

富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金

清算报告

2024年8月26日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

公告日期：2024年8月28日

---

## 一、重要提示及目录

### 1、重要提示

富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]237号《关于准予富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行人募集，《富国中证银行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》”）于2020年4月1日生效。首次设立募集规模为312,618,589.00份基金份额。本基金为契约型交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《基金合同》，第五部分“基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”规定：“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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并6个月内召集基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

根据《基金合同》第二十一部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”之二“基金合同的终止事由”有以下约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、基金合同约定的其他情形；4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

根据基金管理人于2024年8月13日发布的《富国基金管理有限公司关于富国中证银行交易型开放式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的公告》，富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会已于2024年7月11日至2024年8月9日17时（投票表决时间以基金管理人收到表决票时间

---

为准)止对《关于终止富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》进行了投票表决,根据2024年8月12日的计票结果,该议案获得通过,大会决议自2024年8月12日起生效。

本基金清算期自2024年8月13日至2024年8月15日止。由基金管理人富国基金管理有限公司、基金托管人中信证券股份有限公司、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8月13日组成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)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

---

## 2、目录

|                            |    |
|----------------------------|----|
| 一、重要提示及目录.....             | 2  |
| 1、重要提示.....                | 2  |
| 2、目录.....                  | 4  |
| 二、基金概况.....                | 5  |
| 三、财务会计报告.....              | 5  |
| 四、清盘事项说明.....              | 6  |
| 1、基金基本情况.....              | 6  |
| 2、清算原因.....                | 7  |
| 3、清算起始日.....               | 7  |
| 4、清算财务报表编制基础.....          | 7  |
| 五、清算情况.....                | 8  |
| 1、资产处置情况.....              | 8  |
| 2、    负债清偿情况.....          | 9  |
| 3、    清算期间的清算损益情况.....     | 9  |
| 4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况..... | 10 |
| 6、基金财产清算报告的告知安排.....       | 10 |
| 六、备查文件目录.....              | 10 |
| 1、备查文件目录.....              | 10 |
| 2、存放地点.....                | 10 |
| 3、查阅方式.....                | 10 |

## 二、基金概况

- 1、基金名称：富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金简称：富国中证银行 ETF（基金主代码：515280）
- 3、基金运作方式：契约型、交易型开放式
- 4、基金合同生效日：2020 年 4 月 1 日
- 6、基金管理人：富国基金管理有限公司
- 7、基金托管人：中信证券股份有限公司
- 8、最后运作日（2024 年 8 月 12 日）基金份额总额：17,418,589.00
- 9、最后运作日（2024 年 8 月 12 日）基金资产净值：22,332,979.01 元

## 三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 8 月 12 日

单位：人民币元

|             | 最后运作日<br>2024 年 8 月 12 日 |
|-------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>  |                          |
| 货币资金        | 414,056.81               |
| 结算备付金       | 14,601.68                |
| 存出保证金       | 6,663.44                 |
| 交易性金融资产     | 22,029,416.78            |
| 应收清算款       | 14,581.58                |
| 其他资产        | 75,409.68                |
| 资产总计        | 22,554,729.97            |
| <b>负债：</b>  |                          |
| 应付清算款       | 133,608.28               |
| 应付管理人报酬     | 4,732.27                 |
| 应付托管费       | 946.43                   |
| 其他负债        | 82,463.98                |
| 负债合计        | 221,750.96               |
| <b>净资产：</b> |                          |
| 实收基金        | 17,418,589.00            |
| 未分配利润       | 4,914,390.01             |
| 净资产合计       | 22,332,979.01            |
| 负债和净资产总计    | 22,554,729.97            |

---

## 四、清盘事项说明

### 1、基金基本情况

富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证监会证监许可[2020]237号《关于准予富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人富国基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2020年4月1日生效。首次设立募集规模为312,618,589.00份基金份额。本基金为契约型交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准为：中证银行指数收益率。

---

## 2、清算原因

根据《富国中证银行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》”），第五部分“基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”规定：“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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并 6 个月内召集基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

根据《基金合同》第二十一部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”之二“基金合同的终止事由”有以下约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、基金合同约定的其他情形；4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

根据基金管理人于 2024 年 8 月 13 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国中证银行交易型开放式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的公告》，富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会已于 2024 年 7 月 11 日至 2024 年 8 月 9 日 17 时（投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准）止对《关于终止富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》进行了投票表决，根据 2024 年 8 月 12 日的计票结果，该议案获得通过，大会决议自 2024 年 8 月 12 日起生效。

