

中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联
接基金清算报告

基金管理人：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年5月20日

清算报告送出日：2024年6月8日

一、重要提示

中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(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]1077号《关于准予中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》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《中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》的约定公开募集。经向中国证监会备案,《中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)于2021年4月29日正式生效。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工商银行股份有限公司。

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:

“基金合同生效之日起三年后的对应日(指自然日),若基金资产净值低于2亿元,本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充,则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

截至2024年4月29日日终,本基金的基金资产净值低于2亿元,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。为保护投资者利益,自2024年4月30日起至2024年5月10日止为本基金的赎回选择期,本基金自2024年5月11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、基金托管人中国工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5月11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	中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	中银证券创业板发起式联接	
基金主代码	012116	
基金运作方式	契约型，开放式	
基金合同生效日	2021年4月29日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
基金最后运作日（2024年4月29日）基金份额总额	17,362,431.57份	
投资目标	通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。	
投资策略	本基金为ETF联接基金，通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。通过资产配置策略、目标ETF投资策略、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、融资和转融通证券出借业务策略，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。	
业绩比较基准	创业板指数收益率×95% + 银行活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为中银证券创业板ETF的联接基金，主要通过投资于中银证券创业板ETF来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与创业板指数及中银证券创业板ETF的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。	
下属分级基金的基金简称	中银证券创业板发起式联接A	中银证券创业板发起式联接C
下属分级基金的交易代码	012116	012117
基金最后运作日（2024年4月29日）下属分级基金的份额总额	12,430,870.28份	4,931,561.29份

三、基金运作情况

本基金经证监许可[2021]1077号《关于准予中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》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2021年4月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额

总额为 11,932,998.33 份。自 2021 年 4 月 29 日至 2024 年 4 月 29 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

截至 2024 年 4 月 29 日日终，本基金的基金资产净值低于 2 亿元，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。为保护投资者利益，自 2024 年 4 月 30 日起至 2024 年 5 月 10 日止为本基金的赎回选择期，本基金自 2024 年 5 月 11 日起进入清算程序。

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：中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

报告截止日：2024 年 4 月 29 日

单位：人民币元

资产	本期末 2024 年 4 月 29 日 (最后运作日)	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	631,996.87	929,661.27
结算备付金	31,361.85	-
存出保证金	272.01	366.11
交易性金融资产	10,399,500.00	11,721,488.68
基金投资	10,399,500.00	11,721,488.68
买入返售金融资产	-	-
应收清算款	373,450.16	-
应收申购款	-	55,724.38
其他资产	-	-
资产总计	11,436,580.89	12,707,240.44
负债和净资产	本期末 2024 年 4 月 29 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	135,598.45	23,671.94
应付管理人报酬	111.93	121.22
应付托管费	37.31	40.41
应付销售服务费	535.65	692.44
应交税费	-	-
其他负债	28,314.79	30,220.07

负债合计	164,598.13	54,746.08
净资产：		
实收基金	17,362,431.57	19,399,950.90
未分配利润	-6,090,448.81	-6,747,456.54
净资产合计	11,271,982.76	12,652,494.36
负债和净资产总计	11,436,580.89	12,707,240.44

注：(1) 报告截止日 2024 年 4 月 29 日(最后运作日)，基金份额总额 17,362,431.57 份。其中中银证券创业板发起式联接 A 基金份额总额 12,430,870.28 份，基金份额净值 0.6503 元；中银证券创业板发起式联接 C 基金份额总额 4,931,561.29 份，基金份额净值 0.6465 元。

(2) 本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 4 月 29 日(最后运作日)止期间。

2、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 4 月 29 日（最后运作日）利润表（已审计）

会计主体：中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

单位：人民币元

项目	本期 自 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 4 月 29 日 (最后运作日) 止期间	上年度可比期间 2023 年度
一、营业总收入（损失以“-”填列）	-81,627.95	-2,649,043.95
1. 利息收入	1,000.35	3,855.14
其中：存款利息收入	1,000.35	3,855.14
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）	-571,584.39	-919,374.96
其中：股票投资收益	-863.52	-61,439.98
债券投资收益	-	-
基金投资收益	-570,720.87	-858,720.27
股利收益	-	785.29
3. 公允价值变动损益（损失以“-”号填列）	488,247.46	-1,735,373.74
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	708.63	1,849.61
减：二、营业总支出	1,445.56	21,446.24
1. 管理人报酬	435.23	1,468.12
2. 托管费	145.07	489.56
3. 销售服务费	2,515.26	8,280.95
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	-	-
8. 其他费用	-1,650.00	11,207.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-83,073.51	-2,670,490.19
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-83,073.51	-2,670,490.19
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	-83,073.51	-2,670,490.19

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 2412553 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 4 月 30 日（最后运作日后一日）至 2024 年 5 月 20 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、资产

本基金最后运作日货币资金余额为人民币 631,996.87 元，于清算结束日货币资金余额为人民币 10,009,350.62 元。

本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 31,361.85 元，于清算结束日结算备付金余额为人民币 42.14 元。

本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 272.01 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 0.47 元。

本基金最后运作日交易性金融资产余额为人民币 10,399,500.00 元，于清算结束日交易性金融资产余额为人民币 0.00 元。

本基金最后运作日应收清算款余额为人民币 373,450.16 元，于清算结束日应收清算款余额为人民币 0.00 元。

2、负债

本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 135,598.45 元，于清算结束日应付赎回款余额为人民币 0.00 元。

本基金最后运作日应付管理人报酬余额为人民币 111.93 元，于清算结束日应付管理人

报酬余额为人民币 111.93 元。

本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 37.31 元，于清算结束日应付托管费余额为人民币 37.31 元。

本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 535.65 元，于清算结束日应付销售服务费余额为人民币 535.65 元。

本基金最后运作日其他负债余额为人民币 28,314.79 元，于清算结束日其他负债余额为人民币 35,217.48 元。

3、损益情况

			自 2024 年 4 月 30 日 至 2024 年 5 月 20 日 (清算结束日)止期间
清算收入			
利息收入			738.80
其中：存款利息收入			738.80
其他利息收入			-
投资收益			-4,459,413.04
其中：股票投资收益			-4,691.33
基金投资收益			-4,454,794.59
股利收益			72.88
公允价值变动收益			4,367,490.46
其他收入			74.08
清算收入合计			-91,109.70
减：清算费用			-
其他费用			-
清算费用合计			-
清算净收益			-91,109.70

4、净资产情况

本基金最后运作日净资产余额为人民币 11,271,982.76 元，清算期间净收益人民币 -91,109.70 元，清算期间赎回款为人民币 1,207,382.20 元，于清算结束日净资产余额为人民币 9,973,490.86 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 9,973,490.86 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 5 月 20 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 10,009,350.62 元，结算备付金余额为人民币 42.14 元，存出保证金余额为人民币 0.47 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) 中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 4 月 29 日（最后运作日）止期间清算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创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接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。

中银证券创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

基金财产清算小组

2024 年 6 月 8 日