

财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）

清算报告

基金管理人：财通证券资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告出具日期：2020 年 05 月 29 日

报告送出日期：2020 年 07 月 01 日

§ 1 重要提示

财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）（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”）证监许可[2018]2234号注册，于2019年6月27日正式生效，本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过了《关于终止财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同以及 A 类基金份额终止上市有关事项的议案》。基金份额持有人大会决议于2020年5月7日会议表决通过起生效。基金管理人于2020年5月8日发布了《财通证券资产管理有限公司关于财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》和《财通证券资产管理有限公司关于财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》等的有关规定，财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）（A类基金份额基金代码：169301；场内简称：财通 500）基金管理人财通证券资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）已向深圳证券交易所申请终止本基金A类基金份额的上市交易，并获得深圳证券交易所（《终止上市通知书》深证上（2020）397号）同意。

本基金自2020年5月18日起进入清算期，由基金管理人财通证券资产管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2020年5月18日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

§ 2 基金概况

基金名称	财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）
基金简称	财通资管中证500指数增强（LOF）
场内简称	财通500
基金主代码	169301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年06月27日
基金管理人	财通证券资产管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金最后运作日（2020年5月15日） 基金份额总额	9,070,463.14份
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019-07-31
投资目标	本基金为中证500指数增强型股票基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为中证500指数增强型股票基金，中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场上小市值公司的整体情况。本基金通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，

	同时力求实现超越标的的指数的业绩表现, 谋求基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金, 理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。	
下属分级基金的基金简称	财通500	财通500C
下属分级基金场内简称	财通500	-
下属分级基金的交易代码	169301	169302
报告期末下属分级基金的份额总额	8, 228, 771. 56份	841, 691. 58份

§ 3 基金运作情况说明

财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (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”) 证监许可[2018]2234 号《关于准予财通资管深证 100 低波动率指数证券投资基金 (LOF) 变更注册的批复》注册, 由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 271, 815, 259. 89 元, 经普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙) 普华永道中天验字 (2019) 第 0360 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2019 年 6 月 27 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 271, 867, 958. 45 份基金份额, 其中认购资金利息折合 52, 698. 56 份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

自 2019 年 6 月 27 日至 2020 年 5 月 15 日期间, 本基金按基金合同正常运作。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》和《财通证券资产管理有限公司关于财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》等的有关规定, 财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (A 类基金份额基金代码: 169301; 场内简称: 财通 500) 基金管理人财通证券资产管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 已向深圳证券交易所申请终止本基金 A 类基金份额的上市交易, 并获得深圳证券交易所 (《终止上市通知书》深证上 (2020) 397 号) 同意。

本基金自 2020 年 5 月 18 日起进入清算期, 由基金管理人财通证券资产管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙) 和上海市通力律师事务所于 2020 年 5 月 18 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

§ 4 财务会计报告

资产负债表 (已经审计)

会计主体: 财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2020 年 5 月 15 日 (基金最后运作日)

单位: 人民币元

资产	本期末 2020 年 5 月 15 日(基金最后运作日)
资产:	
银行存款	1,423,725.21
结算备付金	99,239.52
存出保证金	19,816.65
交易性金融资产	-
其中: 股票投资	-
应收证券清算款	8,841,863.34
应收利息	1,647.98
应收申购款	-
资产总计	10,386,292.70
负债和所有者权益	
负债:	
应付赎回款	315,409.62
应付管理人报酬	4,869.10
应付托管费	730.37
应付销售服务费	350.10
应付交易费用	11,808.90
应交税费	2,441.39
其他负债	326,954.66
负债合计	662,564.14
所有者权益:	
实收基金	9,070,463.14
未分配利润	653,265.42
所有者权益合计	9,723,728.56
负债和所有者权益总计	10,386,292.70

注: 1. 报告截止日 2020 年 5 月 15 日(基金最后运作日), A 类基金份额净值 1.0725 元, C 类基金份额净值 1.0675 元; 基金份额总额 9,070,463.14 份, 下属分级基金的份额总额分别为: A 类基金份额总额 8,228,771.56 份, C 类基金份额总额 841,691.58 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 5 月 15 日(基金最后运作日)止期间。

§ 5 清算情况

自 2020 年 5 月 18 日至 2020 年 5 月 28 日止为本基金清算期间，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的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。截止清算期结束日（2020 年 5 月 28 日），各项资产负债清算情况如下：

