

银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金  
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：招商证券股份有限公司

清算报告公告日：2024年10月31日

## 目录

重要提示.....	2
一、基金概况.....	3
二、基金运作情况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清算情况.....	7
五、备查文件.....	13

## 重要提示

银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已于 2019 年 9 月 19 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[2019]1737 号文准予募集注册，自 2019 年 11 月 1 日起《银华中证研发创新 100 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》”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，基金托管人为招商证券股份有限公司，上市交易地点为深圳证券交易所。

《基金合同》“第五部分 基金备案”中约定：“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人将终止基金合同，并按照基金合同约定程序进行清算，此事项不需要召开基金份额持有人大会进行表决。”

截至 2024 年 8 月 26 日日终，本基金基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元。为维护基金份额持有人利益，根据本基金《基金合同》的约定，基金管理人应当对基金财产进行清算并终止本基金《基金合同》，并按规定申请办理本基金终止上市的相关事宜，具体情况详见 2024 年 8 月 27 日刊登在规定媒介上的《关于银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》及基金管理人后续发布的相关提示性公告。

本基金自 2024 年 9 月 3 日起进入基金财产清算程序，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 2024 年 9 月 3 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	银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	创新 ETF
基金场内简称	科技创新 ETF
基金代码	159987
基金运作方式	交易型开放式
基金投资目标	本基金采用被动指数化投资，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	中证研发创新 100 指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金合同生效日	2019 年 11 月 1 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
登记机构	中国证券登记结算有限责任公司

## 二、基金运作情况

本基金已于 2019 年 9 月 19 日获中国证监会证监许可[2019] 1737 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 2019 年 10 月 21 日至 2019 年 10 月 25 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2019 年 11 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 443,457,627.00 份（含募集期间利息结转的份额），自 2019 年 11 月 1 日至 2024 年 9 月 2 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”中约定：“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人将终止基金合同，并按照基金合同约定程序进行清算，此事项不需要召开基金份额持有人大会进行表决。”

截至 2024 年 8 月 26 日日终，本基金基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元。为维护基金份额持有人利益，根据本基金《基金合同》的约定，基金管理人应当对基金财产进行清算并终止本基金《基金合同》，并按规定申请办理本基金终止上市的相关事宜，具体情况详见 2024 年 8 月 27 日刊登在规定媒介上的《关于银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》及基金管理人后续发布的相关提示性公告。

本基金自 2024 年 9 月 3 日起进入基金财产清算程序，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 2024 年 9 月 3 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

银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的清算期间为 2024 年 9 月 3 日至 2024 年 9 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中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金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 2024 年 9 月 2 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	2024 年 9 月 2 日 (最后运作日)
<b>资产：</b>	
货币资金	912,835.28
结算备付金	3,415.28
存出保证金	77,907.09
交易性金融资产	29,941,697.66
其中：股票投资	29,941,697.66
其他资产	49,181.03
<b>资产总计</b>	<b>30,985,036.34</b>

<b>负债：</b>	
应付清算款	157,557.22
应付管理人报酬	9,184.26
应付托管费	2,449.12
其他负债	38,862.27
<b>负债合计</b>	<b>208,052.87</b>
<b>净资产：</b>	
实收基金	30,457,627.00
未分配利润	319,356.47
<b>净资产合计</b>	<b>30,776,983.47</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>30,985,036.34</b>

## 四、清算情况

自 2024 年 9 月 3 日至 2024 年 9 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) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 3,415.28 元，其中上海最低结算备付金为人民币 3,010.50 元，应计利息为人民币 127.56 元；深圳最低结算备付金为人民币 133.95 元，应计利息为人民币 143.27 元。上海最低结算备付金于 2024 年 9 月 9 日由备付金账户划至托管账户人民币 1,466.92 元，清算期间产生的利息人民币 1.61 元；深圳最低结算备付金于 2024 年 9 月 9 日由托管账户划至备付金账户人民币 8,020.35 元，清算期间产生的利息人民币 4.13 元。于本基金清算结束日，上海最低结算备付金人民币 1,543.58 元及应计利息人民币 129.17 元、深圳最低结算备付金人民币 8,154.30 元及应计利息人民币 147.40 元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 77,907.09 元，其中上海存出保证金为人民币 19,024.62 元，应计利息为人民币 62.06 元；深圳存出保证金为人民币 58,633.71 元，应计利息为人民币 186.70 元。上海存出保证金于 2024 年 9 月 3 日由保证金账户划至托管账户人民币 5,988.25 元，清算期间产生的利息人民币 10.03 元；深圳存出保证金于 2024 年 9 月 3 日由保证金账户划至托管账户人民币 20,062.24 元，清算期间产生的利息人民币 29.58 元；于本基金清算结束日，上海存出保证金人民币 13,036.37 元及应计利息人民币 72.09 元、深圳存出保证金人民币 38,571.47 元及应计利息人民币 216.28 元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 29,941,697.66 元。全部为股票投资，明细如下：

