

银河中债 1-3 年国开行债券指数 证券投资基金 清算报告

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 12 月 22 日

§ 1 重要提示

银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2021]2695 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 1,515,022,454.18 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(21)第 00505 号的验资报告。基金合同于 2021 年 9 月 28 日正式生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

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”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；4、《基金合同》约定的其他情形；5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

根据基金管理人 2022 年 11 月 22 日发布的《银河基金管理有限公司关于银河中债 1-3 年国开行债券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的公告》，本次基金份额持有人大会于 2022 年 11 月 21 日表决通过了《关于终止银河中债 1-3 年国开行债券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。

根据《银河基金管理有限公司关于银河中债 1-3 年国开行债券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的公告》，本基金最后运作日为 2022 年 11 月 22 日，自 2022 年 11 月 23 日起进入清算期。

由基金管理人银河基金管理有限公司、基金托管人中信银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2022 年 11 月 23 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

基金简称	银河中债 1-3 年国开行债券指数	
基金主代码	013541	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 28 日	
报告期末（2022 年 11 月 22 日）基金份额总额	143,890.37 份	
下属分级基金的基金简称	银河中债 1-3 年国开行债券指数 A	银河中债 1-3 年国开行债券指数 C
下属分级基金的交易代码	013541	013542
报告期末（2022 年 11 月 22 日）下属分级基金的份额总额	136,590.70 份	7,299.67 份
投资目标	本基金通过指数化投资，通过数量化的风险管理手段，以实现对标指数的有效跟踪。	
投资策略	本基金为被动管理基金，主要采用抽样复制和动态最优的策略进行组合构建，投资于标的指数中具有代表性的部分成份券，或选择非成份券作为替代，使得债券投资组合的总体特征（如久期、剩余期限分布和到期收益率等）与标的指数相似。此外，本基金可通过参与风险低且可控的债券回购等投资，以弥补基金费用、增加基金收益。	
业绩比较基准	中债-1-3 年国开行债券指数（全价）收益率*95%+同期银行活期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期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。本基金为指数型基金，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。	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2021]2695号《关于准予银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金注册的批复》的注册，由基金管理人银河基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于 2021 年 9 月 28 日生效，首次设立募集规模为 1,515,022,454.18 份基金份额。

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》以及《银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同，会议决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人应当终止基金

合同，并对银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金进行变现及实施清算程序。本次基金份额持有人大会于 2022 年 11 月 21 日表决通过了《关于终止银河中债 1-3 年国开行债券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，基金管理人于 2022 年 11 月 22 日刊登了《银河基金管理有限公司关于银河中债 1-3 年国开行债券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的公告》。本基金的清算期间为 2022 年 11 月 23 日(清算开始日)起至 2022 年 12 月 6 日(清算结束日)止期间。自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

本基金的清算报表仅为供本基金基金管理人用以本基金清算相关监管报送或公告之目的而编制，清算报表以非持续经营为基础编制。因此，清算报表列示资产和负债时不再区分流动资产和非流动资产、流动负债和非流动负债，期末资产项目以预计可收回金额列报，负债项目按照需要偿付的金额列报。清算报表仅列示了 2022 年 11 月 22 日(最后运作日)及 2022 年 12 月 6 日(清算结束日)的清算资产负债表和 2022 年 11 月 23 日(清算开始日)至 2022 年 12 月 6 日(清算结束日)止清算期间的清算损益表及重要报表项目说明，除上述内容外，本基金遵循《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《银河基金管理有限公司关于银河中债 1-3 年国开行债券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的公告》及基金合同的有关规定。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 11 月 22 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2022 年 11 月 22 日
资 产：	
银行存款	256,312.92
结算备付金	121.36
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
债券投资	-
买入返售金融资产	-
应收申购款	-
其他资产	-

资产总计	256,434.28
负债和所有者权益	最后运作日 2022 年 11 月 22 日
负 债:	
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	-
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	111,027.00
负债合计	111,027.00
所有者权益:	
实收基金	143,890.37
未分配利润	1,516.91
所有者权益合计	145,407.28
负债和所有者权益总计	256,434.28

注：1、本基金最后运作日 2022 年 11 月 22 日，银河中债 1-3 年国开行债券指数 A 类基金份额净值 1.0104 元，基金份额总额 136,590.70 份；银河中债 1-3 年国开行债券指数 C 类基金份额净值 1.0136 元，基金份额总额 7,299.67 份；银河中债 1-3 年国开行债券指数份额总额合计为 143,890.37 份。

2、本财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师王国蓓、汪霞签字出具了毕马威华振审字第 2208035 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

自 2022 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 6 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：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 121.36 元，其中应计结算备付金利息人民币 121.36 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金利息。该款项将由基金管理人银河基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.2 本基金最后运作日银行存款中所含利息人民币 2,985.71 元，该款项未结息部分将由

基金管理人以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日其他负债为人民币 111,027.00 元，其中预提 2022 年信息披露费人民币 89,000.00 元，预提清盘审计费人民币 22,000.00 元。该款项已于 2022 年 11 月 29 日支付；其他应付款人民币 27.00 元为 2022 年 11 月 22 日前产生的资金汇划费，该款项已于 2022 年 12 月 1 日由托管行自动扣收。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自 2022 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 6 日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	25.80
清算收入小计	25.80
二、清算费用	
资金汇划费（注 2）	18.00
清算费用小计（注 3）	18.00
三、清算净收益	7.80

注 1：利息收入为计提的自 2022 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 6 日止清算期间的银行存款利息收入。该款项将于 2022 年 12 月 21 日结息日划入托管账户；

注 2：资金汇划费为清算期间支付 2022 年信息披露费及清盘审计费所产生的银行汇款费用；

注 3：根据《银河基金管理有限公司关于银河中债 1-3 年国开行债券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的公告》，本次召开基金份额持有人大会的费用（公证费及律师费）将由本基金基金管理人支付，本次基金份额持有人大会费用明细如下：律师费 40,000.00 元人民币，公证费 10,000.00 元人民币，合计为 50,000.00 元人民币。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 11 月 22 日基金净资产	145,407.28
加：清算期间净收益	7.80
二、2022 年 12 月 6 日基金资产净值	145,415.08

根据本基金的基金合同及《银河基金管理有限公司关于银河中债 1-3 年国开行债券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的公告》，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，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，

并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2022 年 12 月 6 日止的剩余财产为人民币 145,415.08 元，其中银河中债 1-3 年国开行债券指数 A 剩余财产为人民币 138,016.01 元，银河中债 1-3 年国开行债券指数 C 剩余财产为人民币 7,399.07 元。

截至 2022 年 12 月 6 日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 142,282.21 元。

5.5 基金财产清算报告的告知安排

本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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、《银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站

<http://www.cgf.cn>。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

银河中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金财产清算小组

2022 年 12 月 6 日(清算报告出具日期)