

中银互联网+股票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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年5月8日

清算报告公告日：2021年5月17日

一、重要提示

中银互联网+股票型证券投资基金（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〔2015〕1474号文注册募集，于2015年8月6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”），基金托管人为招商银行股份有限公司（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《中银互联网+股票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60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4月23日日终，本基金已连续60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2021年4月24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4月24日《上海证券报》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互联网+股票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2021年4月24日至2021年5月6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2021年4月24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：中银互联网+股票型证券投资基金（基金简称：中银互联网+股票；基金代码：001663）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2015年8月6日

4、清算起始日：2021年4月24日

5、清算起始日基金份额总额：35,931,116.86份

6、投资目标：本基金通过深入研究互联网与传统行业及新兴产业的应用和融合趋势，基于基本面分析，优选互联网+主题相关的上市公司，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

7、投资范围：本基金的投资对象是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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证、股指期货等权益类品种，债券等固定收益类品种（包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具），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的相关规定。

本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 80-95%。本基金投资于互联网+相关主题的上市公司股票及存托凭证的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

8、投资策略：本基金的投资策略由大类资产配置策略、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、存托凭证投资策略六部分组成。

9、业绩比较基准：

中证 800 指数收益率×80% +中债综合指数收益率×20%

10、风险收益特征：

本基金为股票型证券投资基金，属于高预期风险和高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

11、基金管理人：中银基金管理有限公司

12、基金托管人：招商银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

中银互联网+股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证监会证监许可（2015）1474 号文《关于准予中银互联网+股票型证券投资基金注册的批复》，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 2015 年 8 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 239,365,619.27 份基金份额。

根据《中银基金管理有限公司关于中银互联网+股票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 4 月 24 日起，本基金进入清算程序，停止办理申购、赎回、转换等业务。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费等费用。

四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：中银互联网+股票型证券投资基金

	最后运作日 2021 年 4 月 23 日
资产：	
银行存款	2,783,684.46

结算备付金	43,749.51
存出保证金	18,003.65
交易性金融资产	41,642,117.26
其中：股票投资	38,861,103.13
债券投资	2,781,014.13
应收利息	40,560.86
应收申购款	11,316.67
资产总计	44,539,432.41
负债：	
应付赎回款	757,860.39
应付管理人报酬	43,035.84
应付托管费	7,172.64
应付销售服务费	-
应付交易费用	15,911.07
应付税费	0.43
应付利润	-
其他负债	179,142.51
负债合计	1,003,122.88
所有者权益：	
实收基金	35,931,116.86
未分配利润	7,605,192.67
所有者权益合计	43,536,309.53
负债和所有者权益总计	44,539,432.41

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”及“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”之“二、《基金合同》的终止事由”的约定，《基金合同》生效后，连续60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4月23日日终，本基金已连续60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互联网+股票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4月24日起，本基金进入清算程序。本次清算期间为2021年4月24日至2021年5月6日，由于本基金持有的部分未上市股票无法确定变现时间，本基金将在未上市股票变现后按照基金份额持有人持有的基金份额比例进行二次分配，二次分配的时间安排将根据未上市股票的变现时间确定。

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2021年4月24日至2021年5月6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、资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日存出保证金为人民币18,003.65元，该款项将于二次分配时再向基金份额持有人分配。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币43,749.51元，该款项将于二次分配时再向基金份额持有人分配。
- (3) 本基金最后运作日应收活期存款利息为人民币1,441.73元，截至2021年5月6日应收活期存款利息余额为人民币3,886.53元，该款项将于二次分配时再向基金份额持有人分配。
- (4) 本基金最后运作日应收结算备付金利息为人民币89.44元，截至2021年5月6日应收结算备付金利息余额为人民币114.92元，该款项将于二次分配时再向基金份额持有人分配。
- (5) 本基金最后运作日应收存出保证金利息为人民币27.06元，截至2021年5月6日应收存出保证金利息余额为人民币37.59元，该款项将于二次分配时再向基金份额持有人分配。
- (6) 本基金最后运作日应收认申购款利息为人民币0.38元，截至2021年5月6日应

收认申购款利息余额为人民币0.38元，该款项将于二次分配时再向基金份额持有人分配。

- (7) 本基金最后运作日应收交易类债券利息为人民币39,002.25元，2021年4月30日本基金已处置其对应债券并收回全部应收交易类债券利息。
- (8) 本基金最后运作日应收申购款为人民币11,316.67元，该款项已于2021年4月26日划入托管账户。
- (9) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币41,642,117.26元，该金额为各只股票和债券的最后运作日估值金额之和。其中，股票资产为人民币38,861,103.13元，债券资产为人民币2,781,014.13元，具体情况如下：

