

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券 投资基金清算报告

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：二零二二年五月十九日

清算报告公告日：二零二二年五月三十日

§ 1 重要提示及目录

§ 1.1 重要提示

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]1959 号文）准予注册募集，自 2020 年 6 月 1 日成立并正式运作。本基金的基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为更好地保护基金份额持有人的利益，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》和《工银瑞信中证 800 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》”或“基金合同”）的有关规定，基金管理人经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。

本基金于 2022 年 2 月 28 日至 3 月 30 日以通讯方式召开工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会，大会审议并通过了《关于工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，决定终止《基金合同》。本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。本基金最后运作日为 2022 年 3 月 31 日，自 2022 年 4 月 1 日起进入清算期。

本基金自 2022 年 4 月 1 日起进入清算期，由基金管理人工银瑞信基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）、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，由上海市通力律师事务所对本基金清算事宜出具法律意见书。

§ 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
§1.1 重要提示.....	2
§1.2 目录.....	3
§2 基金产品概况	4
§3 基金运作情况	5
§4 财务会计报告（经审计）	6
§5 清盘事项说明	7
§5.1 清算费用.....	7
§5.2 资产处置情况.....	7
§5.3 负债清偿情况.....	7
§5.4 清算期间的剩余资产分配情况.....	8
§5.5 基金财产清算报告的告知安排.....	9
§6 备查文件目录	9
§6.1 备查文件目录.....	9
§6.2 存放地点.....	9
§6.3 查阅方式.....	9

§ 2 基金产品概况

基金名称	工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金扩位简称	工银中证 800ETF
基金主代码	515830
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 1 日
最后运作日（2022 年 3 月 31 日）基金份额总额	1,153,108.00 份
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，力争实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的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%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，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	工银瑞信基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会《关于准予工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]1959 号文）准予注册募集。由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2020 年 3 月 27 日至 2020 年 5 月 22 日期间向社会公开募集，基金合同于 2020 年 6 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 391,080,183.00 份（含募集期间利息结转的份额）。

根据市场环境变化，为更好地保护基金份额持有人的利益，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》和《基金合同》的有关规定，基金管理人经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。

本基金于 2022 年 2 月 28 日至 3 月 30 日以通讯方式召开工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会，大会审议并通过了《关于工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，决定终止《基金合同》。本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。本基金最后运作日为 2022 年 3 月 31 日，自 2022 年 4 月 1 日起进入清算期。

§ 4 财务会计报告（经审计）

基金最后运作日资产负债表

会计主体：工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 3 月 31 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2022 年 3 月 31 日（基金最后运作日）
资 产：	
银行存款	1,386,744.71
结算备付金	35,828.55
存出保证金	1,575.53
交易性金融资产	5,237,771.77
其中：股票投资	5,230,157.38
债券投资	7,614.39
应收利息	
资产总计	6,661,920.56
负债和所有者权益	本期末 2022 年 3 月 31 日（基金最后运作日）
负 债：	
应付证券清算款	654,968.35
应付管理人报酬	5,642.58
应付托管费	877.73
应付交易费用	3,432.75
其他负债	546,228.59
负债合计	1,211,150.00
所有者权益：	
实收基金	5,770,182.41
未分配利润	-319,411.85
所有者权益合计	5,450,770.56
负债和所有者权益总计	6,661,920.56

注：1、报告截止日 2022 年 3 月 31 日（基金最后运作日），基金份额净值为人民币 4.7270 元，基金份额总额 1,153,108.00 份。

2、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。

§ 5 清盘事项说明

自 2022 年 4 月 1 日至 2022 年 5 月 19 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

按照《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”的规定，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财产中支付。

§ 5.2 资产处置情况

本基金最后运作日持有的股票投资估值金额为人民币 5,230,157.38 元，已于清算期间全部卖出。

本基金最后运作日持有的债券投资估值金额为人民币 7,614.39 元，已于清算期间全部卖出。

本基金最后运作日结算备付金为人民币 35,828.55 元，其中期货备付金人民币 35,812.16 元，应计期货备付金利息人民币 16.39 元。上述款项已于 2022 年 5 月 13 日划入托管账户。

本基金最后运作日存出保证金为人民币 1,575.53 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 666.34 元，应计存出保证金利息人民币 0.33 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 908.42 元，应计存出保证金利息人民币 0.44 元。上述款项中存出保证金合计人民币 1,574.76 元已于 2022 年 5 月 6 日划入托管账户，应计存出保证金利息合计人民币 0.77 元于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清，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先行垫付该款项。

§ 5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 654,968.35 元，已于 2022 年 4 月 1 日划出。

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 5,642.58 元，该款项将于清算期结束之后支付。

本基金最后运作日应付托管费为人民币 877.73 元，该款项将于清算期结束之后支付。

本基金最后运作日应付交易费用为人民币 3,432.75 元，该款项将于清算期结束之后支付。

本基金最后运作日其他负债为人民币 546,228.59 元，为应付审计费、律师费、标的指数许可使用费、公证费、IOPV 服务费及应退退补款。其中应付审计费为人民币 50,000.00 元，应付律师

费为人民币 35,000.00 元，应付标的指数许可使用费为人民币 1,174.75 元，应付 IOPV 服务费为人民币 62,191.78 元，以上款项预计将于收到付款通知书及发票起五日内支付；应付公证费为人民币 10,000.00 元，已于 2022 年 4 月 21 日支付，应退退补款为人民币 387,862.06 元，已于 2022 年 4 月 6 日支付。

§ 5.4 清算期间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 2022 年 3 月 31 日基金净资产	5,450,770.56
加：清算期间（2022-4-1 至 2022-5-19）收入	
利息收入（注 1）	6,831.12
变现损益（注 2）	-18,541.01
减：清算期间（2022-4-1 至 2022-5-19）费用	
交易费用（注 3）	9,380.86
其他费用（注 4）	225.00
二、2022 年 5 月 19 日（清算报告出具日）基金净资产（注 5）	5,429,454.81

注：

1、利息收入系以当前使用的利率计提的自 2022 年 4 月 1 日至 2022 年 5 月 19 日止银行存款、结算备付金、存出保证金的利息。

2、变现损益系清算期间持有交易性债券投资产生的利息收入及处置交易性股票投资和交易性债券投资产生的差价收入。

3、交易费用系清算期间处置交易性金融资产所致，已于清算期间支付。

4、其他费用系清算期间的银行汇划费。

5、资产处置及负债清偿后，于 2022 年 5 月 19 日本基金剩余财产为人民币 5,429,454.81 元，根据本基金的基金合同约定，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。

2022 年 5 月 20 日至资产支付日前一日产生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期间孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

§ 5.5 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，报北京证监局备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件目录

§ 6.1 备查文件目录

- 1、《工银瑞信中证 800 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〈工银瑞信中证 800 交易型开放式指数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、基金托管人、上海证券交易所处。

§ 6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。

工银瑞信中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金财产清算小组

2022 年 5 月 19 日