

银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式  
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：中国建设银行股份有限公司

清算报告公告日：2019年12月7日

## 目录

重要提示 .....	3
一、基金概况 .....	5
二、基金运作情况 .....	6
三、财务会计报告 .....	6
四、清算情况 .....	10
五、备查文件 .....	12

## 重要提示

银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已于 2015 年 7 月 15 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[2015]1670 号文准予注册，自 2015 年 11 月 16 日起基金合同生效，基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》、《银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“三、基金合同的终止事由”的约定：“3、本基金自基金合同生效之日起满 3 年后，在任一开放期的最后一个开放日日终，有下列情形之一的，基金管理人应当终止本基金合同：

- （1）基金份额持有人数量不满 200 人的；
- （2）基金资产净值低于 5000 万元的；”

经本基金注册登记机构确认最后一个开放日日终（即 2019 年 8 月 30 日），银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式基金（以下简称“本基金”）基金资产净值低于 5000 万元，本基金出现了基金合同终止事由。银华基金管理股份有限公司决定终止基金合同并依法履行基金财产清算程序。根据基金合同约定，本基金进入基金财产清算程序不需召开基金份额持有人大会。详见刊登在 2019 年 9 月 4 日指定媒介和基金管理人网站（[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)）上的《银华逆向投资灵活配置定期开放混合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 2019 年 9 月 3 日起进入财产清算期，基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2019 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，并由德勤华永会计师事务所（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	银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	银华逆向投资灵活配置定期开放混合发起式
基金主代码	001729
基金运作方式	契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式
基金投资目标	本基金将采用逆向投资策略，深入分析挖掘社会经济发展进程中各类行业或主题得以产生和持续的内在驱动因素，重点投资于市场预期不充分的上市公司，同时通过优化风险收益配比来追求绝对收益，力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	年化收益率 6%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。
基金合同生效日	2015 年 11 月 16 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司

基金托管人	中国建设银行股份有限公司
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 2015 年 7 月 15 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【2015】1670 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 2015 年 11 月 9 日至 2015 年 11 月 11 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2015 年 11 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 45,924,937.09 份（含募集期间利息结转的份额），自 2015 年 11 月 16 日至 2019 年 9 月 2 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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《基金合同》的有关规定，基金管理人决定终止《银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》。根据基金合同约定，本基金进入基金财产清算程序不需召开基金份额持有人大会。本基金从 2019 年 9 月 3 日起进入清算期。

## 三、财务会计报告

### 1、清算期间

银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金的清算期间为 2019 年 9 月 3 日至 2019 年 9 月 24 日止。

### 2、清算财务报表的编制基础

本清算财务报表系本基金因基金财产清算而向中国证监会备案及公告清算报告之目的而编制。基于此目的，本清算财务报表系在清算基础上，参照《企业

会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》厘定的会计政策和会计估计编制。

## 清算资产负债表

单位：人民币元

项目	2019年9月24日 (清算结束日)	2019年9月2日 (最后运作日)
<b>资产：</b>		
银行存款	46,292,786.33	5,885,314.47
结算备付金	4,025,406.45	4,673,559.21
存出保证金	93,287.49	118,082.41
交易性金融资产	-	40,619,555.00
应收利息	4,442.91	22,724.67
应收申购款	-	39,956.73
<b>资产总计</b>	<b>50,415,923.18</b>	<b>51,359,192.49</b>
<b>负债：</b>		
应付赎回款	-	2,334,327.79
应付赎回费	-	5,577.16
应付管理费	-	48,939.68
应付托管费	-	12,234.91
应付交易费用	-	75,067.45



其他负债	-	87,261.65
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>2,563,408.64</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	49,332,652.15	49,332,652.15
未分配利润	1,083,271.03	-536,868.30
<b>所有者权益合计</b>	<b>50,415,923.18</b>	<b>48,795,783.85</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>50,415,923.18</b>	<b>51,359,192.49</b>

清算损益表

单位：人民币元

项目	2019年9月3日（清算开始日） 至2019年9月24日（清算结束日） 止期间
<b>一、 收入</b>	<b>1,675,324.16</b>
1、利息收入	18,439.29
2、投资收益	2,139,057.18
3、公允价值变动损益	-482,172.31
<b>二、 费用</b>	<b>55,184.83</b>

1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、交易费用	88,747.38
4、其他费用	-33,562.55
<b>三、 利润总额</b>	<b>1,620,139.33</b>
减：所得税费用	-
<b>四、 净收益</b>	<b>1,620,139.33</b>

#### 四、清算情况

自2019年9月3日至2019年9月24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、 根据《银华逆向投资灵活配置定期开放混合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2019年9月3日（清算开始日）起（含2019年9月3日）至基金财产清算完毕，停止收取基金管理费、基金托管费。
- 2、 资产处置情况

(1) 本基金2019年9月2日（最后运作日）应收利息为人民币22,724.67元，包括应收结算备付金利息人民币15,096.61元、应收银行存款利息人民币7,081.98元、应收结算保证金利息人民币416.51元、应收债券利息人民币129.48元及应收TA申购款利息人民币0.09元。截至2019年9月24日（清算结束日）应收利息余额为人民币4,442.91元，包括应收银行存款利息人民币3,701.55元、应收结算备付金利息人民币724.56元及应收存出保证金利息人民币16.80元。

(2) 本基金2019年9月2日（最后运作日）持有的交易性金融资产为人民币40,619,555.00元，其中股票投资为人民币40,609,385.00元，债券投资为人民币10,170.00元，截至2019年9月24日（清算结束日）已全部处置。

### 3、 负债清偿情况

本基金2019年9月2日（最后运作日）的应付赎回款为人民币2,334,327.79元，应付赎回费为人民币5,577.16元，应付管理费和应付托管费分别为人民币48,939.68元和人民币12,234.91元，应付交易费用为人民币75,067.45元，其他负债为人民币87,261.65元，上述款项除其他负债中的预提审计费外均已于清算期内支付，预提审计费于清算期内冲销。

### 4、 资产处置及负债清偿后剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、2019年9月2日（最后运作日）所有者权益	48,795,783.85
加：清算期间净收益	1,620,139.33
减：基金净赎回金额	-
二、2019年9月24日（清算结束日）所有者权益	50,415,923.18

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（本基金清算费用由基金管理人承担）、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。自清算期结束日次日2019年9月25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、《银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于银华逆向投资灵活配置定期开放混合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。

银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

二〇一九年十二月七日