

银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金  
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：交通银行股份有限公司

清算报告公告日：2021年8月18日

## 目录

重要提示.....	3
一、基金概况.....	4
二、基金运作情况.....	5
三、财务会计报告.....	6
四、清算情况.....	7
五、备查文件.....	15

## 重要提示

银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已于 2017 年 11 月 14 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[2017]2068 号文准予注册，自 2018 年 5 月 11 日起《银华中小市值量化优选股票型发起式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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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”部分约定：“基金合同生效之日起三年后的对应自然日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”

本基金《基金合同》生效日为 2018 年 5 月 11 日。截至 2021 年 5 月 11 日，本基金《基金合同》生效满 3 年，经本基金登记机构确认，截至《基金合同》生效之日起三年后的对应自然日（即 2021 年 5 月 11 日），本基金基金资产净值低于 2 亿元。为保护基金份额持有人利益，根据本基金《基金合同》的约定，本基金管理人拟终止《基金合同》并对基金财产进行清算，上述事项不需召开基金份额持有人大会审议，具体情况详见 2021 年 5 月 12 日刊登在规定媒介上的《银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自 2021 年 6 月 16 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 2021 年 6 月 16 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	银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金
A类基金份额简称	银华中小市值量化优选股票发起式A
C类基金份额简称	银华中小市值量化优选股票发起式C
基金代码	A类代码：005515，C类代码：005516
基金运作方式	契约型开放式。
基金投资目标	本基金综合使用多种量化选股策略，重点投资于有良好成长潜力的中小市值上市公司，在严格控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
业绩比较基准	中证1000指数收益率×85%+商业银行活期存款利率（税后）×15%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。
基金合同生效日	2018年5月11日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
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 2017 年 11 月 14 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[2017]2068 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 2018 年 4 月 9 日至 2018 年 5 月 4 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2018 年 5 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 11,038,967.21 份（含募集期间利息结转的份额），自 2018 年 5 月 11 日至 2021 年 6 月 15 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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”部分约定：“基金合同生效之日起三年后的对应自然日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”

本基金《基金合同》生效日为 2018 年 5 月 11 日。截至 2021 年 5 月 11 日，本基金《基金合同》生效满 3 年，经本基金登记机构确认，截至《基金合同》生效之日起三年后的对应自然日（即 2021 年 5 月 11 日），本基金基金资产净值低于 2 亿元。为保护基金份额持有人利益，根据本基金《基金合同》的约定，本基金管理人拟终止本基金《基金合同》并已对基金财产进行清算，上述事项不需召开基金份额持有人大会审议，具体情况详见 2021 年 5 月 12 日刊登在规定媒介上的《银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自 2021 年 6 月 16 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 2021 年 6 月 16 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

银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金的清算期间为 2021 年 6 月 16 日至 2021 年 7 月 30 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小市值量化优选股票型发起式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相关数据列示。

#### 清算资产负债表

单位：人民币元

项目	2021 年 6 月 15 日 (最后运作日)
<b>资产：</b>	
银行存款	1,034,506.94
结算备付金	51,152.84
存出保证金	-
交易性金融资产	11,458,269.58
应收利息	1,327.14

资产总计	12,545,256.50
<b>负债:</b>	
应付证券清算款	-
应付赎回款	24,606.57
应付管理人报酬	5,102.43
应付托管费	1,020.50
应付销售服务费	91.25
应付交易费用	34,771.90
其他负债	40,016.77
负债合计	105,609.42
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	10,805,417.97
未分配利润	1,634,229.11
所有者权益合计	12,439,647.08
负债和所有者权益总计	12,545,256.50

#### 四、清算情况

自2021年6月16日至2021年7月30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) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 51,152.84 元，全部款项已于 2021 年 7 月 2 日划至托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币 1,327.14 元，包括应收银行存款利息人民币 779.23 元、应收结算备付金利息人民币 520.16 元、应收存出保证金利息人民币 15.15 元及应收认申购款利息人民币 12.60 元，其中应收认申购款利息已于 2021 年 6 月 24 日划至托管账户，剩余款项已于 2021 年 6 月 21 日划至托管账户。

(3) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 11,458,269.58 元，全部为股票投资，明细如下：

