

银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
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：招商银行股份有限公司

清算报告公告日：2025 年 9 月 23 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	9
五、备查文件	11

重要提示

银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）的募集已于 2022 年 7 月 11 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[2022]1457 号文准予注册，自 2022 年 8 月 8 日起《银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

《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”中约定：“基金合同生效之日起三年后的对应自然日，若基金资产净值低于 2 亿元，本基金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 2022 年 8 月 8 日。2025 年 8 月 8 日，本基金《基金合同》生效满 3 年，经本基金登记机构确认及基金托管人复核，截至《基金合同》生效之日起三年后的对应自然日日终（即 2025 年 8 月 8 日日终），本基金基金资产净值低于 2 亿元，出现触发上述《基金合同》终止的情形。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 2025 年 8 月 9 日刊登在规定媒介上的《银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自 2025 年 8 月 9 日起进入财产清算期，基金管理人、基金托管人、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2025 年 8 月 9 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由容诚会计师事务所（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	银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	银华玉衡定投三个月持有混合发起式（FOF）
基金主代码	016309
下属基金简称	银华玉衡定投三个月持有混合发起式（FOF）A
下属基金代码	016309
下属基金简称	银华玉衡定投三个月持有混合发起式（FOF）C
下属基金代码	016310
基金运作方式	契约型开放式
基金投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金、货币型基金中基金、债券型基金中基金。 本基金若投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。
基金合同生效日	2022 年 8 月 8 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	招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 2022 年 7 月 11 日获中国证监会证监许可[2022]1457 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 2022 年 8 月 1 日至 2022 年 8 月 3 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2022 年 8 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 10,101,683.49 份（含募集期间利息结转的份额），自 2022 年 8 月 8 日至 2025 年 8 月 8 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

《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”中约定：“基金合同生效之日起三年后的对应自然日，若基金资产净值低于 2 亿元，本基金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 2022 年 8 月 8 日。经本基金登记机构确认及基金托管人复核，截至《基金合同》生效之日起三年后的对应自然日日终（即 2025 年 8 月 8 日日终），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 2025 年 8 月 9 日刊登在规定媒介上的《银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自 2025 年 8 月 9 日起进入财产清算期，基金管理人、基金托管人、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2025 年 8 月 9 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由容诚会计师事务所（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

银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的清算期间为 2025 年 8 月 9 日至 2025 年 8 月 19 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玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）全体基金份额持有人以及报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 2025 年 8 月 8 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	2025 年 8 月 8 日 (最后运作日)
资产：	
货币资金	127,666.36
结算备付金	1.10
存出保证金	408.86
交易性金融资产	8,338,036.60
其中：基金投资	7,835,113.18

债券投资	502,923.42
应收申购款	1,758.15
其他资产	187.01
资产总计	8,468,058.08
负债：	
应付赎回款	14,415.98
应付管理人报酬	1,651.30
应付托管费	343.89
应付销售服务费	10.77
其他负债	30.00
负债合计	16,451.94
净资产：	
实收基金	10,191,537.53
未分配利润	-1,739,931.39
净资产合计	8,451,606.14
负债和净资产总计	8,468,058.08

注：报告截止日 2025 年 8 月 8 日(基金最后运作日)，基金份额总额 10,191,537.53 份，其中银华玉衡定投三个月持有混合发起式（FOF）A 基金份额总额 10,038,354.94 份，基金份

额净值 **0.8294** 元；银华玉衡定投三个月持有混合发起式（FOF）C 基金份额总额 **153,182.59** 份，基金份额净值 **0.8195** 元。

四、清算情况

自 2025 年 8 月 9 日至 2025 年 8 月 19 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 2025 年 8 月 8 日(基金最后运作日) 结算备付金为人民币 1.10 元，均为应计利息；存出保证金为人民币 408.86 元，无应计利息。上述款项将由本基金的基金管理人在清算款划出托管账户以前以自有资金垫付至托管账户，垫付资金到账起孳生的利息归本基金的基金管理人所有。

(2) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 8,338,036.60 元，分别为债券投资人民币 502,923.42 元，基金投资人民币 7,835,113.18 元。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 8,359,750.26 元，已于清算期间划入托管账户。

(3) 本基金 2025 年 8 月 8 日(基金最后运作日) 应收申购款为人民币 1,758.15 元，该款项已于清算期内划入托管账户。

(4) 本基金 2025 年 8 月 8 日(基金最后运作日) 其他资产为人民币 187.01 元，为应收销售服务费返还，其中 138.93 元已于清算期间划入托管账户，剩余款项将由本基金的基金管理人在清算款划出托管账户以前以自有资金垫付至托管账户，垫付资金到账起孳生的利息归本基金的基金管理人所有。

2、负债清偿情况

(1) 本基金 2025 年 8 月 8 日(基金最后运作日) 应付管理人报酬人民币 1,651.30 元、应付托管费人民币 343.89 元、应付销售服务费人民币 10.77 元，以上款项已于清算期间支付。

(2) 本基金 2025 年 8 月 8 日(基金最后运作日) 应付赎回款为人民币 14,415.98 元，该款项已于清算期间支付。

(3) 本基金 2025 年 8 月 8 日（基金最后运作日）的其他负债为人民币 30.00 元，为应付银行手续费，将由本基金于清算期结束日后支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2025 年 8 月 9 日至 2025 年 8 月 19 日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
1. 利息收入(注 1)	496.55
2. 处置交易性金融资产产生的净收益(注 2)	21,713.66
3. 其他收入(注 3)	24.03
清算期间收益小计	22,234.24
二、清算期间费用	
银行手续费	45.00
清算期间费用小计	45.00
三、清算期间净损益	22,189.24

注 1：利息收入系计提的自 2025 年 8 月 9 日至 2025 年 8 月 19 日（基金清算结束日）止清算期间的银行存款利息。

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减去最后运作日交易性金融资产估值总额和交易费用后的差额。

注 3：其他收入系清算期间计提的销售服务费返还收入。

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
一、2025年8月8日(基金最后运作日)净资产	8,451,606.14
加：清算期间净损益	22,189.24
减：基金净赎回金额	294.41
二、2025年8月19日(清算结束日)净资产	8,473,500.97

截至 2025 年 8 月 19 日（基金清算期结束日），本基金剩余财产为人民币 8,473,500.97 元。自 2025 年 8 月 20 日（基金清算期结束日次日）至清算款划出日前一日的银行存款等产生的利息亦属基金份额持有人所有，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。

5、根据《银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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（含进入清算程序当日），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、《银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于〈银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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。