

中银证券祥瑞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：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：2023 年 4 月 3 日

清算报告送出日：2023 年 4 月 18 日

一、重要提示

中银证券祥瑞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]1074号《关于准予中银证券祥瑞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《中银证券祥瑞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》”)的约定公开募集。经向中国证监会备案,《中银证券祥瑞混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月1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上海浦东发展银行股份有限公司。

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:“有下列情形之一的,经履行适当程序后,《基金合同》应当终止:

1、基金份额持有人大会决定终止的;2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;3、《基金合同》约定的其他情形;4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

根据基金管理人2023年2月8日发布的《中银国际证券股份有限公司关于中银证券祥瑞混合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》,本次基金份额持有人大会于2023年2月7日表决通过了《关于终止中银证券祥瑞混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。

根据《中银国际证券股份有限公司关于中银证券祥瑞混合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2023年2月9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、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2023年2月9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

基金名称	中银证券祥瑞混合型证券投资基金
基金简称	中银证券祥瑞混合
基金主代码	004917
基金运作方式	契约型、开放式

基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日	
基金管理人	中银国际证券股份有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
基金最后运作日（2023 年 2 月 8 日）基金份额总额	5,744,014.92 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极挖掘市场投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
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、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、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	中证 800 指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*45%+同期银行活期存款利率(税后)*5%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
下属分级基金的基金简称	中银证券祥瑞混合 A	中银证券祥瑞混合 C
下属分级基金的交易代码	004917	004918
基金最后运作日（2023 年 2 月 8 日）下属分级基金的份额总额	2,648,086.06 份	3,095,928.86 份

三、基金运作情况

本基金经证监许可[2017]1074 号《关于准予中银证券祥瑞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。本基金基金合同于 2018 年 2 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 395,816,196.08 份基金份额。自 2018 年 2 月 1 日至 2023 年 2 月 8 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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》、《基金合同》等有关规定，经本基金基金份额持有人大会 2023 年 2 月 7 日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于 2023 年 2 月 8 日刊登了《中银国际证券股份有限公司关于中银证券祥瑞混合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 2023 年 2 月 9 日起进入清算期。

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：中银证券祥瑞混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 2 月 8 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2023 年 2 月 8 日 (基金最后运作日)	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	1,711,498.78	2,084,081.97
结算备付金	18.30	10,751.21
存出保证金	2,716.13	2,069.01
交易性金融资产	3,836,418.60	6,488,783.05
其中：股票投资	3,836,418.60	6,488,783.05
应收申购款	1,529.89	1,448.69
资产总计	5,552,181.70	8,587,133.93
负 债 和 净 资 产	本期末 2023 年 2 月 8 日 (基金最后运作日)	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：		
应付赎回款	3,268.39	3,213.13
应付管理人报酬	808.62	4,294.28
应付托管费	134.76	715.71
应付销售服务费	71.90	481.81
其他负债	119,708.67	131,151.05
负债合计	123,992.34	139,855.98
净 资 产：		
实收基金	5,744,014.92	9,286,822.91
未分配利润	-315,825.56	-839,544.96
净资产合计	5,428,189.36	8,447,277.95
负债和净资产总计	5,552,181.70	8,587,133.93

注：1. 报告截止日 2023 年 2 月 8 日，中银证券祥瑞混合型证券投资基金基金份额总额 5,744,014.92 份，其中中银证券祥瑞混合型证券投资基金 A 类基金的份额总额 2,648,086.06 份，基金份额净值 0.9559 元；中银证券祥瑞混合型证券投资基金 C 类基金的份额总额 3,095,928.86 份，基金份额净值 0.9357 元。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 2 月 8 日(基金最后运作日)止期间。

2、2023 年 1 月 1 日至 2023 年 2 月 8 日（基金最后运作日）利润表（已审计）

会计主体：中银证券祥瑞混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 2 月 8 日

单位：人民币元

项 目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 2 月 8 日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入	328,411.77	-1,993,335.97
1.利息收入	833.71	5,935.82
其中：存款利息收入	833.71	5,935.82
2.投资收益(损失以“-”填列)	-348,438.38	-635,216.33
其中：股票投资收益	-348,311.33	-544,938.37
债券投资收益	-	-145,994.30
股利收益	-127.05	55,716.34
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	614,777.45	-1,366,303.03
4.其他收入(损失以“-”填列)	61,238.99	2,247.57
减：二、营业总支出	4,487.18	160,892.36
1.管理人报酬	4,263.88	56,894.11
2.托管费	710.59	9,482.29
3.销售服务费	424.74	6,311.82
4.税金及附加	-	4.14
5.其他费用	-912.03	88,200.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	323,924.59	-2,154,228.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	323,924.59	-2,154,228.33
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	323,924.59	-2,154,228.33

