

中银证券瑞享定期开放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

报告送出日期：2019 年 9 月 20 日

## 一、重要提示

中银证券瑞享定期开放灵活配置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[2017]427号《关于准予中银证券瑞享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》和《中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案,中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同于2017年6月2日正式生效,基金管理人为中银国际证券股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定:

“本基金自基金合同生效之日起,在任一开放期最后一日日终(登记机构完成最后一日申购、赎回、转换业务申请的确认以后),如发生以下情形之一,则无须召开基金份额持有人大会,《基金合同》将于该日次日终止并根据本部分的约定进行基金财产清算:

- 1、基金份额持有人数量不满200人;
- 2、基金资产净值低于5000万元。”

本基金最近一个开放期自2019年6月10日至2019年7月5日,截至2019年7月5日日终,本基金出现基金资产净值低于5000万元的情形,已触发《基金合同》中约定的基金合同终止条款。根据《基金合同》的有关约定,本基金将进入基金财产的清算程序并终止,无须召开基金份额持有人大会审议。

本基金于2019年7月6日起进入清算期,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、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2019年7月6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 | 中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金 |
|------|-------------------------|

|                           |                                                                                 |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称                      | 中银证券瑞享混合                                                                        |
| 基金主代码                     | 004551                                                                          |
| 基金运作方式                    | 契约型，定期开放式                                                                       |
| 基金合同生效日                   | 2017 年 6 月 2 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                                                                    |
| 最后运作日（2019-7-5）<br>基金份额总额 | 19,591,124.98 份                                                                 |
| 投资目标                      | 在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，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、权证投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略及股指期货投资策略，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，属于中等收益风险特征的投资品种。                  |

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]427 号《关于准予中银证券瑞享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》和《中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金基金合同于 2017 年 6 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 353,568,843.58 份基金份额。自 2017 年 6 月 2 日至 2019 年 7 月 5 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：

“本基金自基金合同生效之日起，在任一开放期最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回、转换业务申请的确认以后），如发生以下情形之一，则无须召开基金份额持有人大会，《基金合同》将于该日次日终止并根据本部分的约定进行基金财产清算：

- 1、基金份额持有人数量不满 200 人；
- 2、基金资产净值低于 5000 万元。”

本基金最近一个开放期自 2019 年 6 月 10 日至 2019 年 7 月 5 日，截至 2019 年 7 月 5 日日终，本基金出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，已触发《基金合同》中约定的基

金合同终止条款。根据《基金合同》的有关约定，本基金将进入基金财产的清算程序并终止，无须召开基金份额持有人大会审议。

#### 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：中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 7 月 5 日

单位：人民币元

| 资 产               | 本期末<br>2019 年 7 月 5 日<br>(基金最后运作日) | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-------------------|------------------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b>       |                                    |                          |
| 银行存款              | 28,843,171.47                      | 721,931.38               |
| 结算备付金             | 36,987.35                          | 699,672.93               |
| 存出保证金             | 26,015.16                          | 41,847.62                |
| 交易性金融资产           | -                                  | 49,904,247.49            |
| 其中：股票投资           | -                                  | 49,619,879.49            |
| 债券投资              | -                                  | 284,368.00               |
| 买入返售金融资产          | -                                  | 7,000,000.00             |
| 应收证券清算款           | 2,899,545.97                       | 265,977.08               |
| 应收利息              | 1,078.92                           | 11,501.72                |
| 应收申购款             | 10,937.26                          | -                        |
| <b>资产总计</b>       | <b>31,817,736.13</b>               | <b>58,645,178.22</b>     |
| <b>负债和所有者权益</b>   |                                    |                          |
| <b>负 债：</b>       |                                    |                          |
| 应付赎回款             | 10,810,387.81                      | -                        |
| 应付管理人报酬           | 3,007.40                           | 30,692.62                |
| 应付托管费             | 501.23                             | 5,115.44                 |
| 应付销售服务费           | 30.21                              | 331.18                   |
| 应付交易费用            | 21,499.84                          | 10,223.06                |
| 应付税费              | 38.03                              | 35.10                    |
| 其他负债              | 153,834.49                         | 360,000.00               |
| <b>负债合计</b>       | <b>10,989,299.01</b>               | <b>406,397.40</b>        |
| <b>所有者权益：</b>     |                                    |                          |
| 实收基金              | 19,591,124.98                      | 63,897,522.31            |
| 未分配利润             | 1,237,312.14                       | -5,658,741.49            |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>20,828,437.12</b>               | <b>58,238,780.82</b>     |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>31,817,736.13</b>               | <b>58,645,178.22</b>     |

