

银华中证央企结构调整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：中国工商银行股份有限公司

清算报告公告日：2023年3月21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.....	8
五、备查文件.....	11

## 重要提示

银华中证央企结构调整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”）已于2018年6月12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【2018】969号文准予募集注册，自2018年11月15日起《银华中证央企结构调整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2023年1月5日以通讯方式表决通过了《关于终止银华中证央企结构调整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2023年1月6日刊登在规定媒介上的《关于银华中证央企结构调整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的公告》。

本基金自2023年1月6日至2023年1月12日为赎回选择期。本基金最后运作日为2023年1月12日，自2023年1月13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2023年1月13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报告出具法律意见。

## 一、基金概况

基金名称	银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	银华中证央企结构调整 ETF 联接
基金代码	006119
基金运作方式	契约型开放式
基金投资目标	本基金主要通过投资于目标 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	中证央企结构调整指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金合同生效日	2018 年 11 月 15 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
登记机构	银华基金管理股份有限公司

## 二、基金运作情况

本基金已于2018年6月12日获中国证监会证监许可【2018】969号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2018年10月15日至2018年11月9日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2018年11月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为349,995,566.60份（含募集期间利息结转的份额）。本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2023年1月5日以通讯方式表决通过了《关于终止银华中证央企结构调整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2023年1月6日刊登在规定媒介上的《关于银华中证央企结构调整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的公告》。

本基金自2023年1月6日至2023年1月12日为赎回选择期。本基金最后运作日为2023年1月12日，自2023年1月13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2023年1月13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报告出具法律意见。

### 三、财务会计报告

#### 1、清算期间

银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金的清算期间为2023年1月13日至2023年2月27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《资产管理产品相关会计处理规定》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证央企结构调整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或其派出机构备案使用。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（即2023年1月12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 2023年1月12日
<b>资产：</b>	
银行存款	666,789.66
结算备付金	79,100.24
存出保证金	8,748.39
交易性金融资产	7,195,120.96
资产总计	7,949,759.25

<b>负 债：</b>	
应付赎回款	70,546.93
应付管理人报酬	82.74
应付托管费	18.39
其他负债	80,000.37
负债合计	150,648.43
<b>净资产：</b>	
实收基金	6,607,353.81
未分配利润	1,191,757.01
净资产合计	7,799,110.82
负债与净资产总计	7,949,759.25

## 四、清算情况

自 2023 年 1 月 13 日至 2023 年 2 月 27 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 79,100.24 元，其中上海最低结算备付金为人民币 1,839.31 元，应计利息为人民币 0.24 元；深圳最低结算备付金为人民币 77,245.45 元，应计利息为人民币 15.24 元。其中上海最低结算备付金和深圳最低结算备付金，共计人民币 79,084.76 元已于 2023 年 2 月 8 日划至托管账户。剩余应计利息共计人民币 15.48 元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。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。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 8,748.39 元，其中上海存出保证金为人民币 75.12 元；深圳存出保证金为人民币 8,666.96 元，应计利息为人民币 6.31 元；其中上海存出保证金和深圳存出保证金，共计人民币 8,742.08 元已于 2023 年 2 月 2 日划至托管账户。剩余应计利息人民币 6.31 元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。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。

(3) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 7,195,120.96 元。全部为基金投资，明细如下：

### 基金投资明细：

金额单位：人民币元

交易平台	基金名称	基金代码	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
深交所	央企 ETF	159959	1.2594	5,713,134.00	7,292,238.22	7,195,120.96
合计				5,713,134.00	7,292,238.22	7,195,120.96



以上交易性金融资产已于清算期全部处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 7,518,462.38 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为人民币 70,546.93 元，已于清算期内支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 82.74 元、应付托管费为人民币 18.39 元，已于清算期内支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币 80,000.37 元，其中人民币 50,000.00 元为预提审计费，将于收到发票后支付，不计入剩余财产予以分配；人民币 20,000.00 元为持有人大会律师费，已于清算期内支付；人民币 10,000.00 元为公证费，已于清算期内支付；人民币 0.37 元为应付交易费，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	2023年1月13日至 2023年2月27日止 清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	2,248.04
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	316,923.19
清算期间收益小计	319,171.23
二、清算期间费用	
审计费	15,000.00

律师费	15,000.00
应交税费	770.19
其他费用	77.00
清算期间费用小计	30,847.19
三、清算期间净收益	288,324.04

注 1：利息收入系计提的自 2023 年 1 月 13 日至 2023 年 2 月 27 日止清算期间的银行存款利息、备付金利息和保证金利息。

注 2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出交易性金融资产成交金额扣除最后运作日市值和卖出交易费用的净额。

#### 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2023年1月12日基金净资产	7,799,110.82
加：清算期间净收益	288,324.04
减：基金净赎回金额（于2023年1月13日确认的投资者赎回申请）	78,511.07
2023年2月27日基金净资产	8,008,923.79

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、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 2023 年 2 月 27 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及未划入托管账户的存出保证金至托管账户，垫付资金到账日起孳生的利息归本基金管理人所有。

5、根据《关于银华中证央企结构调整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的公告》，本基金进入清算程序后(含进入清算程序当日)，不再计提基金管理费和基金托管费。

## 五、备查文件

### (一) 备查文件目录

- 1、《银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报表审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于<银华中证央企结构调整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。