

中银创新成长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：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年1月26日

清算报告公告日：2024年3月19日

一、重要提示

中银创新成长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[2022]1781号文注册募集，于2023年2月15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”），基金托管人为交通银行股份有限公司（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《中银创新成长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，基金管理人应当按照《基金合同》的约定程序进行清算并终止《基金合同》，不需要召开基金份额持有人大会。

截至2024年1月5日，本基金已连续50个工作日基金资产净值低于5000万元。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2024年1月13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2024年1月6日刊登在证监会规定报刊和基金管理人网站（www.bocim.com）的《中银基金管理有限公司关于中银创新成长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》。

本基金本次清算期间为2024年1月13日至2024年1月26日，由基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于2024年1月15日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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：中银创新成长混合型证券投资基金（基金简称：中银创新成长混合；基金代码：A类 016577、C类 016578）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2023年2月15日

4、清算起始日：2024年1月13日

5、清算起始日基金份额总额：35,870,661.54份

6、投资目标：本基金遵循成长价值投资理念，精选具有创新意识和能力、具备持续成长性、估值合理的上市公司，在控制风险的前提下，分享上市公司成长和盈利增长，追求资产净值的长期稳健增值。

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、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、港股通标的股票、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、股票期权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 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、股票期权及其他金融工具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、金融衍生工具投资策略五部分组成。

9、业绩比较基准：

中证新兴产业指数收益率×70%+恒生港股通新经济指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%

10、风险收益特征：

本基金为混合型基金，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金。

本基金若投资港股通标的股票，将面临需承担汇率风险、境外市场风险以及港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

11、基金管理人：中银基金管理有限公司

12、基金托管人：交通银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

中银创新成长混合型证券投资基金，系经中国证监会证监许可[2022]1781号文《关于准予中银创新成长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2023年2月15日正式生效，首次设立募集规模为288,621,792.22份基金份额。

根据《中银基金管理有限公司关于中银创新成长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2024年1月13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

1、资产负债表（经审计）

会计主体：中银创新成长混合型证券投资基金

单位：人民币元

| | 最后运作日 2024年1月12日 |
|------------|---------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 9,373,591.73 |

| | |
|-------------------|----------------------|
| 结算备付金 | 74,473.78 |
| 存出保证金 | 24,960.61 |
| 交易性金融资产 | 18,495,159.66 |
| 应收清算款 | 1,636,628.74 |
| 资产合计 | 29,604,814.52 |
| 负 债: | |
| 应付赎回款 | 2,769,210.72 |
| 应付管理人报酬 | 15,852.89 |
| 应付托管费 | 2,642.15 |
| 应付销售服务费 | 1,108.71 |
| 其他负债 | 229,492.84 |
| 负债合计 | 3,018,307.31 |
| 所有者权益: | |
| 实收资金 | 35,870,661.54 |
| 未分配利润 | -9,284,154.33 |
| 所有者权益合计 | 26,586,507.21 |
| 负债和所有者权益总计 | 29,604,814.52 |

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 50 个工作日出现前述情形的,基金管理人应当按照《基金合同》的约定程序进行清算并终止《基金合同》,不需要召开基金份额持有人大会。

截至 2024 年 1 月 5 日,本基金已连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。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。

2、清算起始日

根据《中银基金管理有限公司关于中银创新成长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 2024 年 1 月 13 日起,本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为 2024 年 1 月 13 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。自本基金终止日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表为截至本基金终止日的资产负债表，并无比较期间的相关数据列示。

六、基金财产分配

自 2024 年 1 月 13 日至 2024 年 1 月 26 日止的清算期间，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行本次清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

