

银华信息科技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：2023年3月16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.....	9
五、备查文件.....	14

## 重要提示

银华信息科技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 6 月 28 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】1078 号文准予注册，自 2017 年 9 月 15 日起《银华信息科技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《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》、《基金合同》等有关规定，本基金基金份额持有人大会于 2023 年 1 月 9 日以通讯方式表决通过了《关于终止银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。本基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告详见 2023 年 1 月 10 日刊登在规定媒介上的《关于银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金最后运作日为 2023 年 1 月 10 日，自 2023 年 1 月 11 日起进入基金财产清算程序，由基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市汉坤律师事务所上海分所于 2023 年 1 月 11 日成立基金财产清算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，北京市汉坤律师事务所上海分所对清算事宜出具法律意见。

## 一、基金概况

基金名称	银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金
基金简称	A类：银华信息科技量化优选股票发起式A， C类：银华信息科技量化优选股票发起式C
基金代码	A类：005035， C类：005036
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，重点投资于可以代表未来信息科技发展趋势的上市公司，在严格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	中信计算机指数收益率×30%+中信通信指数收益率×30%+中信电子元器件指数收益率×30%+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
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 6 月 28 日获中国证监会证监许可【2017】1078 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 16,045,923.77 份（含募集期间利息结转的份额），其中 A 类份额 13,446,397.28 份，C 类份额 2,599,526.49 份。自 2017 年 9 月 15 日至 2023 年 1 月 9 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》、《基金合同》等有关规定，本基金基金份额持有人大会于 2023 年 1 月 9 日以通讯方式表决通过了《关于终止银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。本基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告详见 2023 年 1 月 10 日刊登在规定媒介上的《关于银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金最后运作日为 2023 年 1 月 10 日，自 2023 年 1 月 11 日起进入基金财产清算程序，由基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市汉坤律师事务所上海分所于 2023 年 1 月 11 日成立基金财产清算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，北京市汉坤律师事务所上海分所对清算事宜出具法律意见。

### 三、财务会计报告

#### 1、清算期间

银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金的清算期间为 2023 年 1 月 11 日至 2023 年 2 月 14 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《资产管理产品相关会计处理规定》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信息科技量化优选股票型发起式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	2023 年 1 月 10 日 (最后运作日)
<b>资产：</b>	
银行存款	1,915,860.72
结算备付金	43,061.73
存出保证金	4,605.34
交易性金融资产	13,605,439.57
<b>资产总计</b>	<b>15,568,967.36</b>

<b>负债：</b>	
应付赎回款	21,008.06
应付管理人报酬	5,566.60
应付托管费	556.65
应付销售服务费	477.78
其他负债	119,147.66
<b>负债合计</b>	<b>146,756.75</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	15,000,135.58
未分配利润	422,075.03
<b>所有者权益合计</b>	<b>15,422,210.61</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>15,568,967.36</b>

## 清算损益表

单位：人民币元

项目	2023年1月11日(清算开始日)至2023年2
----	--------------------------

	月 14 日(清算结束日)止期间
<b>一、收入</b>	
1.利息收入（注 1）	1,304.29
2.处置交易性金融资产产生的净收益（注 2）	836,581.57
3.股息红利个税（注 3）	-47.16
4.其他收入	705.91
<b>二、费用</b>	
1.审计费（注 4）	15,000.00
2.律师费（注 5）	15,000.00
3.汇划费	124.15
<b>三、利润总额</b>	808,420.46
减：所得税费用	-
<b>四、净利润</b>	808,420.46

注 1：利息收入系计提的自 2023 年 1 月 11 日至 2023 年 2 月 14 日止清算期间的银行存款利息、备付金利息和保证金利息。

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。

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），于最后运作日和清算期间转让交割股票日后的次一交易日，根据中登公司按投资者实际持股期限计算的应缴税额而计提的应缴税款。

注 4：审计费系清算期间预提的清算审计费，将于清算结束后支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

注 5：律师费系清算期间预提的清算律师费，将于清算结束后支付给北京市汉坤律师事务所上海分所。

#### 四、清算情况

自 2023 年 1 月 11 日至 2023 年 2 月 14 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 43,061.73 元，其中上海结算备付金为人民币 14,282.81 元，应计利息为人民币 34.64 元；深圳结算备付金为人民币 28,692.39 元，应计利息为人民币 51.89 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 4,605.34 元，其中上海存出保证金为人民币 1,544.69 元，应计利息为人民币 1.19 元；深圳存出保证金为人民币 3,057.50 元，应计利息为人民币 1.96 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。

