

# 中银新蓝筹灵活配置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：中信银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年6月23日

清算报告公告日：2021年7月12日

## 一、重要提示

中银新蓝筹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〔2016〕719号文注册募集，于2017年5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”），基金托管人为中信银行股份有限公司（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《中银新蓝筹灵活配置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5000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，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6月4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6月5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6月5日《中国证券报》和基金管理人网站（[www.bocim.com](http://www.bocim.com)）的《中银基金管理有限公司关于中银新蓝筹灵活配置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》。

本基金清算期为2021年6月5日至2021年6月23日，由基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于2021年6月5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

1、基金名称：中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：中银新蓝筹混合；基金代码：002694）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2017年5月15日

4、清算起始日：2021年6月5日

5、清算起始日基金份额总额：10,645,161.68份

6、投资目标：本基金将重点把握处于不同发展阶段、具有良好成长性的各类蓝筹股或潜在蓝筹股投资机遇，在严格控制风险的基础上，结合精选个股策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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、股票期权等权益类品种，债券等固定收益类品种（包括国债、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（含可分离交易可转债）、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等）、国债期货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0%-95%，投资于本基金所定义的新蓝筹主题上市公司发行的股票及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约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。股指期货、国债期货和股票期权合约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。

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、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略六部分组成。

9、业绩比较基准：

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%

10、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，属于中等风险水平的投资品种。

11、基金管理人：中银基金管理有限公司

12、基金托管人：中信银行股份有限公司

### 三、基金运作情况概述

中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证监会证监许可〔2016〕719 号文《关于准予中银新蓝筹灵活配置混合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 2017 年 5 月 15 日正式生效，首次设立募集规模为 262,402,038.87 份基金份额。

根据《中银基金管理有限公司关于中银新蓝筹灵活配置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 2021 年 6 月 5 日起，本基金进入清算程序，停止办理申购、赎回、转换及定投等业务。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

1、2021年6月4日(基金最后运作日)资产负债表(经审计)

会计主体: 中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

资 产	本期末 2021年6月4日 (基金最后运作日)	上年度末 2020年12月31日
<b>资 产:</b>		
银行存款	4,847,549.98	7,014,876.83
结算备付金	83,398.34	26,032.45
存出保证金	27,212.54	20,220.75
交易性金融资产	12,713,120.17	51,937,608.24
其中: 股票投资	11,899,876.27	48,735,244.20
债券投资	813,243.90	3,202,364.04
应收证券清算款	344,578.38	474,154.81
应收利息	24,078.41	67,553.35
应收申购款	46,433.15	17,636.08
<b>资产总计</b>	<b>18,086,370.97</b>	<b>59,558,082.51</b>
<b>负债和所有者权益</b>		
<b>负 债:</b>		
应付证券清算款	-	267,888.55
应付赎回款	659,628.68	6,403.37
应付管理人报酬	3,958.41	68,858.87
应付托管费	659.73	11,476.48
应付交易费用	40,477.61	22,327.98
应交税费	-	0.65
其他负债	38,139.44	164,509.31
<b>负债合计</b>	<b>742,863.87</b>	<b>541,465.21</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	10,645,161.68	34,035,332.64
未分配利润	6,698,345.42	24,981,284.66
<b>所有者权益合计</b>	<b>17,343,507.10</b>	<b>59,016,617.30</b>
<b>负债和所有者权益总 计</b>	<b>18,086,370.97</b>	<b>59,558,082.51</b>

注:

1. 报告截止日 2021 年 6 月 4 日(基金最后运作日), 基金份额净值 1.629 元, 基金份额总额 10,645,161.68 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 4 日(基金最后运作日)止期间。

2、2021年1月1日至2021年6月4日(基金最后运作日)止期间的利润表  
 会计主体：中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

项目	本期 2021年1月1日 至 2021年6月4日 (基金最后运作 日)	上年度可比期间 2020年1月1日 至 2020年12月31日
<b>一、收入</b>	<b>-2,003,642.40</b>	<b>32,749,946.73</b>
利息收入	43,018.43	169,104.31
其中：存款利息收入	17,931.34	51,655.33
债券利息收入	25,087.09	117,448.98
买入返售金融资产收入	-	-
投资收益(损失以“-”填列)	14,862,961.39	25,435,465.11
其中：股票投资收益	14,747,850.80	25,059,829.79
债券投资收益	25,335.75	-50,854.34
股利收益	89,774.84	426,489.66
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-16,986,611.07	6,954,268.27
其他收入	76,988.85	191,109.04
<b>减：二、费用</b>	<b>565,133.43</b>	<b>1,726,366.67</b>
管理人报酬	306,255.44	932,499.18
托管费	51,042.53	155,416.45
交易费用	165,025.44	458,795.06
利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
税金及附加	0.20	0.15
其他费用	42,809.82	179,655.83
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	<b>-2,568,775.83</b>	<b>31,023,580.06</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>-2,568,775.83</b>	<b>31,023,580.06</b>