1) 已上市股票处置情况：

本基金最后运作日持有的所有已上市股票已于清算期间完成处置变现，变现实际收到的证券清算款共计人民币40,408,821.14元。

2) 未上市股票处置情况

本基金最后运作日持有的所有未上市股票明细如下：

股票代码	股票名称	最后运作日 估值单价	数量 (单位:股)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
600906	财达证券	3.76	5,208.00	19,582.08	19,582.08
605080	浙大自然	31.16	243.00	7,571.88	7,571.88
605089	味知香	28.53	247.00	7,046.91	7,046.91
605180	华生科技	22.38	223.00	4,990.74	4,990.74
605289	罗曼股份	27.27	300.00	8,181.00	8,181.00
605300	佳禾食品	11.25	532.00	5,985.00	5,985.00
001201	东瑞股份	63.38	318.00	20,154.84	20,154.84
001202	炬申股份	15.09	310.00	4,677.90	4,677.90

待未上市股票上市后，基金管理人将及时变现未上市股票，并于之后二次分配时再向基金份额持有人分配。其中在清算期间（2021年4月24日至2021年5月6日）上市的股票，已于清算期间完成处置变现，截止清算结束日（2021年5月6日）变现实际收到的证券清算款共计人民币48,207.83元，应收证券清算款共计人民币33,502.15元。

3) 债券处置情况：

本基金最后运作日持有的所有债券已于2021年4月30日卖出，变现实际收到的证券清算款共计人民币2,826,088.90元。

2、负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币757,860.39元，该款项已于2021年4月26日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币43,035.84元，该款项已于2021年4月29日支付。

- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币7,172.64元, 该款项已于2021年4月29日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付交易费为人民币15,911.07元, 该款项将于本次清算结束后支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 179,142.51 元。系应付赎回费人民币 216.74 元以及预提费用人民币 178,925.77 元, 其中应付赎回费人民币 216.74 元已于 2021 年 4 月 26 日支付; 预提费用中, 预提审计费人民币 30,000.00 已于 2021 年 4 月 30 日支付, 预提中债登银行账户维护费人民币 1,500.00 元已于 2021 年 4 月 29 日支付, 预提上证报信息披露费人民币 147,000.00 和预提银行汇划费人民币 425.77 元将于本次清算结束后支付。

	自2021年4月24日 至2021年5月6日 止清算期间
3、清算期间的清算损益情况项目	
一、收益	
1、利息收入 注1	4,016.99
2、投资收益	650,381.28
3、公允价值变动损益	-448,223.58
4、其他收入	240.31
收益小计	206,415.00
二、费用	
1、交易费用	83,063.40
2、其他费用 注2	35,070.00
费用小计	118,133.40
三、清算期间净损益	88,281.60

注1: 利息收入系计提的自2021年4月24日至2021年5月6日止清算期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入、存出保证金利息收入及交易类债券利息收入。

注2: 其他费用系自2021年4月24日至2021年5月6日止清算期间计提的审计费、律师费和银行汇划费。

4、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2021年4月23日基金净资产	43,536,309.53
加: 自2021年4月24日至2021年5月6日止	88,281.60

清算期间净损益	
加：清算期间收到申购款	10,869.27
减：清算期间支付赎回、转出款	74,700.63
二、2021年5月6日基金净资产	43,560,759.77

于2021年5月6日本基金剩余财产为人民币43,560,759.77元，根据本基金的基金合同及《中银基金管理有限公司关于中银互联网+股票型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》的约定，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5月6日银行存款人民币43,644,710.10元，将在扣除银行汇划费及各项应付负债后按基金份额持有人的基金份额比例进行分配；结算备付金人民币43,749.51元，存出保证金人民币18,003.65元，应收利息人民币4,039.42元，应收证券清算款人民币46,842.96元尚未划入托管账户，将于本次清算期后划入；交易性金融资产人民币25,500.68元（该金额为未上市股票的成本，与实际变现金额可能存在差异），将根据实际变现情况在二次分配时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5月6日应付交易费用人民币54,660.28元，应交税费人民币0.50元，预提上证报信息披露费人民币147,000.00元，预提银行汇划费人民币425.77元，以及预提律师费人民币20,000.00元，均将于本次清算期后支付。

本次清算期结束日次日2021年5月7日至二次分配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。

5、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) 中银互联网+股票型证券投资基金清算报告
- (2) 上海市通力律师事务所关于《中银互联网+股票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。

中银互联网+股票型证券投资基金基金财产清算小组

2021年5月8日