（3）本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 13,605,439.57 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（单位：股）	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
上交所	中国联通	600050	4.98	12,214.00	45,036.43	60,825.72
上交所	国网信通	600131	16.54	806.00	13,217.73	13,331.24

上交所	生益科技	600183	15.01	738.00	10,404.67	11,077.38
上交所	有研新材	600206	13.22	10,438.00	140,095.27	137,990.36
上交所	航天信息	600271	10.81	10,278.00	113,695.73	111,105.18
上交所	联创光电	600363	24.70	1,705.00	45,923.34	42,113.50
上交所	用友网络	600588	24.12	695.00	13,343.24	16,763.40
上交所	闻泰科技	600745	55.78	3,346.00	168,564.10	186,639.88
上交所	浙大网新	600797	6.16	1,454.00	7,793.21	8,956.64
上交所	宝信软件	600845	45.29	3,038.00	127,098.09	137,591.02
上交所	工业富联	601138	9.40	37,184.00	332,186.63	349,529.60
上交所	环旭电子	601231	16.46	6,666.00	116,613.50	109,722.36
上交所	龙宇燃油	603003	7.72	2,883.00	20,834.13	22,256.76
上交所	中科曙光	603019	22.85	12,271.00	293,813.18	280,392.35
上交所	移远通信	603236	113.01	80.00	8,336.01	9,040.80
上交所	永新光学	603297	90.62	843.00	79,703.24	76,392.66
上交所	韦尔股份	603501	85.49	628.00	60,801.46	53,687.72
上交所	国联股份	603613	96.78	4,130.00	452,694.49	399,701.40
上交所	石英股份	603688	141.07	1,438.00	187,858.08	202,858.66
上交所	春秋电子	603890	9.63	4,480.00	45,502.45	43,142.40
上交所	兆易创新	603986	106.38	274.00	30,901.29	29,148.12
上交所	立昂微	605358	44.06	1.00	47.01	44.06
深交所	深天马A	000050	8.95	6,211.00	57,385.99	55,588.45
深交所	中兴通讯	000063	25.49	16,437.00	393,781.82	418,979.13
深交所	京东方A	000725	3.67	37,547.00	139,225.28	137,797.49
深交所	创维数字	000810	14.82	1,163.00	18,320.79	17,235.66
深交所	紫光股份	000938	22.87	6,834.00	117,227.46	156,293.58
深交所	中科三环	000970	14.17	4,077.00	56,526.09	57,771.09
深交所	浪潮信息	000977	22.81	1,996.00	40,094.35	45,528.76
深交所	华工科技	000988	17.11	7,728.00	153,335.93	132,226.08
深交所	联创电子	002036	13.30	4,164.00	58,215.18	55,381.20
深交所	紫光国微	002049	124.05	1,849.00	260,011.94	229,368.45
深交所	横店东磁	002056	22.08	2,527.00	46,855.99	55,796.16
深交所	东华软件	002065	6.01	4,107.00	23,834.25	24,683.07
深交所	顺络电子	002138	27.17	1,376.00	30,587.70	37,385.92
深交所	石基信息	002153	15.36	622.00	7,922.86	9,553.92
深交所	纳思达	002180	53.50	4,476.00	244,716.81	239,466.00
深交所	科大讯飞	002230	34.12	3,852.00	134,526.42	131,430.24
深交所	大华股份	002236	11.62	15,603.00	188,342.92	181,306.86
深交所	歌尔股份	002241	18.28	16,391.00	338,708.77	299,627.48
深交所	川发龙蟒	002312	10.76	11,660.00	143,401.28	125,461.60
深交所	北方华创	002371	230.50	868.00	221,614.05	200,074.00