金额单位：人民币元

交易平 台	股票名称	股票代 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
上交所	皖维高新	600063	5.00	8,300	33,864.00	41,500.00
上交所	冠城大通	600067	3.46	6,948	23,541.12	24,040.08
上交所	新疆天业	600075	7.77	2,834	19,963.76	22,020.18
上交所	海泰发展	600082	2.89	14,400	41,760.00	41,616.00
上交所	易见股份	600093	5.93	2,785	22,026.78	16,515.05
上交所	云天化	600096	13.70	12,572	90,200.90	172,236.40
上交所	诺德股份	600110	10.67	9,200	66,056.00	98,164.00
上交所	中青旅	600138	10.50	3,000	34,361.00	31,500.00
上交所	华创阳安	600155	10.13	1,384	14,387.15	14,019.92
上交所	中闽能源	600163	5.05	5,000	23,550.00	25,250.00
上交所	福日电子	600203	8.32	4,696	37,727.72	39,070.72
上交所	赣粤高速	600269	3.34	21,800	79,978.00	72,812.00
上交所	南钢股份	600282	3.66	4,900	21,805.00	17,934.00
上交所	江苏舜天	600287	5.23	3,400	17,179.00	17,782.00
上交所	恒顺醋业	600305	19.30	7,100	131,619.00	137,030.00
上交所	瀚蓝环境	600323	22.46	4,598	108,934.88	103,271.08
上交所	北巴传媒	600386	3.54	12,764	46,620.02	45,184.56
上交所	盛和资源	600392	16.02	1,300	22,217.00	20,826.00
上交所	盘江股份	600395	7.53	9,968	69,776.27	75,059.04
上交所	三友化工	600409	10.76	1,800	22,626.00	19,368.00
上交所	宝钛股份	600456	43.80	2,083	79,213.58	91,235.40
上交所	百利电气	600468	4.04	17,500	68,600.00	70,700.00



上交所	精工钢构	600496	4.03	20,200	92,581.00	81,406.00
上交所	精达股份	600577	5.42	7,500	30,804.30	40,650.00
上交所	金晶科技	600586	7.05	3,700	26,268.00	26,085.00
上交所	龙溪股份	600592	10.39	5,600	56,393.00	58,184.00
上交所	光明乳业	600597	15.11	7,200	133,497.00	108,792.00
上交所	新黄浦	600638	5.67	10,600	60,632.00	60,102.00
上交所	亚通股份	600692	6.24	2,100	13,713.00	13,104.00
上交所	凤凰股份	600716	4.20	5,200	25,012.00	21,840.00
上交所	首商股份	600723	8.49	2,300	18,649.00	19,527.00
上交所	爱旭股份	600732	12.50	10,343	121,979.01	129,287.50
上交所	江中药业	600750	11.06	8,648	92,215.60	95,646.88
上交所	安徽合力	600761	11.68	6,075	75,545.21	70,956.00
上交所	西藏城投	600773	13.78	1,200	12,588.00	16,536.00
上交所	水井坊	600779	126.13	200	20,192.00	25,226.00
上交所	新钢股份	600782	5.95	3,000	20,220.00	17,850.00
上交所	渤海化学	600800	4.69	3,649	18,495.83	17,113.81
上交所	华新水泥	600801	20.33	1,000	23,122.00	20,330.00
上交所	新奥股份	600803	16.36	5,395	81,010.13	88,262.20
上交所	银座股份	600858	6.29	2,800	18,057.00	17,612.00
上交所	梅花生物	600873	5.89	18,100	109,636.00	106,609.00
上交所	妙可蓝多	600882	74.23	200	14,894.00	14,846.00
上交所	博闻科技	600883	8.55	3,700	32,264.00	31,635.00
上交所	爱柯迪	600933	14.41	7,039	97,593.07	101,431.99
上交所	博汇纸业	600966	14.05	2,161	35,833.64	30,362.05
上交所	中材国际	600970	9.93	2,605	21,721.05	25,867.65
上交所	赤峰黄金	600988	16.20	600	10,980.00	9,720.00
上交所	开滦股份	600997	7.82	4,500	36,270.00	35,190.00
上交所	柳钢股份	601003	6.23	2,800	21,392.00	17,444.00
上交所	赛轮轮胎	601058	9.29	5,000	45,850.00	46,450.00
上交所	秦港股份	601326	2.69	20,764	56,178.04	55,855.16
上交所	吉林高速	601518	2.29	30,000	69,600.00	68,700.00
上交所	旗滨集团	601636	18.00	8,291	108,080.76	149,238.00
上交所	明泰铝业	601677	18.78	2,400	44,465.00	45,072.00
上交所	滨化股份	601678	7.14	17,100	109,080.00	122,094.00
上交所	郑煤机	601717	10.08	7,100	78,668.00	71,568.00
上交所	中国出版	601949	6.33	2,800	20,860.00	17,724.00
上交所	万盛股份	603010	20.51	2,057	38,854.64	42,189.07
上交所	合锻智能	603011	4.77	4,900	22,921.00	23,373.00
上交所	广州酒家	603043	26.34	918	27,073.12	24,180.12

