

华夏上海清算所 1-3 年高等级国企中期票据指数证券投资基金  
清算报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二二年六月三十日

清算报告公告日：二〇二二年七月五日

## 目录

重要提示 .....	3
一、基金概况 .....	3
二、基金运作情况 .....	4
三、财务会计报告 .....	4
四、清算情况 .....	6
五、备查文件 .....	8

## 重要提示

华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金（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1月2日证监许可[2020]12号文准予注册，本基金基金合同自2020年9月29日起生效，本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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》《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》《华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，上述议案于2022年6月20日获得通过，持有人大会决议自同日起生效。本基金以2022年6月21日为最后运作日，自2022年6月22日起，本基金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）和北京市天元律师事务所成立基金财产清算组履行基金财产清算程序，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，由北京市天元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	华夏上海清算所 1-3 年高等级国企中期票据指数证券投资基金	
基金简称	华夏上清所 1-3 年高等级国企中票	
基金主代码	009445	
各份额类别简称及基金交易代码	华夏上清所 1-3 年高等级国企中票 A	华夏上清所 1-3 年高等级国企中票 C
	009445	009446
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 月 29 日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	

## 二、基金运作情况

本基金经中国证监会2020年1月2日证监许可[2020]12号文准予注册，由基金管理人依照法律法规、本基金基金合同、招募说明书等规定自2020年7月1日至2020年9月25日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2020年9月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为349,344,242.97份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为662户。

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》《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》《华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，上述议案于2022年6月20日获得通过，持有人大会决议自同日起生效。本基金以2022年6月21日为最后运作日，自2022年6月22日起，本基金进入基金财产清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

## 三、财务会计报告

### （一）基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金

报告截止日：2022年6月21日

单位：人民币元

	最后运作日 2022年6月21日
<b>资产：</b>	
银行存款	588,641.06
结算备付金	11.08
存出保证金	-
交易性金融资产	-

其中：股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	-
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	588,652.14
<b>负债：</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	66.90
应付托管费	22.29
应付销售服务费	36.86
应付交易费用	-
应付税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	127,921.74
负债合计	128,047.79
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	494,102.17
未分配利润	-33,497.82
所有者权益合计	460,604.35
负债和所有者权益总计	588,652.14

注：①报告截止日 2022 年 6 月 21 日（本基金最后运作日），本基金 A 类、C 类基金份额净值均为 0.9322 元；本基金基金份额总额为 494,102.17 份（其中 A 类基金份额 152,666.73 份，C 类基金份额 341,435.44 份）。

②本基金截至最后运作日的财务报表以清算基础编制。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

## 四、清算情况

自2022年6月22日起至2022年6月30日止为本基金清算报告期，基金财产清算组按照法律法规及《基金合同》等规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

### （一）清算费用

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，本基金的清算费用将由基金管理人承担。

### （二）最后运作日资产清算情况

截至清算报告期结束日（2022年6月30日），本基金最后运作日的银行存款应计利息尚未收回。为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，本基金管理人以自有资金对尚未收回的应计利息进行垫付，该垫付资金将于结息后返还给基金管理人。各项资产清算情况如下：

本基金最后运作日银行存款应计利息为人民币5.72元，已由基金管理人于2022年6月28日以自有资金垫付至托管账户。

本基金最后运作日结算备付金为人民币11.08元，已由基金管理人于2022年6月23日划至托管账户。

### （三）最后运作日负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币66.90元，该款项已于2022年6月27日支付。

2、本基金最后运作日应付托管费为人民币22.29元，该款项已于2022年6月28日支付。

3、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币36.86元，该款项已于2022年6月27日支付。

4、本基金其他负债为人民币127,921.74元，其中：应付指数使用费为人民币64,621.74元，预提账户维护费为人民币9,300.00元，预提信息披露费为人民币

54,000.00元，上述款项已分别于2022年6月23日、2022年6月28日、2022年6月29日支付。

(四) 本次清算报告期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2022年6月22日至2022年6月30日止清算报告期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	45.12
清算收入小计	45.12
二、清算费用（注2）	-
清算费用小计	-
三、清算净收益	45.12

表中相关项目具体说明如下：

注 1：利息收入 45.12 元系以当前适用的利率计提的自 2022 年 6 月 22 日起至 2022 年 6 月 30 日止清算报告期间的银行存款利息，由基金管理人以自有资金垫付。

注 2：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，本基金的清算费用由基金管理人承担。

(五) 截至本次清算报告期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2022年6月21日基金净资产	460,604.35
减：最后运作日有效赎回、转换转出申请对应赎回款	1.86
加：清算报告期间净收益	45.12
二、2022年6月30日基金净资产	460,647.61

截至本基金清算报告期结束日2022年6月30日，本基金剩余财产为人民币460,647.61元。自清算报告期结束日次日（2022年7月1日）至本次清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。

(六) 基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行剩余财产分配。

## 五、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、《华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金清算审计报告》
- 2、《华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金清算的法律意见》

### （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。

华夏上海清算所1-3年高等级国企中期票据指数证券投资基金基金财产清算组

二〇二二年七月五日