

华夏上证3-5年期 中高评级可质押信用债交易型 开放式指数证券投资基金清算报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
清算报告出具日:2021年9月9日
清算报告公告日:2021年9月14日

重要提示

华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2017年7月25日证监许可[2017]1339号文准予注册,自2018年5月3日起基金合同生效,并于2018年5月31日在上海证券交易所上市交易,基金管理人华夏基金管理有限公司、基金托管人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》《华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)等有关规定,基金份额持有人大会决定终止《基金合同》,《基金合同》应当终止,本基金管理人于2021年7月2日召开《华夏基金管理有限公司关于召开华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,审议本基金终止基金合同并终止上市有关事项,会议议案于2021年8月3日通过,本次基金份额持有人大会决议自即日起生效,本基金管理人于2021年8月4日发布公告《华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果决议生效公告》(以下简称“决议生效公告”),根据决议生效公告,本基金最后运作日为2021年8月3日,自2021年8月4日起,本基金进入基金财产清算程序。

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)和北京市天元律师事务所成立基金财产清算组履行基金财产清算程序,由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,由北京市天元律师事务所对清算事宜出具法律意见。

一、基金概况

名称	内容
基金名称	华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债
基金代码	501036
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日期	2018年5月3日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金管理人地址	北京市西城区金融大街33号
基金管理人电话	4008188888
基金管理人网址	www.huaxia.com

二、基金运作情况

本基金经中国证监会2017年7月25日证监许可[2017]1339号文准予注册,由基金管理人依照法律法规、本基金基金合同等规定自2018年1月24日至2018年4月24日期间向社会公开募集,本基金基金合同于2018年5月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总数为316,726,219份(含募集期间利息结转的份额),有效认购户数为1,901户。

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》《华夏基金管理有限公司关于召开华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》《华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果决议生效公告》等规定,本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会审议《关于华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市相关事项的议案》,上述议案于2021年8月3日获得通过,持有人大会决议自即日起生效,本基金以2021年8月3日为最后运作日,自2021年8月4日起,本基金进入基金财产清算程序。

三、财务会计报告

(一)基金最后运作日资产负债表(已经审计)

会计主体:华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日:2021年8月3日

单位:人民币元

资产	负债及所有者权益
货币资金	113,801.51
结算备付金	20,074.92
交易保证金	10,037.46
应收利息	7,986.48
应收股利	-
买入返售金融资产	-
其他应收款	-
其他流动资产	-
流动资产合计	151,899.97
长期股权投资	-
其他权益工具投资	-
其他非流动资产	-
非流动资产合计	-
资产合计	151,899.97
应付利息	-
应付股利	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	-
其他应付账款	-
其他流动负债	-
负债合计	-
所有者权益(或股东权益)合计	151,899.97
实收基金	-
未分配利润	151,899.97
所有者权益合计	151,899.97
资产总计	151,899.97
负债和所有者权益总计	151,899.97

注:1.报告截止日2021年8月3日(本基金最后运作日),本基金基金份额净值为113.8015元;基金份额总额为7,263,000份。

2.本基金截至最后运作日的财务报表以清算基础编制,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

四、清算情况

自2021年8月4日至2021年9月9日止为本基金清算报告期,基金财产清算按照法律法规及《基金合同》等规定履行基金财产清算程序,全部工作按清算原则和清算手续进行,具体清算情况如下:

(一)清算费用

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,考虑到本基金清算的实际情况,从保护基金份额持有人利益的角度出发,本基金的清算费用由基金管理人承担。

(二)最后运作日资产清算情况

截至清算报告期末日(2021年9月9日),本基金最后运作日部分资产尚未收回,为了提高清算效率,及时向基金份额持有人分配剩余财产,本基金管理人以自有资金对尚未收回的结算备付金、存出保证金、应收利息进行垫付,该垫付资金将于收回款项、结息后返还给基金管理人,各项资产清算情况如下:

- 1.本基金最后运作日结算备付金为人民币9,020.81元,已由基金管理人于2021年8月11日以自有资金垫付至托管账户;
- 2.本基金最后运作日存出保证金为人民币7,056.46元,已由基金管理人于2021年8月11日以自有资金垫付至托管账户;
- 3.本基金最后运作日应收利息为人民币1,041.33元,已由基金管理人于2021年8月11日以自有资金垫付至托管账户。

(三)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16.52元,该款项已于2021年8月5日支付。
- 2.本基金最后运作日应付托管费为人民币5.28元,该款项已于2021年8月5日支付。
- 3.本基金最后运作日其他应付款为人民币34,230.13元,为应付指债管理费,实际应付金额为人民币25,033.18元,已于2021年9月6日支付,余额为中证指数公司减值优惠部分,已进行账务冲减。

(四)本次清算期间的清算损益情况

项目	金额(人民币元)
清算费用	-
清算收入(即)	151,899.97
清算支出	151,899.97
清算净收入	-
清算净收入(即)	-
清算净收入(即)	-
清算净收入(即)	-

表中相关项目具体说明如下:

注1:利息收入系以当前适用的利率计提的自2021年8月4日至2021年9月9日止清算报告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:其他费用包括银行手续费42.05元、银行间账户维护费3,000.00元及经向中证指数公司申请减值优惠后冲减的计提指债款管理费2,085.08元。

注3:考虑到本基金清算的实际情况,从保护基金份额持有人利益的角度出发,本基金的清算费用由基金管理人承担。

(五)截至本次清算期结束日的剩余财产情况

项目	金额(人民币元)
货币资金	113,801.51
结算备付金	20,074.92
交易保证金	10,037.46
应收利息	7,986.48
其他流动资产	-
其他非流动资产	-
资产合计	151,899.97

截至本基金清算报告期末日(2021年9月9日),本基金剩余财产为人民币833,036.13元,自清算报告期末日(2021年9月10日)至本次清算款划出前一日,银行存款产生的利息亦非指债持有人所有。

(六)基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核,将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告,清算报告公告后,基金管理人将按照法律法规、基金合同等规定及时进行剩余财产分配。

五、备查文件

(一)备查文件目录

- 1.《华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金2021年1月至2021年8月3日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》
- 2.《华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金清算的法律意见》

(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。

华夏上证3-5年期中高评级可质押信用债交易型开放式指数证券投资基金财产清算组

二〇二一年九月十四日