3、2021年1月1日至2021年6月4日(基金最后运作日)止期间的  
所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月4日(基金最后运作日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	34,035,332.64	24,981,284.66	59,016,617.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,568,775.83	-2,568,775.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-23,390,170.96	-15,714,163.41	-39,104,334.37
其中：1.基金申购款	9,724,383.63	8,222,676.65	17,947,060.28
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-33,114,554.59	-23,936,840.06	-57,051,394.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	10,645,161.68	6,698,345.42	17,343,507.10
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	110,679,364.34	8,663,431.86	119,342,796.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,023,580.06	31,023,580.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-76,644,031.70	-14,705,727.26	-91,349,758.96
其中：1.基金申购款	23,573,751.81	6,783,931.39	30,357,683.20
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-100,217,783.51	-21,489,658.65	-121,707,442.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	34,035,332.64	24,981,284.66	59,016,617.30

## 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 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 万元的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 60 个工作日出现前述情形的,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 6 月 4 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新蓝筹灵活配置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 2021 年 6 月 5 日起,本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为 2021 年 6 月 5 日。

### 3、清算报告编制基础

自 2021 年 6 月 5 日起,本基金进入清算程序,因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2021 年 6 月 4 日(基金最后运作日),所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量,负债以预计需要清偿的金额计量。

此外,本基金财务报表按照中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

## 六、基金财产分配

自 2021 年 6 月 5 日至 2021 年 6 月 23 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,全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体



清算情况如下：

### 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财产中支付。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 83,398.34 元，由于中登结算制度影响，将于清算期间后划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 27,212.54 元，由于中登结算制度影响，将于清算期间后划入托管账户。

(3) 本基金于 2021 年 6 月 7 日将最后运作日持有的交易性债券投资变现，变现金额为人民币 828,821.49 元。本基金分别于 2021 年 6 月 7 日和 2021 年 6 月 8 日将最后运作日持有的交易性股票投资变现，变现金额为人民币 11,652,409.41 元。已于清算期间划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收利息为人民币 24,078.41 元，除去应收债券利息人民币 15,516.05 元外，应收银行存款利息人民币 8,353.97 元，应收结算备付金利息人民币 136.36 元及应收存出保证金利息人民币 71.03 元，应收申购款利息 1.00 元，共计人民币 8,562.36 元，已于 2021 年 6 月 21 日划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 46,433.15 元，该款项已于 2021 年 6 月 7 日划入托管账户。

### 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 3,958.41 元，该款项已于 2021 年 6 月 15 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 659.73 元，该款项已于 2021 年 6 月 15 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 659,628.68 元，该款项已于 2021 年 6 月 7 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回费为人民币 639.44 元，该款项已于 2021 年 6 月 7 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 40,477.61 元，已于 2021 年 6 月 15 日支付。

(6) 本基金最后运作日预提费用为人民币 37,500.00 元。其中预提信息披露费为人民币 33,000.00 元，已于 2021 年 6 月 23 日支付；预提账户维护费为人民币 4,500.00 元，该款项已于 2021 年 6 月 15 日支付。

(7) 自 2021 年 6 月 5 日本基金进入清算期至本财务报表批准报出日(2021 年 6 月 23 日)止期间，产生清算审计费用为人民币 18,000.00 元，已于 2021 年 6 月 23 日支付。

(8) 自 2021 年 6 月 5 日本基金进入清算期至本财务报表批准报出日(2021 年 6 月 23 日)止期间，产生清算律师费用为人民币 20,000.00 元，已于 2021 年 6 月 21 日支付。

#### 4、清算期间的清算损益情况

项目	自2021年6月04日 至2021年6月23日 止清算期间 金额（单位：人民币元）
一、收益	
利息收入（注 1）	5,579.48
交易性金融资产公允价值变动损益	-2,693,774.48
交易性金融资产投资收益	2,447,718.54
赎回、转换手续费收入	746.97
收益小计	-239,729.49
二、费用	
1、交易费用	23,458.86
2、清算期间费用（注 2）	38,000.00
费用小计	61,458.86
三、清算期间净收益	-301,188.35

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2021年6月4日至2021年6

月23日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息、结算备付金利息、债券利息。

注2：本基金清算期间的审计费、律师费由基金承担。

#### 5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额（单位：人民币元）
一、最后运作日 2021 年 6 月 4 日基金净资产	17,343,507.10
加：清算期间净收益	-301,188.35
加：清算期间支付申购、赎回款轧差	358,520.45
二、2021 年 6 月 23 日基金净资产	16,683,798.30

资产处置及负债清偿后，本基金于2021年6月23日剩余财产为人民币16,683,798.30元，根据本基金的基金合同约定，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。

清算起始日2021年6月5日至清算款划出日前一日的存款利息、结算备付金、存出保证金利息亦属基金份额持有人所有。该部分利息以及未到账的结算备付金、存出保证金将由基金管理人以自有资金垫付。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

#### 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。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

- (1) 中银新蓝筹灵活配置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《中银新蓝筹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。

中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2021年6月23日