注：1. 报告截止日 2019 年 7 月 5 日，中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额总额 19,591,124.98 份，其中中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额总额 19,275,368.64 份，基金份额净值 1.0633 元；中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额总额 315,756.34 份，基金份额净值 1.0522 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 7 月 5 日(基金最后运作日)止期间。

## 2、2019 年 1 月 1 日至 2019 年 7 月 5 日（基金最后运作日）利润表（已审计）

会计主体：中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 7 月 5 日

单位：人民币元

| 项 目              | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 7 月 5 日<br>(基金最后运作日) | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 |
|------------------|------------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>      | <b>8,995,035.00</b>                                  | <b>1,295,587.71</b>                            |
| 1.利息收入           | 129,858.84                                           | 7,383,026.69                                   |
| 其中：存款利息收入        | 15,927.37                                            | 89,987.04                                      |
| 债券利息收入           | 51,955.50                                            | 6,838,981.95                                   |
| 买入返售金融资产收入       | 61,975.97                                            | 454,057.70                                     |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | 690,136.32                                           | -4,588,374.62                                  |
| 其中：股票投资收益        | 345,807.60                                           | -2,032,421.67                                  |
| 债券投资收益           | -1,572.25                                            | -3,177,866.48                                  |
| 股利收益             | 345,900.97                                           | 621,913.53                                     |
| 3.公允价值变动收益       | 8,175,021.46                                         | -1,499,064.51                                  |
| 4.其他收入           | 18.38                                                | 0.15                                           |
| <b>减：二、费用</b>    | <b>518,721.64</b>                                    | <b>3,206,683.45</b>                            |
| 1.管理人报酬          | 196,263.57                                           | 1,144,338.29                                   |
| 2.托管费            | 32,710.61                                            | 190,722.95                                     |
| 3.销售服务费          | 2,076.66                                             | 9,536.76                                       |
| 4.交易费用           | 225,668.09                                           | 244,579.93                                     |
| 5.利息支出           | 279.52                                               | 1,199,841.71                                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出    | 279.52                                               | 1,199,841.71                                   |

|                     |              |               |
|---------------------|--------------|---------------|
| 6.税金及附加             | 153.22       | 10,316.80     |
| 7.其他费用              | 61,569.97    | 407,347.01    |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 8,476,313.36 | -1,911,095.74 |
| 减：所得税费用             | -            | -             |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   | 8,476,313.36 | -1,911,095.74 |

注：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师张振波、叶尔甸签字出具了普华永道中天特审字（2019）第 2749 号标准无保留意见的审计报告。

## 五、清算情况

自 2019 年 7 月 6 日至 2019 年 8 月 8 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《中银证券瑞享定期开放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）本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 28,843,171.47 元，该部分款项由基金托管人负责保管；

（2）本基金最后运作日结算备付金人民币 36,987.35 元，2019 年 8 月 2 日结算备付金调整后为人民币 6,522.15 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。实际划付清算款时，该款项由基金管理人中银国际证券股份有限公司以自有资金先行垫付，该垫付款已于 2019 年 8 月 9 日收到，供清盘分配使用，待回款后再返还给基金管理人。

（3）本基金最后运作日存出保证金人民币 26,015.16 元，2019 年 8 月 2 日存出保证金调整后为人民币 33,121.73 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。实际划付清算款时，该款项由基金管理人中银国际证券股份有限公司以自有资

