

# 华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金

## 清算报告

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告出具日：2020年12月9日

报告送出日：2020年12月18日

## 一、重要提示

华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1159号）批准募集，基金合同于2017年12月1日成立并正式运作。基金管理人为华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《华泰紫金中证红利低波动指数型发起式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”中“四、基金的自动终止：《基金合同》生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于2亿元人民币的，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续。法律法规另有规定时，从其规定。”

本基金的最后运作日为2020年12月1日，自2020年12月2日起进入清算期，由本基金管理人华泰证券（上海）资产管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（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。

## 二、基金概况

基金简称	华泰紫金红利低波指数发起
基金主代码	005279
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月1日
清算起始日	2020年12月2日
最后运作日基金份额总额	18,904,989.60
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证红利低波动指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

## 三、基金运作情况

华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1159号）批准，由华泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2017年12月1日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为613,789,315.59份基金份额。

根据《华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金合同》“第五部分基金备案”中“四、基金的自动终止：《基金合同》生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于2亿元人民币的，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续。法律法规另有规定时，从其规定。”

根据《基金合同》的约定，截止 2020 年 12 月 1 日本基金规模小于 2 亿元，基金管理人于 2020 年 12 月 2 日发布了《华泰紫金中证红利低波动指数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》，自 2020 年 12 月 2 日起进入基金财产清算程序。

#### 四、财务会计报告

最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 1 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2020 年 12 月 1 日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	3,524,019.17
结算备付金	4,161.38
存出保证金	8,130.81
应收证券清算款	22,681,883.97
应收利息	4,033.54
资产总计	26,222,228.87
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	3,500,430.45
应付管理人报酬	26,851.42
应付托管费	3,356.44
应付交易费用	14,116.76
其他负债	91,362.54
负债合计	3,636,117.61
所有者权益：	
实收基金	18,904,989.60
未分配利润	3,681,121.66

所有者权益合计	22,586,111.26
负债和所有者权益总计	26,222,228.87

注：报告截止日 2020 年 12 月 1 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.1947 元，基金份额总额 18,904,989.60 份。

## 五、清算事项说明

自 2020 年 12 月 2 日至 2020 年 12 月 4 日止为清算期间，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：

### 5.1 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剩余财产中支付。根据本基金的基金合同约定，本基金的清算费用由基金财产承担。

### 5.2 资产处置情况

1、本基金最后运作日银行存款余额为人民币 3,524,019.17 元；清算期间净流入人民币 17,250,880.89 元，清算结束日银行存款余额为人民币 20,774,900.06 元；

2、本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 4,161.38 元，已于 2020 年 12 月 2 日划至托管户人民币 3,644.24 元，清算结束日结算备付金余额为人民币 517.14 元，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垫付该笔款项；

3、本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 8,130.81 元，该款项已于 2020 年 12 月 2 日全额划至托管户；

4、本基金最后运作日应收证券清算款余额为人民币 22,681,883.97 元，该款项已于 2020 年 12 月 2 日全额划至托管户；

5、本基金最后运作日应收利息余额为人民币 4,033.54 元，清算期间计提金额为人民币 1,347.31 元，清算结束日应收利息余额为人民币 5,380.85 元，上述利息待季度结息或账户销户时结清。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垫付该笔款项。

### 5.3 负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 3,500,430.45 元，该款项已于清算期间支付；

2、本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 3,356.44 元，该款项已于 2020 年 12 月

3日支付；

3、本基金最后运作日应付交易费余额为人民币 14,116.76 元，该款项已于 2020 年 12 月 3 日支付；

4、本基金最后运作日应付指数使用费为人民币 11,362.54 元，该款项已于 2020 年 12 月 3 日支付；

5、本基金最后运作日应付信息披露费为人民币 50,000.00 元，该款项已于 2020 年 12 月 3 日支付；

6、本基金最后运作日应付审计费为人民币 20,000.00 元，该款项已于 2020 年 12 月 3 日支付；

7、本基金最后运作日应付律师费为人民币 10,000.00 元，该款项已于 2020 年 12 月 3 日支付；

8、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 26,851.42 元，该款项留存在托管户垫付冻结资产，待清算结束后支付。

#### 5.4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	清算报告期间：2020 年 12 月 2 日至 2020 年 12 月 4 日
一、收入	-87,995.22
1、利息收入	1,347.31
其中：存款利息收入	1,347.31
2、投资收益（损失以“-”填列）	-89,380.63
股利收益	-89,380.63
3、其他收入（损失以“-”填列）	38.10
二、费用	144.89
1、其他费用	144.89
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	-88,140.11
四、净利润（净亏损以“-”填列）	-88,140.11

注：股利收益为中国证券登记结算有限责任公司代扣代缴的股票红利税，其他收入为归基金资产的赎回费收入，其他费用为支付的银行汇划费。

5.5 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、最后运作日 2020 年 12 月 1 日基金净资产	22,586,111.26
加：清算报告期间净收益	-88,140.11
减：赎回金额（含费用）	1,744,024.52
二、2020 年 12 月 4 日基金净资产	20,753,946.63

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12月4日，本基金剩余财产为20,753,946.63元。自本次清算期结束日次日(2020年12月5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，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将于清算期后返还给基金管理人。

5.6 基金清算报告的告知安排

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。

**六、备查文件目录**

6.1、备查文件目录

- (1) 《华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金的清算审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于<华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金清算报告>的法律意见》。

6.2、存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3、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。

华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2020 年 12 月 18 日