深交所	东山精密	002384	24.52	7,575.00	197,299.94	185,739.00
深交所	星网锐捷	002396	19.77	653.00	13,421.47	12,909.81
深交所	和而泰	002402	15.34	14,465.00	224,243.67	221,893.10
深交所	四维图新	002405	11.76	6,851.00	82,098.78	80,567.76
深交所	雅克科技	002409	51.80	2,883.00	162,172.57	149,339.40
深交所	广联达	002410	61.96	5,730.00	288,072.42	355,030.80
深交所	海康威视	002415	33.34	8,357.00	302,282.70	278,622.38
深交所	国星光电	002449	8.89	1,283.00	10,351.43	11,405.87
深交所	立讯精密	002475	29.65	19,024.00	650,235.05	564,061.60
深交所	江海股份	002484	24.65	7,874.00	183,024.94	194,094.10
深交所	捷顺科技	002609	8.56	6,597.00	54,539.14	56,470.32
深交所	木林森	002745	8.54	1,904.00	16,899.18	16,260.16
深交所	金溢科技	002869	26.73	535.00	11,850.67	14,300.55
深交所	三利谱	002876	39.99	1,133.00	48,294.02	45,308.67
深交所	意华股份	002897	59.97	444.00	23,771.83	26,626.68
深交所	奥士康	002913	25.46	1,307.00	34,613.71	33,276.22
深交所	深南电路	002916	74.52	265.00	20,023.52	19,747.80
深交所	盈趣科技	002925	17.74	4,708.00	85,934.22	83,519.92
深交所	鹏鼎控股	002938	27.66	8,626.00	233,337.37	238,595.16
深交所	网宿科技	300017	5.66	9,408.00	52,557.09	53,249.28
深交所	同花顺	300033	108.00	844.00	83,845.11	91,152.00
深交所	东方财富	300059	21.00	9,577.00	202,137.18	201,117.00
深交所	思创医惠	300078	4.61	10,199.00	47,278.98	47,017.39
深交所	高新兴	300098	3.19	24,738.00	83,712.88	78,914.22
深交所	万达信息	300168	8.17	1,511.00	13,680.92	12,344.87
深交所	美亚柏科	300188	13.53	2,024.00	24,891.84	27,384.72
深交所	有棵树	300209	5.39	15,945.00	95,853.34	85,943.55
深交所	鸿利智汇	300219	7.02	25,371.00	189,070.44	178,104.42
深交所	北京君正	300223	71.81	181.00	14,409.06	12,997.61
深交所	上海钢联	300226	29.20	2,916.00	57,594.51	85,147.20
深交所	瑞丰光电	300241	4.91	24,395.00	125,801.93	119,779.45
深交所	利亚德	300296	5.82	6,797.00	40,562.84	39,558.54
深交所	聚飞光电	300303	4.02	31,652.00	133,997.03	127,241.04
深交所	中际旭创	300308	28.25	3,073.00	90,331.81	86,812.25
深交所	中颖电子	300327	38.72	1,550.00	53,309.97	60,016.00
深交所	扬杰科技	300373	57.10	2,216.00	117,716.49	126,533.60
深交所	天华超净	300390	60.37	897.00	63,013.58	54,151.89
深交所	创业慧康	300451	8.33	3,508.00	28,245.86	29,221.64
深交所	深信服	300454	136.20	366.00	43,243.15	49,849.20
深交所	康拓红外	300455	7.75	23,461.00	194,838.54	181,822.75