单位：人民币元

交易平台	股票名称	股票代码	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
上交所	三一重工	600031	16.31	58,400	906,985.08	952,504.00
上交所	宇通客车	600066	20.79	13,200	325,973.66	274,428.00
上交所	复星医药	600196	22.38	12,600	339,416.09	281,988.00
上交所	恒瑞医药	600276	43.90	43,933	1,866,353.07	1,928,658.70
上交所	中航机载	600372	10.81	23,813	309,452.03	257,418.53
上交所	昊华科技	600378	26.00	3,300	95,006.29	85,800.00
上交所	健康元	600380	9.70	10,900	128,965.43	105,730.00
上交所	国电南瑞	600406	24.72	39,658	900,623.36	980,345.76
上交所	恒生电子	600570	15.84	14,908	377,935.78	236,142.72
上交所	天地科技	600582	5.74	16,100	97,065.38	92,414.00
上交所	用友网络	600588	8.32	20,165	287,941.80	167,772.80
上交所	浙数文化	600633	8.08	7,300	79,991.12	58,984.00
上交所	中航重机	600765	16.68	10,400	206,036.39	173,472.00
上交所	宝信软件	600845	28.90	8,488	281,346.18	245,303.20
上交所	宏发股份	600885	26.18	8,200	226,379.01	214,676.00
上交所	恒立液压	601100	50.81	5,200	271,324.37	264,212.00
上交所	三六零	601360	6.86	35,200	303,033.39	241,472.00
上交所	长城汽车	601633	22.08	12,300	319,035.71	271,584.00
上交所	中国中车	601766	6.91	119,600	751,326.22	826,436.00
上交所	泛微网络	603039	27.78	1,400	47,306.00	38,892.00
上交所	汇顶科技	603160	61.20	2,700	166,010.75	165,240.00
上交所	赛腾股份	603283	60.11	1,300	107,235.67	78,143.00
上交所	万泰生物	603392	69.85	3,781	262,179.67	264,102.85
上交所	吉比特	603444	191.76	500	120,521.54	95,880.00
上交所	璞泰来	603659	11.14	10,415	238,920.45	116,023.10
上交所	鸣志电器	603728	34.26	1,500	67,030.95	51,390.00
上交所	兆易创新	603986	68.54	6,664	583,340.82	456,750.56
上交所	德业股份	605117	88.73	2,500	184,625.40	221,825.00
上交所	睿创微纳	688002	24.58	3,332	112,807.90	81,900.56
上交所	澜起科技	688008	49.95	8,909	485,818.36	445,004.55
上交所	中国通号	688009	4.99	25,329	144,857.76	126,391.71
上交所	中微公司	688012	127.82	4,119	573,475.14	526,490.58
上交所	海光信息	688041	77.87	9,116	678,135.75	709,862.92
上交所	拓荆科技	688072	120.96	1,448	231,571.29	175,150.08
上交所	盛美上海	688082	86.30	907	105,090.32	78,274.10
上交所	金山办公	688111	168.53	2,405	789,111.08	405,314.65
上交所	华海清科	688120	128.00	1,480	198,754.16	189,440.00
上交所	时代电气	688187	43.70	2,914	152,455.30	127,341.80
上交所	柏楚电子	688188	154.31	855	150,086.54	131,935.05

