

银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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：中国建设银行股份有限公司

清算报告公告日：2021 年 1 月 7 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.....	6
五、备查文件.....	9

重要提示

银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）的募集已于 2012 年 6 月 8 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[2012]783 号文核准募集，自 2012 年 8 月 29 日起《银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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 9 月 22 日以通讯方式表决通过了《关于终止银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接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 9 月 23 日刊登在规定媒介上的《关于银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接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 9 月 24 日起进入财产清算期，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）和上海市通力律师事务所于 2020 年 9 月 24 日成立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	银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	银华上证 50 等权 ETF 联接

基金主代码	180033
基金运作方式	契约型开放式。
基金投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
业绩比较基准	95%×上证 50 等权重指数收益率+5%×商业银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与预期收益水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金为上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。
基金合同生效日	2012 年 8 月 29 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
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 2012 年 6 月 8 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[2012]783 号文核准募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2012 年 7 月 23 日至 2012 年 8 月 24 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2012 年 8 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 285,685,340.76 份（含募集期间利息结转的份额），自 2012 年 8 月 29 日至 2020 年 9 月 23 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 9 月 22 日以通讯方式表决通过了《关于终止银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基

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 9 月 23 日刊登在规定媒介上的《关于银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接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 9 月 24 日起进入财产清算期，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）和上海市通力律师事务所于 2020 年 9 月 24 日成立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

银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金的清算期间为 2020 年 9 月 24 日至 2020 年 12 月 15 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上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接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相关数据列示。

清算资产负债表

单位：人民币元

	最后运作日 2020 年 9 月 23 日
资 产：	
银行存款	4,396,447.16
结算备付金	536.96

存出保证金	2,604.94
交易性金融资产	77,185,565.68
应收证券清算款	437,116.76
应收利息	937.36
资产总计	82,023,208.86
负 债：	
应付赎回款	677,578.90
应付管理人报酬	1,527.28
应付托管费	305.47
应付交易费用	5,754.33
其他负债	58,792.76
负债合计	743,958.74
所有者权益：	
实收基金	55,535,917.37
未分配利润	25,743,332.75
所有者权益合计	81,279,250.12
负债和所有者权益总计	82,023,208.86

四、清算情况

自 2020 年 9 月 24 日至 2020 年 12 月 15 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

(1) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 2,604.94 元，该款项已于 2020 年 10 月 12 日划至托管账户。结算备付金为人民币 536.96 元，已分别于 2020 年 10 月 12 日和 2020 年 11 月 3 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 437,116.76 元，为最后运作日处置股票投资产生，该款项已于 2020 年 9 月 24 日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 937.36 元，其中应收银行活期存款利息为人民币 128.23 元，应收清算备付金利息为人民币 0.06 元，应收存出保证金利息为人民币 0.36 元，应收申购款利息为人民币 38.41 元，应收债券利息为人民币 770.30 元。截至清算期结束日，应收利息余额为人民币 4,307.53 元，该款项将由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 77,185,565.68 元，分别为债券投资和基金投资，明细如下：

金额单位：人民币元

类型	名称	代码	最后运作日 估值单价	数量	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
债券投资	21 国债(7)	010107	101.67	1,200	122,748.00	122,004.00
基金投资	银华上证 50 等权 ETF	510430	1.7460	44,137,206	68,245,172.18	77,063,561.68
合计				44,138,406	68,367,920.18	77,185,565.68

以上投资于清算期处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 76,157,427.61 元，已于清算期间划入托管账户。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日的应付赎回款人民币 677,578.90 元, 应付管理人报酬人民币 1,527.28 元、应付托管费人民币 305.47 元和应付交易费用人民币 5,754.33 元, 已于清算期内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币 58,792.76 元, 包含预提信息披露费人民币 58,360.86 元, 应付赎回费人民币 431.90 元, 已于清算期内支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2020年9月24日至 2020年12月15日止 清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	4,238.51
处置交易性金融资产产生的净损失（注2）	-1,029,006.28
股息红利个税（注3）	-24.41
清算期间收益小计	-1,024,792.18
二、清算期间费用	
卖出债券交易费用	0.13
汇划费	215.00
清算期间费用小计（注4）	215.13
三、清算期间净收益	-1,025,007.31

注 1: 利息收入系计提的自 2020 年 9 月 24 日至 2020 年 12 月 15 日止清算期间的银行存款利息、清算备付金利息、存出保证金利息及债券利息。

注 2: 处置交易性金融资产产生的净损失系清算期间卖出债券成交金额减去卖出债券最后运作日的估值总额后的差额及持有的上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金清算后分配财产金额减去最后运作日的估值额后的差额。

注 3: 股息红利个税系根据《股息红利差别化纳税会计核算细则》(中基协发[2012]21号), 于最后运作日转让交割股票后的次一交易日, 根据中登公司按投资者实际持股期限计算的应缴税额计提应缴税款而确认的红字股利收益。

注 4: 除上述清算费用外的其他与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担, 不从基金财产中支付。

4、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位: 人民币元

项目	金额
最后运作日2020年9月24日基金净资产	81,279,250.12
加: 清算期间净收益	-1,025,007.31
2020年12月15日基金净资产	80,254,242.81

截至清算期结束日 2020 年 12 月 15 日, 本基金剩余财产为人民币 80,254,242.81 元。自清算期结束日次日 2020 年 12 月 16 日至清算款划出日前一日的银行存款等产生的利息亦属份额持有人所有, 按实际适用的利率计算, 由基金管理人以自有资金垫付并将于清算款划出前划入托管账户。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。

五、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、《银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算审计报告》
- 2、《关于〈银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告〉的法律意见》

（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。