上交所	国检集团	603060	25.99	607	14,484.08	15,775.93
上交所	横店影视	603103	15.38	2,800	43,051.00	43,064.00
上交所	金能科技	603113	19.35	1,535	28,649.42	29,702.25
上交所	昭衍新药	603127	183.50	300	42,650.00	55,050.00
上交所	华贸物流	603128	13.74	1,500	22,995.00	20,610.00
上交所	皇马科技	603181	16.05	2,280	39,549.21	36,594.00
上交所	华正新材	603186	33.27	1,024	41,323.95	34,068.48
上交所	日月股份	603218	27.56	4,523	131,813.58	124,653.88
上交所	移远通信	603236	161.50	919	133,933.06	148,418.50
上交所	鸿远电子	603267	113.04	600	62,496.00	67,824.00
上交所	杭叉集团	603298	18.89	1,200	23,806.00	22,668.00
上交所	应流股份	603308	30.32	900	22,259.00	27,288.00
上交所	梦百合	603313	30.40	1,652	53,468.91	50,220.80
上交所	苏农银行	603323	4.32	3,571	16,308.56	15,426.72
上交所	杰克股份	603337	28.99	1,500	44,955.00	43,485.00
上交所	傲农生物	603363	9.64	4,000	46,158.00	38,560.00
上交所	信捷电气	603416	58.65	2,000	125,129.00	117,300.00
上交所	九洲药业	603456	42.21	2,835	116,277.71	119,665.35
上交所	恒为科技	603496	14.60	3,277	45,145.98	47,844.20
上交所	健盛集团	603558	8.07	8,500	72,891.00	68,595.00
上交所	广信股份	603599	29.66	800	23,400.00	23,728.00
上交所	东方电缆	603606	19.36	3,400	66,266.00	65,824.00
上交所	禾丰股份	603609	10.35	2,100	23,793.00	21,735.00
上交所	国联股份	603613	99.86	357	35,329.12	35,650.02
上交所	火炬电子	603678	59.15	856	47,513.30	50,632.40
上交所	新日股份	603787	26.56	1,255	24,583.72	33,332.80
上交所	志邦家居	603801	35.35	1,120	39,869.00	39,592.00
上交所	桃李面包	603866	33.90	200	6,845.43	6,780.00
上交所	数据港	603881	39.28	2,500	78,056.57	98,200.00
上交所	老百姓	603883	53.65	400	21,028.00	21,460.00
上交所	丽岛新材	603937	12.63	1,897	18,051.01	23,959.11
深交所	国药一致	000028	39.16	1,059	44,510.53	41,470.44
深交所	派林生物	000403	34.16	700	24,970.00	23,912.00
深交所	长虹华意	000404	4.08	4,000	15,975.00	16,320.00
深交所	东阿阿胶	000423	34.89	700	23,119.00	24,423.00
深交所	山东路桥	000498	5.82	19,500	103,282.00	113,490.00
深交所	丽珠集团	000513	49.80	1,000	44,766.00	49,800.00
深交所	荣安地产	000517	2.68	17,500	49,350.00	46,900.00
深交所	皖能电力	000543	3.77	3,400	13,362.00	12,818.00

