

银华中债-5年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金
清算报告

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告公告日：2020年11月4日

目录

重要提示.....	3
一、基金概况.....	3
二、基金运作情况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清算情况.....	7
五、备查文件.....	9

重要提示

银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已于 2016 年 11 月 23 日获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]2785 号文准予注册，自 2017 年 4 月 17 日起《银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）生效，基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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，本基金基金份额持有人大会于 2020 年 7 月 27 日以通讯方式表决通过了《关于终止银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数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。本基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告详见 2020 年 7 月 28 日刊登在规定媒介上的《银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

本基金自 2020 年 8 月 4 日起进入财产清算期，基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2020 年 8 月 4 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

一、基金概况

基金名称	银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金
基金简称	银华中债 5 年期金融债指数

基金代码	A 类代码：003989，C 类代码：003990
基金运作方式	契约型开放式。
基金投资目标	本基金通过指数化投资，力争实现对标的指数的有效跟踪，力求跟踪偏离度以及跟踪误差最小化。
业绩比较基准	95%×中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金是债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用抽样复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。
基金合同生效日	2017 年 4 月 17 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司

二、基金运作情况

本基金的募集已于 2016 年 11 月 23 日获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]2785 号文准予注册，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2017 年 4 月 5 日至 2017 年 4 月 12 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2017 年 4 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 221,003,740.27 份（含募集期间利息结转的份额），自 2017 年 4 月 17 日至 2020 年 8 月 3 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，本基金基金份额持有人大会于 2020 年 7 月 27 日以通讯方式表决通过了《关于终止银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债

指数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。本基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告详见 2020 年 7 月 28 日刊登在规定媒介上的《银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

本基金自 2020 年 8 月 4 日起进入财产清算期，基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2020 年 8 月 4 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

三、财务会计报告

1、清算期间

银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金的清算期间为 2020 年 8 月 4 日至 2020 年 9 月 22 日止。

2、清算报表编制基础

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。基金管理人编制清算报表是为了呈报银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金全体持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的数据列示。

清算资产负债表

单位：人民币元

项目	2020 年 8 月 3 日 (最后运作日)

资产：	
银行存款	32,211,885.97
结算备付金	114,010.10
存出保证金	667.32
应收利息	3,206.68
资产总计	32,329,770.07
负债：	
应付赎回款	20,675,611.21
应付管理人报酬	11,098.57
应付托管费	3,414.92
应付销售服务费	2,097.92
应付交易费用	3,025.00
其他负债	48,920.77
负债合计	20,744,168.39
所有者权益：	
实收基金	9,939,245.59
未分配利润	1,646,356.09
所有者权益合计	11,585,601.68
负债和所有者权益总计	32,329,770.07

清算损益表

单位：人民币元

项目	2020年8月4日(清算开始日)至 2020年9月22日 (清算结束日)止期间
一、收入	5,578.83
1.利息收入	5,578.83
其中：存款利息收入	5,578.83
二、费用	3,300.64
1.管理人报酬	-
2.基金托管费	-
3.其他费用	3,300.64
三、利润总额	2,278.19
减：所得税费用	-
四、净利润	2,278.19

四、清算情况

自2020年8月4日至2020年9月22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、资产处置情况

本基金2020年8月3日(最后运作日)应收利息为人民币3,206.68元，包括应收银行存款利息人民币2,989.87元、应收结算备付金利息人民币215.49元、应收结算保证金利息人民币1.32元。截至2020年9月22日(清算结束日)应收利息余额为人民币222.64元，均为应收银行存款利息，该款项将由本基金管理人在清算款划出托管账户前以自有资金垫付至托管账户，垫付资金到账起孳生的利息归基金管理人所有。

2、负债清偿情况

(1) 本基金2020年8月3日(最后运作日)的应付赎回款为人民币20,675,611.21元，应付管理人报酬为人民币11,098.57元，应付托管费为人民币3,414.92元，应付销售服务费为人民币2,097.92元，以上款项均已于清算期间支付。

(2) 本基金2020年8月3日(最后运作日)的应付交易费用为人民币3,025.00元，该款项截至2020年9月22日(清算结束日)尚未支付完毕，余额为人民币475.00元。

(3) 本基金2020年8月3日(最后运作日)的其他负债中人民币47,213.28元为预提信息披露费；人民币1,707.49元为指数使用费，以上款项均已于清算期间支付。

3、资产处置及负债清偿后剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
----	----

一、2020 年 8 月 3 日(最后运作日)所有者权益	11,585,601.68
加：清算期间净收益	2,278.19
减：基金净赎回金额(于 2020 年 8 月 4 日确认的 投资者赎回申请)	137,590.87
二、2020 年 9 月 22 日(清算结束日)所有者权益	11,450,289.00

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(本基金清算费用由基金管理人承担)、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。自 2020 年 9 月 22 日(清算结束日)次日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息属于基金份额持有人所有，按实际适用的利率计算。本基金管理人将于清算款划出托管账户前以自有资金垫付上述利息至托管账户，垫付资金到账日起孳生的利息归本基金管理人所有。

4、根据《银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金进入清算程序后，不再计提基金管理费、基金托管费、销售服务费和指数许可使用费。

五、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、《银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金清算事宜之法律意见》

(二) 存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。