

银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

清算报告公告日：2020年12月10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.....	7
五、备查文件.....	13

重要提示

银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已于 2017 年 7 月 4 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[2017]1123 号文准予注册，自 2017 年 9 月 15 日起《银华智能汽车量化优选股票型发起式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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“基金合同生效之日起三年后的对应自然日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同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 2017 年 9 月 15 日。截至 2020 年 9 月 15 日，本基金《基金合同》生效满 3 年，经本基金登记机构确认，截至《基金合同》生效之日起三年后的对应自然日（即 2020 年 9 月 15 日），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，本基金管理人已终止本基金《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 2020 年 9 月 16 日刊登在规定媒介上的《银华智能汽车量化优选股票型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 2020 年 9 月 24 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 2020 年 9 月 24 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事宜出具法律意见。

一、基金概况

基金名称	银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金
基金简称	银华智能汽车量化股票发起式
基金代码	A类代码：005033，C类代码：005034
基金运作方式	契约型开放式。
基金投资目标	本基金综合使用多种量化选股策略，重点投资于汽车产业升级、智能化、电动化及后市场的相关的上市公司，在有效控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
业绩比较基准	中证汽车指数收益率×90%+商业银行人民币活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。
基金合同生效日	2017年9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
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司

二、基金运作情况

本基金的募集已于 2017 年 7 月 4 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[2017]1123 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 2017 年 8 月 14 日至 2017 年 9 月 8 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2017 年 9 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 13,888,342.56 份（含募集期间利息结转的份额），自 2017 年 9 月 15 日至 2020 年 9 月 23 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“基金合同生效之日起三年后的对应自然日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同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 2017 年 9 月 15 日。截至 2020 年 9 月 15 日，本基金《基金合同》生效满 3 年，经本基金登记机构确认，截至《基金合同》生效之日起三年后的对应自然日（即 2020 年 9 月 15 日），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，本基金管理人已终止本基金《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 2020 年 9 月 16 日刊登在规定媒介上的《银华智能汽车量化优选股票型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 2020 年 9 月 24 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 2020 年 9 月 24 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事宜出具法律意见。

三、财务会计报告

1、清算期间

银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金的清算期间为 2020 年 9 月 24 日至 2020 年 10 月 23 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智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金全体持有人以及中国证监会使用。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 2020 年 9 月 23 日
资产：	
银行存款	3,796,565.67
结算备付金	76,496.73
存出保证金	5,803.14
交易性金融资产	19,329,575.01
应收利息	107.48
资产总计	23,208,548.03

负债：	
应付证券清算款	166.37
应付赎回款	766,235.56
应付管理人报酬	17,851.18
应付托管费	1,785.13
应付销售服务费	2,127.71
应付交易费用	62,701.36
其他负债	362.93
负债合计	851,230.24
所有者权益：	
实收基金	19,919,315.02
未分配利润	2,438,002.77
所有者权益合计	22,357,317.79
负债和所有者权益总计	23,208,548.03

四、清算情况

自2020年9月24日至2020年10月23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 76,496.73 元, 其中人民币 14,499.47 元已于 2020 年 10 月 12 日划至托管账户。清算期间本基金支付结算备付金人民币 4,514.37 元, 截至 2020 年 10 月 23 日结算备付金余额为人民币 66,511.63 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) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 5,803.14 元, 该款项已于 2020 年 10 月 12 日划至托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 107.48 元, 包括应收银行存款利息人民币 96.38 元、应收结算备付金利息人民币 10.32 元及应收存出保证金利息人民币 0.78 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, 垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 19,329,575.01 元, 全部为股票投资, 明细如下:

金额单位: 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	宇通客车	600066	15.82	13,740	190,553.93	217,366.80
上交所	林海股份	600099	6.99	14,990	106,395.57	104,780.10
上交所	上汽集团	600104	19.83	54,975	1,183,150.63	1,090,154.25
上交所	广汇汽车	600297	3.53	16,674	62,569.54	58,859.22
上交所	贵航股份	600523	17.30	9,623	173,878.11	166,477.90
上交所	福耀玻璃	600660	34.04	18,593	424,526.05	632,905.72
上交所	交运股份	600676	5.34	17,714	96,116.01	94,592.76

上交所	均胜电子	600699	23.71	3,379	78,454.02	80,116.09
上交所	华域汽车	600741	26.87	53,988	1,301,812.54	1,450,657.56
上交所	一汽富维	600742	10.62	40,722	384,983.96	432,467.64
上交所	中路股份	600818	10.99	11,713	124,330.30	128,725.87
上交所	爱柯迪	600933	14.74	6,183	80,870.47	91,137.42
上交所	渤海汽车	600960	3.38	81,012	283,713.68	273,820.56
上交所	广汽集团	601238	10.13	77,043	769,236.20	780,445.59
上交所	长城汽车	601633	17.73	75,037	832,950.50	1,330,406.01
上交所	拓普集团	601689	40.13	15,484	448,451.74	621,372.92
上交所	星宇股份	601799	155.64	1,547	183,683.10	240,775.08
上交所	中国汽研	601965	11.88	2,360	24,855.29	28,036.80
上交所	威帝股份	603023	4.94	13,264	65,065.45	65,524.16
上交所	凯众股份	603037	16.38	7,204	124,108.96	118,001.52
上交所	新坐标	603040	32.99	5,668	180,240.52	186,987.32
上交所	天成自控	603085	9.51	6,975	57,584.12	66,332.25
上交所	腾龙股份	603158	22.34	2,218	50,847.07	49,550.12
上交所	保隆科技	603197	27.84	7,352	227,809.53	204,679.68
上交所	旭升股份	603305	37.26	8,077	321,310.28	300,949.02
上交所	伯特利	603596	34.41	4,916	167,319.31	169,159.56