深交所	莱茵体育	000558	2.87	4,700	13,395.00	13,489.00
深交所	盛达资源	000603	13.38	1,500	22,500.00	20,070.00
深交所	风华高科	000636	25.89	2,700	75,713.00	69,903.00
深交所	正虹科技	000702	4.84	18,700	92,453.00	90,508.00
深交所	振华科技	000733	53.13	2,500	124,798.80	132,825.00
深交所	云铝股份	000807	13.35	1,486	14,527.21	19,838.10
深交所	现代投资	000900	4.25	7,877	34,736.79	33,477.25
深交所	新洋丰	000902	15.27	7,089	146,530.79	108,249.03
深交所	河钢资源	000923	21.88	780	17,631.77	17,066.40
深交所	中国重汽	000951	27.52	1,194	44,149.00	32,858.88
深交所	首钢股份	000959	5.92	3,500	21,280.00	20,720.00
深交所	航天电器	002025	49.20	2,681	127,651.65	131,905.20
深交所	七匹狼	002029	6.31	3,170	17,782.77	20,002.70
深交所	巨轮智能	002031	1.80	12,700	22,987.00	22,860.00
深交所	梦网科技	002123	17.26	3,500	47,495.00	60,410.00
深交所	顺络电子	002138	33.97	3,700	113,209.00	125,689.00
深交所	汉钟精机	002158	25.48	1,000	22,340.00	25,480.00
深交所	楚江新材	002171	8.15	5,597	44,193.53	45,615.55
深交所	海利得	002206	6.02	13,000	69,160.00	78,260.00
深交所	九阳股份	002242	34.67	3,726	115,611.67	129,180.42
深交所	川大智胜	002253	14.19	1,600	20,848.00	22,704.00
深交所	科华数据	002335	16.83	6,134	119,850.43	103,235.22
深交所	汉王科技	002362	19.04	1,314	24,933.26	25,018.56
深交所	太极股份	002368	21.19	1,200	22,668.00	25,428.00
深交所	和而泰	002402	23.85	5,883	119,808.49	140,309.55
深交所	天虹股份	002419	6.58	8,900	61,234.00	58,562.00
深交所	松芝股份	002454	5.28	16,500	85,657.00	87,120.00
深交所	嘉事堂	002462	13.85	3,310	46,010.25	45,843.50
深交所	三维化学	002469	5.54	8,000	45,733.00	44,320.00
深交所	江海股份	002484	13.61	4,100	50,438.00	55,801.00
深交所	涪陵榨菜	002507	38.42	500	18,360.00	19,210.00
深交所	浙江众成	002522	5.93	2,280	12,785.91	13,520.40
深交所	云图控股	002539	9.11	2,284	21,692.89	20,807.24
深交所	鸿路钢构	002541	55.60	1,501	76,006.62	83,455.60
深交所	索菲亚	002572	23.81	3,300	90,498.00	78,573.00
深交所	日上集团	002593	3.58	6,300	22,806.00	22,554.00
深交所	豪迈科技	002595	27.35	800	21,988.00	21,880.00
深交所	万润股份	002643	16.23	7,551	128,018.22	122,552.73
深交所	博彦科技	002649	10.18	12,200	112,821.00	124,196.00

深交所	利君股份	002651	11.13	11,248	114,274.24	125,190.24
深交所	煌上煌	002695	17.73	6,600	123,827.00	117,018.00
深交所	良信股份	002706	19.90	5,660	138,565.00	112,634.00
深交所	东易日盛	002713	6.45	3,500	23,656.00	22,575.00
深交所	一心堂	002727	35.75	3,000	127,694.00	107,250.00
深交所	埃斯顿	002747	33.90	2,400	74,940.00	81,360.00
深交所	弘亚数控	002833	37.32	700	25,990.00	26,124.00
深交所	同兴达	002845	24.09	1,573	40,193.11	37,893.57
深交所	科达利	002850	81.65	413	26,729.54	33,721.45
深交所	周大生	002867	28.20	3,100	96,560.00	87,420.00
深交所	三利谱	002876	53.38	900	46,695.00	48,042.00
深交所	中宠股份	002891	39.84	1,500	46,301.00	59,760.00
深交所	蒙娜丽莎	002918	28.79	3,000	101,386.00	86,370.00
深交所	广电计量	002967	41.00	652	23,909.99	26,732.00
深交所	北陆药业	300016	9.80	2,500	22,754.00	24,500.00
深交所	中元股份	300018	5.60	4,600	23,598.00	25,760.00
深交所	超图软件	300036	21.67	1,400	23,183.00	30,338.00
深交所	新宙邦	300037	92.83	1,600	119,884.00	148,528.00
深交所	鼎龙股份	300054	16.90	1,500	23,055.00	25,350.00
深交所	当升科技	300073	56.72	2,524	118,312.70	143,161.28
深交所	数码视讯	300079	9.39	3,841	15,092.80	36,066.99
深交所	创世纪	300083	10.66	2,142	25,847.00	22,833.72
深交所	中航电测	300114	14.87	1,800	22,842.00	26,766.00
深交所	万达信息	300168	15.52	4,653	67,105.59	72,214.56
深交所	美亚柏科	300188	17.54	1,776	30,449.79	31,151.04
深交所	维尔利	300190	6.68	14,300	99,590.00	95,524.00
深交所	长海股份	300196	16.15	4,000	67,679.00	64,600.00
深交所	聚光科技	300203	11.78	6,166	78,144.07	72,635.48
深交所	洲明科技	300232	9.02	5,700	45,714.00	51,414.00
深交所	瑞丰高材	300243	13.12	7,900	100,431.00	103,648.00
深交所	光线传媒	300251	11.30	5,200	60,892.00	58,760.00
深交所	精锻科技	300258	12.95	5,900	61,546.00	76,405.00
深交所	兴源环境	300266	3.85	7,900	23,068.00	30,415.00
深交所	富春股份	300299	5.73	22,900	117,219.00	131,217.00
深交所	华灿光电	300323	10.12	12,500	125,205.00	126,500.00
深交所	博腾股份	300363	82.29	2,200	117,881.00	181,038.00
深交所	鼎捷软件	300378	20.72	6,361	146,029.25	131,799.92
深交所	东方通	300379	29.25	5,275	130,502.40	154,293.75
深交所	九强生物	300406	18.40	5,733	110,463.29	105,487.20

