

**华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金
清算报告**

基金管理人：华宝基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022年3月

华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金
2022 年 2 月 18 日(基金最后运作日)资产负债表

单位：人民币元

	最后运作日 2022 年 2 月 18 日
资 产：	
银行存款	2,287,395.06
结算备付金	95,376.41
存出保证金	1,090.15
应收证券清算款	17,568,297.35
交易性金融资产	164,019.82
资产合计：	20,116,178.79
负 债：	
应付管理人报酬	6,964.39
应付托管费	1,392.87
应付交易费用	121,167.28
应交税费	32.59
其他负债	1,012,686.23
负债合计	1,142,243.36
所有者权益：	
实收基金	21,767,199.00
未分配利润	-2,793,263.57
所有者权益合计	18,973,935.43
负债与所有者权益合计：	20,116,178.79

一、 华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金简介

1、 基本情况

华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人华宝基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《华宝中证沪港深500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”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可【2021】210号文批准公开募集。本基金为股票型证券投资基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为222,767,199.00份，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为安永华明（2021）验字第61471289_B07号的验资报告。基金合同于2021年3月5日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板、存托凭证、港股通标的股票及其他经中国证监会允许上市的其他股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、货币市场工具、股指期货、资产支持证券以及法律法规或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的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围或变更投资比例规定。本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证沪港深500指数收益率。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝中证沪港深500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》，自2022年2月19日起，本基金进入清算程序。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费和基金托管费。

2、 清算原因

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条规定：“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”。根据《基金合同》“第十部分 基金份额持有人大会”的约定：“1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外：（1）终止《基金合同》；（12）终止基金上市”。此外，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

经本基金份额持有人大会2022年2月17日表决通过，决定终止基金合同并终止上市有关事项，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于2022年2月18日发布了《华宝基金管理有限公司关于华宝中证沪港深500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》。

3、 清算起始日

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝中证沪港深500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》，自2022年2月19日起本基金进入清算程序。由于本基金持有的流通受限股票无法确定变现时间，本基金计划进行多次清算，其中第一次清算期间为2022年2月19日至2022年2月25日，第二次及后续清算期间将根据流通受限股票的变现时间确定。

二、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《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

三、清算情况

自2022年2月19日至2022年2月25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的账面价值为人民币95,376.41元，其中人民币77,020.88已于2022年2月21日划入托管账户，此外于本次清算期间计提利息收入人民币416.20元。截至2022年2月25日，结算备付金的账面价值为人民币18,771.73元，该款项将于之后多次清算时再向基金份额持有人分配。
- (2) 本基金最后运作日存出保证金的账面价值为人民币1,090.15元，截至2022年2月25日，存出保证金的账面价值为人民币1,084.54元，该款项将于之后多次清算时再向基金份额持有人分配。
- (3) 本基金最后运作日应收证券清算款余额为人民币17,568,297.35元，已分别于2022年2月21日及2022年2月22日划入托管账户。
- (4) 本基金最后运作日交易性金融资产的公允价值为人民币164,019.82元，该金额为各只股票的最后运作日估值金额之和。其中，非停牌股票资产为人民币45,450.30元（单只非停牌股票最后运作日估值金额=该只股票的最后运作日收盘价×股票数量），停牌股票资产为人民币118,569.52元（单只停牌股票最后运作日估值金额=该只停牌股票的停牌价格×股票数量）。

具体情况如下：

1) 非停牌股票处置情况：

本基金于最后运作日所持有的非停牌股票京东集团公允价值为45,450.30元，系股票红利分配所得；截至本次清算期结束日（2022年2月25日），由于该只股票尚未办理股票交收手续，因此暂时无法变现。待该股票正式交收后，基金管理人将及时变现该股票，并于之后多次清算时再向基金份额持有人分配。