一、 资产情况：

- 1) 本基金最后运作日银行活期存款余额为人民币 1,423,725.21 元，清算期收到证券清算款 8,841,863.34 元，支付应付赎回款 423,642.41 元，支付股息红利税补缴款 1,065.41 元，支付深交所基金上市费 25,000 元，支付汇划费 70 元，截止清算结束日余额为人民币 9,815,810.73 元。
- 2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 99,239.52 元，清算期间未有变动。
- 3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 19,816.65 元，清算期间未有变动。
- 4) 本基金最后运作日应收证券清算款 8,841,863.34，已于 2020 年 5 月 18 日划入托管户；于 2020 年 5 月 18 日计提股息红利税补缴款 1,065.41 元，已于 2020 年 5 月 19 日通过托管户支付。
- 5) 本基金最后运作日应收利息为人民币 1,647.98 元，清算期间计提利息 1,150.55 元，截止清算结束日余额为人民币 2,798.53 元。

截止清算结束日，本基金总资产为 9,937,665.43 元。

二、 负债清偿情况

- 1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 315,409.62 元，清算期间产生 108,008.45 元，系本基金最后运作日（5 月 15 日）发起赎回申请，并于 5 月 18 日确认的客户赎回款。该款项已分别于 2020 年 5 月 18 日、5 月 19 日、5 月 20 日支付。
- 2) 本基金最后运作日应付赎回费 208.05 元，清算期间产生 16.29 元，系本基金最后运作日（5 月 15 日）发起并于 5 月 18 日确认的赎回交易产生。该款项已分别于 2020 年 5 月 18 日、5 月 19 日、5 月 20 日支付。
- 3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 4,869.10 元，清算期间未有变动。
- 4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 730.37 元，清算期间未有变动。
- 5) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 350.10 元，清算期间未有变动。
- 6) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 11,808.90 元，清算期间未有变动。

- 7) 本基金最后运作日应交税费为人民币 2,441.39 元, 该款项为应付增值税及其附加, 清算期间未有变动。
- 8) 本基金最后运作日其他应付款为人民币 124,725.25 元, 系应付指数公司指数使用费, 清算期间根据指数公司优惠政策冲销 24,472.44 元, 截止清算结束日余额为人民币 100,252.81 元。
- 9) 本基金最后运作日预提费用为人民币 202,021.36 元, 该款项包括审计费用 61,147.92 元 (含 2019 年尚未支付年审费用 50,000 元), 深交所上市费 22,294.48 元, 信息披露费 118,578.96 元 (含 2019 年尚未支付信息披露费用 100,000 元)。清算期间计提清算审计费 8,852.08 元, 预提汇划费 475.00 元, 计提上市费 2,705.52 元, 计提信息披露费 10,587.71 元, 并于 2020 年 5 月 19 日支付上市费 25,000 元。截止清算结束日预提费用余额为 199,641.67 元, 包括审计费用 70,000 元, 信息披露费 129,166.67 元, 汇划费 475.00 元。

三、清算期清算损益情况

报告期间: 2020 年 5 月 18 日 (清算期起始日) - 2020 年 5 月 28 日 (清算终止日)

单位: 人民币元

项目	金额
一、清算期间收入	1,626.93
存款利息收入	1,150.55
投资收益	-1,065.41
其他收入	1,541.79
二、清算期间费用	-1,782.13
汇划费	545.00
信息披露费	10,587.71
审计费	8,852.08
指数使用费	-24,472.44
上市费	2,705.52
三、清算期间净损益	3,409.06

清算结束后所有者权益情况说明

项目	金额
一、最后运作日 (2020 年 5 月 15 日) 基金净资产	9,723,728.56
加: 清算报告期间净收益	3,409.06
减: 赎回金额 (含费用)	109,566.53
二、清算结束日 (2020 年 5 月 28 日) 基金净资产	9,617,571.09

资产处置及负债清偿后, 截止本基金清算报告期结束日 2020 年 5 月 28 日, 本基金剩余财产为 9,617,571.09 元。自本次清算期结束日次日 2020 年 5 月 29 日至清算款项支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有, 为保护基金份额持有人利益, 加快清盘速度, 基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项 (该金额可能与实际结息金额存在

略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

五、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分配。

§ 6 备查文件

备查文件目录

1、财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）2020年1月1日至2020年5月15日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

2、《财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）清算报告》的法律意见。

存放地点

上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：95336

公司网址：www.ctzg.com

财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）

基金财产清算小组

二〇二〇年七月一日