056,168.91 份

6、投资目标：在严格控制风险的前提下，通过积极主动的管理，力争为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

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（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、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）。

本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 0%-40%。本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。本基金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。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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、衍生品投资策略五部分组成。

9、业绩比较基准：

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×20%+中债综合全价(总值)指数收益率×80%

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。

11、基金管理人：中银基金管理有限公司

12、基金托管人：恒丰银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

中银诚利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（2021）263 号文《关于准予中银诚利混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，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 2021 年 6 月 21 日正式生效，首次设立募集规模为 206,995,152.32 份基金份额。

根据《中银基金管理有限公司关于中银诚利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 2021 年 11 月 3 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

资产负债表（经审计）

会计主体：中银诚利混合型证券投资基金

	最后运作日 2021 年 11 月 2 日
资 产：	
银行存款	3,106,191.25
结算备付金	119.48
存出保证金	5,607.02

交易性金融资产	-
应收利息	45,134.82
应收申购款	16,843.59
资产总计	3,173,896.16
负 债:	
应付赎回款	42,427.13
应付管理人报酬	151.06
应付托管费	25.18
应付销售服务费	7.08
应付交易费用	47.03
其他负债	103,081.98
负债合计	145,739.46
所有者权益:	
实收基金	3,063,090.40
未分配利润	-34,933.70
所有者权益合计	3,028,156.70
负债和所有者权益总计	3,173,896.16

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 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。”

截至 2021 年 11 月 2 日日终，本基金已出现连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。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依法履行基金财产清算程序，不需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诚利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 2021 年 11 月 3 日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为 2021 年 11 月 3 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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

六、基金财产分配

自 2021 年 11 月 3 日至 2021 年 11 月 30 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，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

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 119.48 元，该款项将于 2021 年 12 月 2 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 5,607.02 元。由于中登结算制度影响，存出保证金将于清算期间后划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 45,134.82 元，其中应收银行存款利息人民币 3,224.32 元，应收结算备付金利息人民币 650.45 元及应收存出保证金利息人民币 9.91 元，应收申购款利息 0.08 元，共计人民币 3,884.76 元，将于

2021年12月21日划入托管账户。国债期货保证金利息人民币41,250.06元已转入期货备付金账户并在2021年11月9日出金至托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收申购款为人民币16,843.59元,该款项已于2021年11月3日划入托管账户。

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151.06元,该款项已于2021年11月3日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币25.18元,该款项已于2021年11月3日支付。

(3) 本基金最后运作日C类基金份额销售服务费为人民币7.08元,该款项已于2021年11月3日支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币42,427.13元,该款项已于2021年11月3日支付。

(5) 本基金最后运作日应付赎回费为人民币81.98元,该款项已于2021年11月3日支付。

(6) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币47.03元,已于2021年11月3日支付。

(7) 本基金最后运作日预提费用为人民币103,000.00元。其中预提信息披露费为人民币100,000.00元,已于2021年11月24日支付;预提中债登账户维护费为人民币3,000.00元,该款项已于2021年11月10日支付。

(8) 自2021年11月3日本基金进入清算期至本财务报表批准报出日(2021年11月30日)止期间,产生清算审计费用为人民币10,000.00元,该款项已于2021年11月26日支付。

(9) 自2021年11月3日本基金进入清算期至本财务报表批准报出日(2021年11月30日)止期间,产生清算律师费用为人民币15,000.00元,将于清算期间后支付。

4、清算期间的清算损益情况

项目	自2021年11月3日
----	-------------

	至 2021 年 11 月 30 日 止清算期间 金额（单位：人民币元）
一、收益	
利息收入（注 1）	1,783.28
赎回、转换手续费收入	34.57
收益小计	1,817.85
二、费用	
清算期间费用（注 2）	25,540.00
费用小计	25,540.00
三、清算期间净收益	-23,722.15

注 1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2021 年 11 月 3 日至 2021 年 11 月 30 日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息、结算备付金利息、国债期货备付金利息。

注 2：本基金清算期间的审计费、律师费和银行汇划费由基金财产承担。

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、最后运作日 2021 年 11 月 2 日基金净资产	3,028,156.70
加：清算期间净收益	-23,722.15
加：清算期间支付申购、赎回款轧差	-6,885.46
二、2021 年 11 月 30 日基金净资产	2,997,549.09

资产处置及负债清偿后，本基金于 2021 年 11 月 30 日剩余财产为人民币 2,997,549.09 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。”

本基金于 2021 年 11 月 30 日银行存款为人民币 3,001,692.47 元；最低备付金为人民币 119.48 元，存出保证金为人民币 5,607.02 元，应收利息人民币 5,615.12 元尚未划入托管账户，将于本次清算期后划入。

本基金于 2021 年 11 月 3 日应付审计费为人民币 10,000.00 元，该款项已于 2021 年 11 月 26 日支付。

本基金于 2021 年 11 月 3 日应付律师费为人民币 15,000.00 元，将于本次清算期后支付。

清算起始日 2021 年 11 月 3 日至清算款划出前一日的银行存款、结算备付金产生的利息亦归基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。该部分利息以及未到账的结算备付金、存出保证金和利息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。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 中银诚利混合型证券投资基金清算审计报告

(2) 上海市通力律师事务所关于《中银诚利混合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。

中银诚利混合型证券投资基金基金财产清算小组

2021 年 11 月 30 日