2) 停牌股票处置情况：

本基金最后运作日（2022年2月18日）持有的全部停牌股票明细如下：

单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	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
01114	BRILLIANCE CHI	2021/3/31	重大事项	5.93	20,000	117,795.47	118,569.52

待停牌股票复牌后，基金管理人将及时变现停牌股票，并于之后多次清算时再向基金份额持有人分配。截止本次清算期结束日（2022年2月25日），本基金持有的停牌股票尚未复牌。

2、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6,964.39元，该款项已于2022年2月25日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,392.87元，该款项已于2022年2月25日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币121,167.28元，该款项已于2022年2月25日支付。
- (4) 本基金最后运作日应交税费为人民币32.59元，该款项已于2022年2月25日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债余额为人民币 1,012,686.23 元，其中包括：应付退补款人民币 799,404.04 元、应付中证报信息披露费人民币 110,000.00 元、应付律师费人民币 40,000.00 元、应付审计费人民币 35,200.00 元、应付 IOPV 委托计算费人民币 18,082.19 元、以及应付公证费人民币 10,000.00 元。上述款项中，应付退补款人民币 799,404.04 元已于 2022 年 2 月 21 日及 2022 年 2 月 22 日支付；应付中证报信息披露费人民币 110,000.00 元、应付律师费人民币 40,000.00 元、应付 IOPV 委托计算费人民币 18,082.19 元、以及应付公证费人民币 10,000.00 元已于 2022 年 2 月 22 日支付；应付审计费人民币 35,200.00 元已于 2022 年 2 月 25 日支付。

3、清算期间的清算损益情况

项目	自2022年2月19日 至2022年2月25日 止清算期间
一、收益	
1、利息收入（注1）	1,225.18
2、公允价值变动损益（注2）	-1,941.49
3、投资收益（注3）	-1,571.07
收益小计	-2,287.38
二、费用	
1、银行划款手续费	180.00
2、交易费用	7.73
费用小计	187.73
三、清算期间净收益	-2,475.11

注1：利息收入系计提的自2022年2月19日至2022年2月25日止清算期间的银行存款利息收入人民币787.75元、结算备付金利息收入人民币416.20元、以及存出保证金利息收入人民币21.23元。

注2：公允价值变动损益系本基金所持有的股票于本次清算期末估值金额与其最后运作日估值金额的差额人民币-1,941.49元。

注3：投资收益系股票红利补税人民币-1,571.07元。

四、 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 2 月 18 日基金净资产	18,973,935.43
加：清算期间净收益	-2,475.11
二、2022 年 2 月 25 日基金净资产	18,971,460.32

根据本基金的《基金合同》及《华宝基金管理有限公司关于华宝中证沪港深500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》的约定，依据基金财产清算的分配方案，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。

截至2022年2月25日，本基金剩余财产为人民币18,971,460.32元，其中包括交易性金融资产人民币162,078.33元。上述剩余未变现的资产将根据变现情况在之后多次清算期间按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估本次清算结束日至清算款划出日前一日银行存款、存出保证金及结算备付金产生的利息，该期间利息亦属全体基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担，最终将于清算结束日基金净资产合计数按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

五、 基金剩余资产的分配

单位：人民币元

项目	分配顺序
一、2022 年 2 月 25 日基金净资产	18,971,460.32
减：备付金和保证金含息及其调整（预估）	709,456.02
减：未变现交易性金融资产	162,078.33
减：手续费（预估）	500.00
二、第一次可供分配剩余财产总额	18,099,425.97

基金份额持有人第一次获取的金额=（第一次可供分配剩余财产总额/合同截止日总份额）*每个基金份额持有人持有份额

实际剩余财产分配请见《华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金剩余资产分配公告》。

六、 备查文件

1、 备查文件目录

- (1) 《华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金清算报告》的法律意见。

2、 存放地点 以上文件存于基金管理人办公场所备投资者查阅。

3、 查阅方式 投资者可在营业时间至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件。

华宝中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金财产清算小组
2022年3月