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剩余财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 9,373,591.73 元，其中托管户存款为人民币 9,373,048.47 元，应计银行存款利息为人民币 543.26 元，由于银行尚未结息，应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 74,473.78 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金为人民币 40,490.28 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金为人民币 33,637.06 元；应计结算备付金利息为人民币 346.44 元，由于银行尚未结息，该部分利息与尚未划回基金托管账户的结算备付金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 24,960.61 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币 9,963.77 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币 14,966.25 元；应计存出保证金利息为人民币 30.59 元，由于银行尚未结息，该部分利息与尚未划回基金托管账户的存出保证金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际

金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产-股票投资为人民币 16,081,778.84 元,已于 2024 年 1 月 15 日全部完成变现划入基金托管户,收回资金合计为人民币 15,888,148.75 元;交易性金融资产-债券投资为人民币 2,413,380.82 元,截至 2024 年 1 月 25 日已全部完成变现划入基金托管户,收回资金合计为人民币 2,415,127.23 元。

(5) 本基金最后运作日证券清算款为人民币 1,636,628.74 元,截至 2024 年 1 月 26 日已全部划入基金托管户。

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 15,852.89 元,已于 2024 年 1 月 19 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,642.15 元,已于 2024 年 1 月 19 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,108.71 元,已于 2024 年 1 月 19 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,769,210.72 元,已于 2024 年 1 月 15 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 229,492.84 元。其中应付交易费用为人民币 83,492.02 元,已分别于 2024 年 1 月 15 日、2024 年 1 月 19 日支付;应付赎回费为人民币 0.82 元,已于 2024 年 1 月 15 日支付;预提中债登银行账户维护费为人民币 6,000.00 元,已分别于 2024 年 1 月 15 日、2024 年 1 月 19 日支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

| 项目 | 自 2024 年 1 月 13 日至 2024 年 1 月 26 日止清算期间 |
|---------------|---|
| 一、收益 | |
| 利息收入(注 1) | 1,253.60 |
| 投资收益(注 2) | -1,679,211.41 |
| 公允价值变动收益(注 3) | 1,472,419.43 |
| 收益小计 | -205,538.38 |

| | |
|-----------|-------------|
| 二、费用 | |
| 其他费用（注 4） | -9,710.81 |
| 费用小计 | -9,710.81 |
| | |
| 三、清算期间净损益 | -195,827.57 |

注 1：利息收入系自 2024 年 1 月 13 日至 2024 年 1 月 26 日止清算期间计提的银行存款利息收入、存出保证金利息收入及结算备付金利息收入。

注 2：投资收益系自 2024 年 1 月 13 日至 2024 年 1 月 26 日止清算期间的卖出股票、债券的差价收入、利息收入及交易费用。

注 3：公允价值变动收益系自 2024 年 1 月 13 日至 2024 年 1 月 26 日止清算期间的交易性股票公允价值变动损益与交易性债券投资公允价值变动损益。

注 4：其他费用系自 2024 年 1 月 13 日至 2024 年 1 月 26 日止清算期间的银行汇划手续费，计提的清算律师费、清算审计费以及冲销的 2023 年度财务报告审计费。

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 |
|------------------------------|---------------|
| 一、最后运作日 2024 年 1 月 12 日基金净资产 | 26,586,507.21 |
| 加：清算期间净损益 | -195,827.57 |
| 减：清算期间支付赎回款、赎回费 | 7,190,271.46 |
| 二、2024 年 1 月 26 日基金净资产 | 19,200,408.18 |

资产处置及负债清偿后，于清算结束日 2024 年 1 月 26 日，本基金剩余财产为人民币 19,200,408.18 元，根据基金合同的约定，本基金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，按基金份额持有人的基金份额比例进行分配。

自清算起始日 2024 年 1 月 13 日至清算款划出日前一日的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息亦属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。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，尚未结息的利息、尚未划回基金托管账户的结算备付金及存出保证金将由基金管理人以自有

资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。基金管理人自有资金垫款产生的利息归属基金管理人所有。

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。

七、备查文件

1、备查文件目录

(1) 中银创新成长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《中银创新成长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。

中银创新成长混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年3月19日