上交所	道通科技	688208	23.50	3,018	161,085.11	70,923.00
上交所	联影医疗	688271	104.20	3,634	480,112.93	378,662.80
上交所	复旦微电	688385	26.41	3,541	198,648.74	93,517.81
上交所	铁建重工	688425	3.40	15,843	62,800.86	53,866.20
上交所	萤石网络	688475	25.51	1,636	61,250.24	41,734.36
上交所	百利天恒	688506	163.62	835	165,748.02	136,622.70
上交所	奥特维	688516	33.92	1,637	80,058.03	55,527.04
上交所	奇安信	688561	21.11	3,057	196,218.02	64,533.27
上交所	中控技术	688777	38.92	6,310	284,900.22	245,585.20
深交所	中兴通讯	000063	24.20	31,300	834,507.72	757,460.00
深交所	中联重科	000157	6.14	48,800	359,651.33	299,632.00
深交所	徐工机械	000425	6.37	69,700	501,868.35	443,989.00
深交所	丽珠集团	000513	35.78	3,690	136,994.96	132,028.20
深交所	长春高新	000661	79.40	3,190	458,816.21	253,286.00
深交所	振华科技	000733	36.24	3,900	255,441.78	141,336.00
深交所	华兰生物	002007	14.91	10,700	204,047.26	159,537.00
深交所	大族激光	002008	18.88	8,187	181,075.56	154,570.56
深交所	航天电器	002025	47.19	2,700	134,725.81	127,413.00
深交所	思源电气	002028	65.45	6,100	440,531.26	399,245.00
深交所	紫光国微	002049	46.37	6,820	486,371.87	316,243.40
深交所	广电运通	002152	9.26	12,300	130,906.46	113,898.00
深交所	中航光电	002179	37.02	12,614	483,332.35	466,970.28
深交所	纳思达	002180	24.37	9,900	281,013.87	241,263.00
深交所	科大讯飞	002230	33.39	18,273	804,881.25	610,135.47
深交所	大华股份	002236	13.52	19,300	328,603.21	260,936.00
深交所	恩华药业	002262	25.85	6,000	146,993.30	155,100.00
深交所	北方华创	002371	307.40	3,200	926,804.22	983,680.00
深交所	广联达	002410	9.43	13,247	244,986.87	124,919.21
深交所	高德红外	002414	6.00	16,724	121,078.89	100,344.00
深交所	海康威视	002415	26.17	36,900	1,234,656.14	965,673.00
深交所	科伦药业	002422	30.62	11,000	314,367.65	336,820.00
深交所	启明星辰	002439	12.54	7,300	153,672.17	91,542.00
深交所	沪电股份	002463	32.82	13,300	491,091.19	436,506.00
深交所	恺英网络	002517	8.88	21,200	216,828.23	188,256.00
深交所	巨人网络	002558	9.12	13,500	142,428.75	123,120.00
深交所	比亚迪	002594	241.10	8,900	2,277,702.42	2,145,790.00
深交所	世纪华通	002602	3.31	58,663	265,932.36	194,174.53
深交所	完美世界	002624	7.30	13,200	145,887.22	96,360.00
深交所	美亚光电	002690	12.43	3,474	68,506.09	43,181.82
深交所	恩捷股份	002812	26.19	5,800	301,386.94	151,902.00
深交所	神州泰岳	300002	8.79	19,200	179,775.45	168,768.00
深交所	乐普医疗	300003	9.57	13,040	219,823.55	124,792.80
深交所	同花顺	300033	98.94	2,000	239,795.85	197,880.00

深交所	汇川技术	300124	42.04	18,550	1,095,094.88	779,842.00
深交所	沃森生物	300142	10.14	15,900	351,070.07	161,226.00
深交所	北京君正	300223	44.95	3,400	205,395.47	152,830.00
深交所	晶盛机电	300316	22.51	6,496	270,115.36	146,224.96
深交所	三环集团	300408	30.49	13,389	379,202.46	408,230.61
深交所	昆仑万维	300418	25.83	8,400	256,419.32	216,972.00
深交所	先导智能	300450	13.75	10,720	294,653.07	147,400.00
深交所	深信服	300454	44.87	2,456	173,147.36	110,200.72
深交所	中科创达	300496	33.25	3,700	273,221.81	123,025.00
深交所	精测电子	300567	53.08	1,800	118,907.59	95,544.00
深交所	亿联网络	300628	31.66	4,850	173,104.91	153,551.00
深交所	圣邦股份	300661	70.20	3,233	287,469.89	226,956.60
深交所	迈瑞医疗	300760	246.48	6,020	1,770,581.43	1,483,809.60
深交所	卓胜微	300782	63.15	3,766	397,234.77	237,822.90
深交所	新产业	300832	64.96	3,100	213,443.94	201,376.00
深交所	安克创新	300866	62.50	1,950	127,965.71	121,875.00
深交所	爱美客	300896	138.64	1,660	462,253.03	230,142.40
深交所	华大九天	301269	72.50	2,100	181,371.34	152,250.00

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 30,279,322.31 元，已于清算期间划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日其他资产为待摊登记结算费人民币 49,181.03 元，清算期间摊销登记结算费人民币 24,181.03 元，剩余人民币 25,000.00 元转入其他应收款，该款项将于本基金终止上市并退出登记后收回。

## 2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 157,557.22 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 9,184.26 元、应付托管费为人民币 2,449.12 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 38,862.27 元，其中人民币 33,606.06 元为预提信息披露费，将于清算期后支付，不计入剩余财产予以分配；人民币 4,924.66 元为应付指数使用费，将于清算期后支付，不计入剩余财产予以分配；人民币 331.55 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

金额单位：人民币元

项目	2024年9月3日至 2024年9月19日止 清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	21,048.85
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	333,203.99
股利收入	2,120.00
股息红利个税	-29,084.45
清算期间收益小计	327,288.39
二、清算期间费用	
其他费用	24,181.03
清算期间费用小计	24,181.03
三、清算期间净收益	303,107.36

注 1：利息收入系计提的自 2024 年 9 月 3 日至 2024 年 9 月 19 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：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

金额单位：人民币元

项目	金额
一、2024 年 9 月 2 日(基金最后运作日) 净资产	30,776,983.47
加：清算期间净收益	303,107.36
减：基金净赎回金额	-
二、2024 年 9 月 19 日(清算期结束日)净资产	31,080,090.83

截至清算期结束日 2024 年 9 月 19 日，本基金剩余财产为人民币 31,080,090.83 元。自清算期结束日次日 2024 年 9 月 20 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。

## 五、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、《银华中证研发创新 100 交易型开放式指数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〈银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金清算报告〉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。