

# 建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金清算报告

基金管理人:建信基金管理有限责任公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告出具日期: 2023年7月10日

报告公告日期: 2023年7月20日

## 一、重要提示

建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2020年4月21日证监许可[2020]768号文注册募集，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人利益，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》和《建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）出现了《基金合同》终止事由，且建信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）应当在上述事由出现后终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。自2023年6月17日起，本基金进入清算期。

本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见刊登在2023年6月17日中国证监会规定媒介和基金管理人网站（<http://www.ccbfund.cn>）上的《关于建信中债湖北省地方政府债指数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》。

本基金清算期自2023年6月17日起至2023年7月6日止。由基金管理人建信基金管理有限责任公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、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组成的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）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

- 1、基金名称：建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金。
- 2、基金运作方式：契约型开放式。
- 3、《基金合同》生效日：2020年6月15日。
- 4、投资目标：本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标

的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

5、投资策略：

本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。

在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

具体由债券投资组合的构建策略、债券投资组合的调整策略、其他投资策略三部分组成。

6、业绩比较基准：中债-湖北省地方政府债指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%。

7、风险收益特征：本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，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。

8、基金管理人：建信基金管理有限责任公司。

9、基金托管人：兴业银行股份有限公司。

### 三、财务会计报告

#### 资产负债表（经审计）

会计主体：建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 16 日

单位：人民币元

资产	本期末 2023 年 6 月 16 日（基金最后运作日）
资产：	
银行存款	142,739,802.90
结算备付金	2,579.85
存出保证金	4.38
资产总计	<b>142,742,387.13</b>
负债和所有者权益	
负债：	

其他应付款	18,948.57
其他负债	163,374.59
负债合计	182,323.16
所有者权益：	
实收基金	139,864,448.22
未分配利润	2,695,615.75
所有者权益合计	142,560,063.97
负债和所有者权益总计	<b>142,742,387.13</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 16 日（基金最后运作日），基金份额总额 139,864,448.22 份，基金份额净值为人民币 1.0193 元。

## 四、清盘事项说明

### 1、基本情况

建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2020 年 4 月 21 日证监许可[2020]768 号文注册募集。由建信基金管理有限责任公司于 2020 年 5 月 18 日至 2020 年 6 月 12 日向社会公开募集，《基金合同》于 2020 年 6 月 15 日生效。首次设立募集规模为 7,147,481,250.00 份基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人及登记机构均为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、政策性金融债、地方政府债、银行存款以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资除国债、政策性金融债、地方政府债以外的其他债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数的成份券及其备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资范围相应调整。

## 2、清算原因

本基金出现了《基金合同》终止事由，且建信基金管理有限责任公司应当在上述事由出现后终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。

## 3、清算起始日

根据《关于建信中债湖北省地方政府债指数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 2023 年 6 月 17 日起进入清算程序，清算期间为 2023 年 6 月 17 日至 2023 年 7 月 6 日。

## 4、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。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。管理人编制本清算报表是为了建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金基金财产清算小组报送建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金全体持有人以及中国证券监督管理委员会使用。因此，本清算报表不适用于其他用途。

## 五、清算情况

自 2023 年 6 月 17 日至 2023 年 7 月 6 日止的清算期间，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。

清算期间具体清算情况如下：

### 1、清算费用

按照《建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金基金合同》“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”这个部分的规定，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，除银行直接扣付的划款手续费和清算审计费外，自清算起始日起，与本基金清算相关的律师费将由基金管理人代为支付。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 142,739,802.90 元，其中包含应计利息人民币 40,044.15 元。清算期间，银行存款共计提利息人民币 27,746.65 元。收到银行存款利息人民币 45,593.51 元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币 142,563,821.51 元，其中应计银行存款利息余额为人民币 22,197.29 元，该款项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) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 2,579.85 元，为应计上海最低备付金利息。该款项已于清算期间划入托管帐户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 4.38 元，为应计上海存出保证金利息。该款项已于清算期间划入托管帐户。

### 3、 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日其他负债为人民币 163,374.59 元，包含银行间交易费用人民币 4,470.00 元。预提审计费人民币 95,000.00 元；预提信息披露费人民币 54,904.59 元；预提账户维护费人民币 9,000.00 元，上述款项已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日其他应付款为人民币 18,948.57 元，为应付指数使用费，清算期间产生指数使用费为人民币 23,359.12 元，共计指数使用费为人民币 42,307.69 元。该款项已于清算期间支付。

### 4、 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

	自 2023 年 6 月 17 日起至 2023 年 7 月 6 日止的清算期间
一、清算期间收益	
利息收入（注 1）	27,746.66
清算收入小计	27,746.66
二、清算期间费用	
银行手续费	30.00
其他费用（注 2）	600.00
指数使用费	23,359.12
清算费用小计	23,989.12
三、清算净收益	3,757.54

注 1：利息收入系计提的自 2023 年 6 月 17 日起至 2023 年 7 月 6 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：其他费用包含银行间债券交易费用及上清所查询服务费。

## 5、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

建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金(基金代码：009528)

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 6 月 16 日基金净资产	142,560,063.97
加：清算期间收益	27,746.66
减：清算期间费用	23,989.12
二、2023 年 7 月 6 日基金资产净值	142,563,821.51

注：资产处置及负债清偿后，2023 年 7 月 6 日本基金剩余财产为人民币 142,563,821.51 元。根据本基金的《基金合同》约定，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在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。

基金管理人建信基金管理有限责任公司以自有资金垫付的资金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。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。清算期结束日后至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息属份额持有人所有，在支付清算款时将一并计算并支付给份额持有人。

## 6、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- (1)《建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金清算审计报告》；
- (2)上海市通力律师事务所关于《建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金基金财产清算小组

报告出具日期：2023年7月10日

报告公告日期：2023年7月20日