上交所	诺力股份	603611	18.52	10,138	205,049.09	187,755.76
上交所	隆鑫通用	603766	3.94	28,961	130,495.93	114,106.34
上交所	科博达	603786	73.55	9,104	625,765.52	669,599.20
上交所	新日股份	603787	26.33	4,602	117,266.74	121,170.66
上交所	宁波高发	603788	17.42	35,134	641,118.40	612,034.28
深交所	富奥股份	000030	6.73	27,541	181,182.81	185,350.93
深交所	潍柴动力	000338	15.48	114,143	1,522,395.36	1,766,933.64
深交所	江铃汽车	000550	16.56	5,326	78,319.46	88,198.56
深交所	万向钱潮	000559	5.75	20,630	115,292.53	118,622.50
深交所	威孚高科	000581	25.21	21,089	469,238.39	531,653.69
深交所	长安汽车	000625	14.33	33,575	367,039.41	481,129.75
深交所	浩物股份	000757	4.46	5,853	26,455.14	26,104.38
深交所	一汽解放	000800	12.87	42,495	538,787.54	546,910.65
深交所	中鼎股份	000887	10.73	22,452	237,099.36	240,909.96
深交所	云内动力	000903	6.36	29,588	192,281.16	188,179.68
深交所	中国重汽	000951	36.60	20,005	582,482.25	732,183.00
深交所	中通客车	000957	8.03	4,798	35,696.19	38,527.94
深交所	广东鸿图	002101	7.00	17,513	125,794.92	122,591.00
深交所	银轮股份	002126	12.52	42,057	567,373.99	526,553.64

深交所	天润工业	002283	6.05	15,108	96,172.92	91,403.40
深交所	亚太股份	002284	5.20	10,550	56,745.44	54,860.00
深交所	万里扬	002434	10.20	7,967	72,517.58	81,263.40
深交所	松芝股份	002454	5.96	16,019	89,214.75	95,473.24
深交所	旷达科技	002516	3.85	73,549	279,797.06	283,163.65
深交所	比亚迪	002594	110.40	8,917	569,920.22	984,436.80
深交所	浙江世宝	002703	4.68	36,298	188,279.42	169,874.64
深交所	华阳集团	002906	16.59	6,702	133,408.73	111,186.18
深交所	德赛西威	002920	70.25	7,477	474,900.68	525,259.25
深交所	精锻科技	300258	16.29	39,893	636,546.74	649,856.97
合计				1,287,935	17,301,454.61	19,329,575.01

以上股票投资于清算期处置变现,变现产生的证券清算款为人民币 18,522,811.44 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证券清算款为人民币 166.37 元,该款项已于 2020 年 9 月 24 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日应付赎回款人民币 766,235.56 元、应付管理人报酬人民币 17,851.18 元、应付托管费人民币 1,785.13 元、应付销售服务费人民币 2,127.71 元和应付交易费用人民币 62,701.36 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 362.93 元,为应付赎回费,该款项已于 2020 年 9 月 24 日及 2020 年 9 月 25 日支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2020年9月24日至 2020年10月23日止 清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	5,399.37
处置交易性金融资产产生的净损失（注2）	-786,576.36
股息红利个税（注3）	-3,908.75
清算期间收益小计	-785,085.74
二、清算期间费用	
交易费用	33,748.05
汇划费	143.00
清算期间费用小计（注4）	33,891.05
三、清算期间净损失	-818,976.79

注1：利息收入系计提的自2020年9月24日至2020年10月23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损失系清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票最后运作日的股票估值总额后的差额。

注3：股息红利个税系根据《股息红利差别化纳税会计核算细则》（中基协发[2012]21号），于最后运作日转让交割股票后的次一交易日，根据中登公司按投资者实际持股期限计算的应缴税额计提应缴税款而确认的红字股利收益。

注 4：除上述清算费用外的其他与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

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2020年9月23日基金净资产	22,357,317.79
加：清算期间净损失	-818,976.79
减：基金净赎回金额（于2020年9月24日确认的投资者赎回申请）	368,510.95
2020年10月23日基金净资产	21,169,830.05

截至清算期结束日 2020 年 10 月 23 日，本基金剩余财产为人民币 21,169,830.05 元。自清算期结束日次日 2020 年 10 月 24 日至清算款划出日前一日的银行存款等产生的利息亦属份额持有人所有，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、《银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见》

（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。