## 3、清算起始日

根据《富国基金管理有限公司关于富国中证银行交易型开放式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的公告》，本基金自 2024 年 8 月 13 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2024 年 8 月 13 日。

## 4、清算财务报表编制基础

本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的《企业会计准则

---

则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。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，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

## 五、清算情况

自2024年8月13日至2024年8月15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) 本基金最后运作日货币资金为人民币 414,056.81 元，其中存放于托管账户人民币 413,195.99 元，应计银行存款利息人民币 860.82 元。上述应计银行存款利息将于 2024 年 8 月 15 日后划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 14,601.68 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币 13,172.15 元，应计结算备付金利息人民币 18.65 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金人民币 1,404.21 元，应计结算备付金利息人民币 6.67 元。上述款项中将于 2024 年 8 月 15 日后划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 6,663.44 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金人民币 3,175.76 元，应计存出保证金利息人民币 5.94 元；其中存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金人民币 3,474.10 元，应计存出保证金利息人民币 7.64 元。上述款项中将于 2024 年 8 月 15 日后划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 22,029,416.78 元，已于清算期间全部处置变现。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 14,581.58 元，该款项已于 2024 年 8 月 13 日划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日其他资产为人民币 75,409.68 元，均为待摊注册登记费，该款项将于 2024 年 8 月 15 日后划入托管账户。



## 2、负债清偿情况

(1)本基金最后运作日应付清算款为人民币 133,608.28 元，该款项已于 2024 年 8 月 13 日支付人民币 34,973.73 元，于 2024 年 8 月 14 日支付人民币 98,634.55 元。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 4,732.27 元，该款项将于 2024 年 8 月 15 日后支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币 946.43 元，该款项将于 2024 年 8 月 15 日后支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 82,463.98 元，其中应付交易费用人民币 440.83 元，应付指数使用费人民币 2,614.03 元，应付 2023 年度财务报表审计费人民币 18,000.00 元，预提清算财务报表审计费人民币 6,464.64 元，预提上证报披露费人民币 25,000.00 元，预提 IOPV 计算发布费人民币 29,944.48 元，上述款项将于 2024 年 8 月 15 日后支付。

## 3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目                        | 自2024年8月13日<br>至2024年8月15日<br>止清算期间 |
|---------------------------|-------------------------------------|
| 一、清算收益                    |                                     |
| 1、利息收入（注1）                | 2,035.93                            |
| 2、投资收益（损失以“-”号填列）（注2）     | 279,356.79                          |
| 3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）（注3） | -268,002.29                         |
| 清算收益小计                    | 13,390.43                           |
| 二、清算费用                    |                                     |
| 清算费用小计                    | -                                   |
| 三、清算净收益（净损失以“-”号填列）       | 13,390.43                           |

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2024年8月13日至2024年8月15日止清算期间的利息收入，其中银行存款利息人民币2,033.08元、结算备付金利息人民币1.95元和存出保证金利息人民币0.90元。上述款项将于2024年8月15日之后划入托管账户。

注2：投资收益系清算期间卖出股票事项所致。其中，卖出股票差价收入（卖出股票成交金额减去所卖出股票的初始投资成本）为人民币405,585.90元，因卖出股票而支付的红利补税款人民币110,711.83元以及卖出股票产生的交易费用人民币15,517.28元作为投资收益的扣减项

注3：公允价值变动收益系清算期间处置交易性金融资产事项所致，为原计入交易性

金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

#### 4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

| 项目                     | 金额            |
|------------------------|---------------|
| 一、最后运作日2024年8月12日基金净资产 | 22,332,979.01 |
| 加：清算期间净收益（净损失以“-”号填列）  | 13,390.43     |
| 二、2024年8月15日基金净资产      | 22,346,369.44 |

根据本基金的基金合同及《富国基金管理有限公司关于富国中证银行交易型开放式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的公告》，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、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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2024年8月15日止的剩余财产为人民币22,346,369.44元。

截至2024年8月15日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款（不含应计利息）余额共计人民币22,337,952.74元。

#### 6、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- （1）《富国中证银行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《富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

---

富国中证银行交易型开放式指数证券投资基金财产清算小组

2024年8月28日