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，注册会计师薛竞、曹阳签字出具了普华永道中天特审字（2023）第 0882 号标准无保留意见的审计报告。

五、清算情况

自 2023 年 2 月 9 日至 2023 年 4 月 3 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《中银证券祥瑞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剩余财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日的银行存款余额及应计利息为人民币 1,711,498.78 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及应计利息人民币 18.30 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。

(3) 本基金最后运作日存出保证金及应计利息人民币 2,716.13 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。

(4) 本基金最后运作日股票投资为 3,836,418.60 元,自 2023 年 2 月 9 日起陆续变现,截止 2 月 15 日已全部变现。

(5) 本基金最后运作日应收申购款 1,529.89 元,该款项于 2023 年 2 月 9 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 808.62 元,该款项待支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 134.76 元,该款项已于 2023 年 3 月 30 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 71.90 元,该款项已于 2023 年 3 月 30 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费为人民币 208.67 元,该款项已于 2023 年 3 月 30 日支付。

(5) 本基金最后运作日预提审计费用金额为人民币 30,000.00 元,该款项待收到会计师事务所审计费发票后支付。

(6) 本基金最后运作日预提账户维护费 9,300.00 元,其中预提中债费用金额为人民币 4,500.00 元,该款项已于 2023 年 2 月 24 日实际支付 3,000.00 元。预提上清所费用金额为人民币 4,800.00 元,该款项已于 2023 年 2 月 24 日实际支付 3,200.00 元。

(7) 本基金最后运作日预提汇划费 200.00 元,截至 2023 年 4 月 3 日止期间实际支付 40.00 元。

(8) 本基金最后运作日预提信息披露费用金额为人民币 80,000.00 元,该款项待收到

报社信息披露费发票后支付。

(9) 本基金最后运作日应付赎回款人民币 3,268.39 元, 该款项已于 2023 年 2 月 9 日支付。

4、清算期间清算损益情况

单位：人民币元

一、清算期间（2023-02-09 至 2023-4-3）收入	92,004.29
1.利息收入	2,680.53
其中：存款利息收入（1）	2,680.53
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)	-200,864.44
其中：股票投资收益	-200,854.44
债券投资收益	
股利收益	-10.00
3.公允价值变动收益	290,138.31
4.其他收入（2）	49.89
二、减：清算期间（2023-02-09 至 2023-4-3）费用	-3,100.00
1.其他费用（3）	-3,100.00
三、清算期间净收益	95,104.29

注：（1）利息收入系计提的自 2023 年 2 月 9 日至 2023 年 4 月 3 日止清算期间的银行存款、最低备付金、结算保证金及申购款利息。

（2）其他收入为自 2023 年 2 月 9 日至 2023 年 4 月 3 日止清算期间赎回费归入基金资产的部分。

（3）其他费用为预提账户维护费 9,300.00 元与 2023 年 2 月 24 日实际支付金额 6,200.00 元的差额。

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2023年2月8日基金净资产	5,428,189.36
加：清算期间净收益	95,104.29
加：期间申购影响	2,592.94
减：期间赎回影响	190,245.43
2023年4月3日基金净资产	5,335,641.16

注：2023年2月8日(基金最后运作日)提出申请并于2023年2月9日确认的应收申购款2,592.94

元；应付赎回款及应付转出金额为190,193.13元，应付赎回费为2.41元，赎回费归资产金额为49.89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2023年4月3日，本基金剩余财产为5,335,641.16元。自本次清算期结束次日（2023年4月4日）至本次清算款划出前一日所产生的利息（含基金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）《中银证券祥瑞混合型证券投资基金2023年1月1日至2023年2月8日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

（2）关于《中银证券祥瑞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、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。

中银证券祥瑞混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2023年4月18日