深交所	胜宏科技	300476	13.41	3,119.00	42,785.89	41,825.79
深交所	中科创达	300496	107.69	2,463.00	301,239.87	265,240.47
深交所	长川科技	300604	41.25	3,613.00	175,504.96	149,036.25
深交所	华测导航	300627	28.10	810.00	25,123.59	22,761.00
深交所	广和通	300638	19.47	833.00	16,988.16	16,218.51
深交所	圣邦股份	300661	166.00	1,460.00	239,264.82	242,360.00
深交所	江丰电子	300666	73.82	833.00	69,108.18	61,492.06
深交所	朗新科技	300682	25.06	2,705.00	70,093.07	67,787.30
深交所	赛意信息	300687	31.11	4,037.00	114,770.55	125,591.07
深交所	光弘科技	300735	9.33	5,132.00	50,879.78	47,881.56
深交所	奥飞数据	300738	9.53	1,567.00	14,278.71	14,933.51
深交所	帝尔激光	300776	131.14	699.00	106,666.52	91,666.86
深交所	指南针	300803	52.04	2,359.00	109,292.56	122,762.36
深交所	安克创新	300866	61.48	1,006.00	59,030.74	61,848.88
上交所	光峰科技	688007	27.39	7,796.00	188,482.03	213,532.44
上交所	澜起科技	688008	63.46	3,733.00	215,103.99	236,896.18
上交所	中微公司	688012	100.14	1,830.00	196,288.92	183,256.20
上交所	乐鑫科技	688018	94.78	902.00	83,249.57	85,491.56
上交所	安恒信息	688023	166.24	3.00	442.54	498.72
上交所	国盾量子	688027	105.90	200.00	22,126.06	21,180.00
上交所	山石网科	688030	20.43	6,378.00	146,106.49	130,302.54
上交所	传音控股	688036	77.62	134.00	8,511.53	10,401.08
上交所	龙腾光电	688055	4.11	3,091.00	13,957.29	12,704.01
上交所	宝兰德	688058	42.99	7.00	286.51	300.93
上交所	航天宏图	688066	86.74	1,018.00	88,755.06	88,301.32
上交所	虹软科技	688088	23.78	5,372.00	138,079.77	127,746.16
上交所	威胜信息	688100	24.66	2,680.00	63,106.53	66,088.80
上交所	金山办公	688111	272.37	1,079.00	291,334.35	293,887.23
上交所	聚辰股份	688123	116.25	443.00	42,803.75	51,498.75
上交所	沪硅产业	688126	18.15	7,597.00	146,184.79	137,885.55
上交所	蓝特光学	688127	17.94	39.00	918.54	699.66
上交所	优刻得	688158	14.20	18.00	226.25	255.60
上交所	八亿时空	688181	38.64	29.00	1,170.96	1,120.56
上交所	柏楚电子	688188	208.01	4.00	864.67	832.04
上交所	华峰测控	688200	266.00	335.00	79,321.22	89,110.00
上交所	神工股份	688233	43.38	11.00	629.19	477.18
上交所	和达科技	688296	28.42	1,822.00	43,266.32	51,781.24
上交所	仕佳光子	688313	9.69	16.00	174.26	155.04
上交所	晶丰明源	688368	131.82	9.00	1,082.52	1,186.38
上交所	复旦微电	688385	72.83	1,599.00	116,905.40	116,455.17

上交所	嘉元科技	688388	47.65	2,548.00	140,938.17	121,412.20
上交所	华润微	688396	53.78	1,325.00	71,122.30	71,258.50
上交所	芯朋微	688508	76.69	196.00	10,586.40	15,031.24
上交所	芯原股份	688521	46.10	266.00	13,538.02	12,262.60
上交所	思瑞浦	688536	262.01	322.00	91,990.02	84,367.22
上交所	奇安信	688561	68.90	1,721.00	102,242.54	118,576.90
上交所	中科星图	688568	60.80	576.00	39,910.37	35,020.80
上交所	力合微	688589	37.77	10.00	384.27	377.70
上交所	恒玄科技	688608	119.82	93.00	23,751.27	11,143.26
上交所	罗普特	688619	10.86	56.00	805.13	608.16
上交所	宏微科技	688711	93.77	884.00	58,910.38	82,892.68
上交所	中控技术	688777	89.45	1,724.00	149,955.82	154,211.80
上交所	艾为电子	688798	108.18	8.00	1,032.84	865.44
上交所	瑞可达	688800	107.23	548.00	63,668.72	58,762.04
上交所	中芯国际	688981	41.56	8,080.00	362,465.08	335,804.80
合计				661,059.00	13,803,365.58	13,605,439.57

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 14,452,601.88 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赎回款为人民币 21,008.06 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 5,566.60 元、应付托管费为人民币 556.65 元、应付销售服务费为人民币 477.78 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 119,147.66 元，应付交易费用为人民币 49,131.92 元，其中人民币 43,055.43 元已于清算期内支付，剩余人民币 6,076.49 元于清算期结束后支付；人民币 40,000.00 元为预提审计费，将于收到发票后支付，不计入剩余财产予以分配；基金份额持有人大会费用为人民币 30,000.00 元，其中律师费人民币 20,000.00 元，已于清算期结束后支付；公证费人民币 10,000.00 元，已于清算期内支付；人民币 15.74 元为应付赎回费，已于清算期内支付。

## 3、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
----	----

一、2023年1月10日(最后运作日)所有者权益	15,422,210.61
加：清算期间净收益	808,420.46
减：基金净赎回金额(于2023年1月11日确认的 投资者赎回申请)	1,465,102.31
二、2023年2月14日(清算结束日)所有者权益	14,765,528.76

截至清算期结束日2023年2月14日，本基金剩余财产为人民币14,765,528.76元。自清算期结束日次日2023年2月15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、《银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金清算报表审计报告》
- 2、《北京市汉坤律师事务所上海分所关于银华基金管理股份有限公司银华信息科技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书》

### （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。