深交所	伊之密	300415	16.26	2,700	44,604.00	43,902.00
深交所	创业慧康	300451	11.89	6,800	69,836.00	80,852.00
深交所	康拓红外	300455	9.95	2,000	18,180.00	19,900.00
深交所	华铭智能	300462	12.41	4,200	46,349.00	52,122.00
深交所	中密控股	300470	41.45	2,000	68,360.00	82,900.00
深交所	胜宏科技	300476	20.35	2,100	46,714.00	42,735.00
深交所	博创科技	300548	34.78	2,310	79,801.62	80,341.80
深交所	科信技术	300565	14.77	3,400	47,056.00	50,218.00
深交所	会畅通讯	300578	30.69	925	25,881.19	28,388.25
深交所	万兴科技	300624	64.55	2,002	89,196.36	129,229.10
深交所	华测导航	300627	32.10	480	11,845.76	15,408.00
深交所	广和通	300638	41.27	1,035	32,804.32	42,714.45
深交所	世纪天鸿	300654	8.42	3,006	24,559.93	25,310.52
深交所	佩蒂股份	300673	31.71	699	21,990.09	22,165.29
深交所	宇信科技	300674	17.68	1,280	23,748.00	22,630.40
深交所	光威复材	300699	73.43	770	54,876.50	56,541.10
深交所	药石科技	300725	153.12	700	91,940.00	107,184.00
深交所	宏达电子	300726	68.81	800	46,440.00	55,048.00
深交所	锐科激光	300747	98.12	245	19,692.77	24,039.40
深交所	中简科技	300777	44.90	3,300	113,261.00	148,170.00
深交所	中信出版	300788	38.05	800	33,862.00	30,440.00
合计				937,270	10,939,120.08	11,458,269.58

以上股票投资于清算期处置变现,变现产生的证券清算款为人民币 11,223,740.38 元,已于清算期间划入托管账户。

## 2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款人民币 24,606.57 元、应付管理人报酬人民币 5,102.43 元、应付托管费人民币 1,020.50 元、应付销售服务费人民币 91.25 元和应付交易费用为人民币 34,771.90 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 40,016.77 元,其中人民币 40,000.00 元为 2020 年预提审计费,该款项已于 2021 年 6 月 24 日支付;人民币 16.77 元为应付赎回费,该款项已于 2021 年 6 月 16 日及 2021 年 6 月 17 日支付。

## 3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2021年6月16日至 2021年7月30日止 清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	4,482.51
处置交易性金融资产产生的净损失（注2）	-222,296.35
股息红利个税（注3）	-4,706.33
股利收入	532.76
清算期间收益小计	-221,987.41
二、清算期间费用	
交易费用	21,372.86
汇划费	40.00
清算期间费用小计（注4）	21,412.86
三、清算期间净损失	-243,400.27

注1：利息收入系计提的自2021年6月16日至2021年7月30日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2：处置交易性金融资产产生的净损失系清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票最后运作日的股票估值总额后的差额。

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

金额单位: 人民币元

项目	金额
一、2021年6月15日(最后运作日)所有者权益	12,439,647.08
加: 清算期间净收益	-243,400.27
减: 基金净赎回金额(于2021年6月16日确认的投资者赎回申请)	102,133.66
二、2021年7月30日(清算结束日)所有者权益	12,094,113.15

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(本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2021年7月30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《银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》, 本基金进入清算程序后, 不再计提基金管理费、基金托管费和销售服务费。

## 五、备查文件

### (一) 备查文件目录

- 1、《银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于〈银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金清算报告〉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。