金先行垫付，该垫付款已于 2019 年 8 月 9 日收到，供清盘分配使用，待回款后再返还给基金管理人。

(4) 本基金最后运作日应收利息为人民币 1,078.92 元，2019 年 8 月 8 日应收利息为人民币 11,362.12 元，实际划付清算款时，该款项由基金管理人中银国际证券股份有限公司以自有资金先行垫付，该垫付款已于 2019 年 8 月 9 日收到，供清盘分配使用，待结息日回款后再返还给基金管理人。

(5) 本基金最后运作日应收申购款 10,937.26 元，该款项于 2019 年 7 月 8 日收到。

### 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 3,007.40 元，该款项已于 2019 年 8 月 5 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 501.23 元，该款项已于 2019 年 8 月 5 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 30.21 元，该款项已于 2019 年 8 月 5 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费为人民币 21,499.84 元，该款项已于 2019 年 8 月 5 日支付。

(5) 本基金最后运作日预提审计费用，金额为人民币 30,574.68 元，2019 年 8 月 5 日收到会计师事务所审计费发票（发票金额为 36,000.00）并支付。

(6) 本基金最后运作日预提信息披露费用，金额为人民币 120,631.50 元，2019 年 8 月 5 日收到报社信息披露费发票（发票金额为 46,700.00）并支付。

(7) 本基金最后运作日应付税费为人民币 38.03 元，该款项已于 2019 年 8 月 5 日支付。

(8) 本基金最后运作日应付赎回款人民币 10,810,387.81 元，应付赎回费人民币 2,628.31 元，其中 2019 年 7 月 8 日支付 4,841,940.45 元，2019 年 7 月 9 日支付 5,971,075.67 元。

### 4、清算期间清算损益情况

单位：人民币元

|                                   |           |
|-----------------------------------|-----------|
| 一、清算期间（2019-07-06 至 2019-08-08）收入 | 10,300.13 |
| 1.利息收入                            | 10,283.20 |
| 其中：存款利息收入（1）                      | 10,283.20 |

|                                     |            |
|-------------------------------------|------------|
| 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)                    | -          |
| 其中：股票投资收益                           | -          |
| 债券投资收益                              | -          |
| 股利收益                                | -          |
| 3.公允价值变动收益                          | -          |
| 4.其他收入（2）                           | 16.93      |
| 二、减：清算期间（2019-07-06 至 2019-08-08）费用 | -55,356.48 |
| 1.交易费用                              | -          |
| 2.其他费用（3）                           | -56,106.18 |
| 3.银行汇划费（4）                          | 749.70     |
| 三、清算期间净收益                           | 65,656.61  |

注：（1）利息收入系计提的自 2019 年 7 月 6 日至 2019 年 8 月 8 日止清算期间的银行存款及最低备付金、结算保证金利息。

（2）其他收入为自 2019 年 7 月 6 日至 2019 年 8 月 8 日止清算期间赎回费归入基金资产的部分。

（3）其他费用包括账户维护费及银行间市场清算所账户查询费用 12,400.00 元，补提审计费 5425.32 元，冲销信息披露费用 73,931.50 元。

（4）银行汇划费每月支付一次，2019 年 7 月 25 日已支付汇划费 684.70 元，2019 年 8 月 5 日预提汇划费 65.00 元，预计将于 2019 年 8 月 26 日支付。

#### 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2019 年7月5日基金净资产 | 20,828,437.12 |
| 加：清算期间净收益            | 65,656.61     |
| 减：期间赎回影响             | -7,984,111.48 |
| 2019年8月8日基金净资产       | 12,909,982.25 |

注：2019 年 7 月 5 日(基金最后运作日)提出申请并于 2019 年 7 月 8 日确认的应付赎回款及应付转出金额 7,984,068.31 元，应付赎回补差费为 26.24 元及赎回费归资产金额为 16.93 元。上述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 2019 年 8 月 8 日，本基金剩余财产为 12,909,982.25 元。自本次清算期结束次日（2019 年 8 月 9 日）至本次清算款划出前一日所产生的利息（含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) 《中银证券瑞享定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 6 月 2 日(基金合同生效日)至 2019 年 7 月 5 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》

(2) 关于《中银证券瑞享定期开放灵活配置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)。

### 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。

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

2019 年 8 月 21 日