

华润元大ESG主题混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

清算报告出具日：二〇二二年十二月三十日

清算报告公告日：二〇二三年一月十日

目录

重要提示.....	3
一、基金概况.....	3
二、基金运作情况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清算情况.....	6
五、备查文件.....	9

重要提示

华润元大ESG主题混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2021年10月28日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2021】3394号文准予募集注册，由华润元大基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）作为基金管理人向社会公开发行人募集，基金合同于2022年6月23日正式生效。本基金基金管理人为华润元大基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

依据《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》的规定和《华润元大ESG主题混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，基金管理人经与本基金基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，由基金管理人召集，以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议终止《基金合同》的事项。本基金份额持有人大会已于2022年12月19日表决通过了《关于终止华润元大ESG主题混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，决定终止本基金基金合同。根据本基金基金份额持有人大会通过的议案及议案说明，本基金最后运作日为2022年12月20日，于2022年12月21日起进入清算期。

本基金第一次清算期自2022年12月21日至2022年12月29日止。本基金的基金管理人、基金托管人、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成立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）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

一、基金概况

基金名称	华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金
基金简称	华润元大 ESG 主题混合
基金主代码	014123
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 23 日
基金管理人名称	华润元大基金管理有限公司

基金托管人名称	招商证券股份有限公司
公告依据	《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》等相关法律法规以及《华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金基金合同》、《华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金招募说明书》
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司
基金合同存续期	不定期
投资目标	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，坚持 ESG 与价值投资理念相结合，精选主题特征突出且持续成长的企业，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境、财政及货币政策趋势以及基金管理人对于大类资产走势的判断，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。本基金所指的“ESG 主题”涉及行业包括能源、原材料、工业、可选消费、必需消费、医药卫生、金融地产、信息技术、电信业务、公用事业。本基金 ESG 投资的主要策略包括 ESG 筛选策略、ESG 整合策略、ESG 主题投资策略。本基金的投资策略还包括港股通标的股票投资策略、存托凭证的投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证中财沪深 100ESG 领先指数收益率×70%+中债综合指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期的收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

二、基金运作情况

华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2021 年 10 月 28 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2021】3394 号文准予募集注册，自 2022 年 3 月 28 日至 2022 年 6 月 21 日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为 225 户，募集资金及其产生的利息共计 200,802,417.36 元，折合基金份额 200,802,417.36 份。华润元大基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后，于 2022 年 6 月 23 日获书面确认，《华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金基金合同》自该日起正式生效。

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定及《基

金合同》的相关约定，经本基金份额持有人大会2022年12月19日表决通过，决定终止基金合同，并根据法律法规规定和基金合同约定履行基金财产清算程序。本基金管理人于2022年12月20日发布了《关于华润元大ESG主题混合型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》，本基金最后运作日为2022年12月20日，自2022年12月21日起进入基金财产清算程序，停止办理本基金基金份额的申购、赎回、定期定额投资、转换等业务。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 20 日

单位：人民币元

	最后运作日 2022 年 12 月 20 日
资产：	
银行存款	32,969.30
结算备付金	333.36
存出保证金	-
交易性金融资产	7,717.38
其中：股票投资	7,717.38
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	41,020.04
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-

卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	30.37
应付托管费	5.06
应付销售服务费	4.80
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
其他负债	30,000.00
负债合计	30,040.23
净资产：	
实收基金	10,359.92
未分配利润	619.89
净资产合计	10,979.81
负债和净资产总计	41,020.04

四、清算情况

自2022年12月21日起本基金进入基金财产清算程序，因本基金持有流通受限股票，本基金将进行二次清算。自2022年12月21日至2022年12月29日止的第一次清算期间，本基金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。第一次清算期间基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 32,969.30 元，其中本金人民币 32,107.85 元，应计利息人民币 861.45 元。于清算期间收到银行存款利息人民币 861.51 元，收到申购款人民币 19.85 元，计提应计利息人民币 8.56 元，支付管理费人民币 30.37 元，支付托管费人民币 5.06 元，支付销售服务费人民币 4.80 元，支付赎回款及赎回费人民币 116.47 元，支付审计费人民币 15,000.00 元。截止至清算结束日，银行存款为人民币 17,841.07 元，其中本金人民币 17,832.51 元，应计利息人民币 8.56 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 333.36 元，其中本金人民币 333.36 元，应计利息人民币 0.00 元。截止至清算结束日，结算备付金为人民币 333.36 元，其中本金人民币 333.36 元，应计利息人民币 0.00 元。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 7,717.38 元，均为股票投资，其明细如下：单位：人民币元

股票代码	股票名称	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
301309	万得凯	25.54	42	1,638.00	1,072.68
301326	捷邦科技	36.99	55	2,844.60	2,034.45
301327	华宝新能	184.41	25	5,937.50	4,610.25
合计					7,717.38

截止至清算结束日，本基金持有的流通受限股票明细如下：

单位：人民币元

股票代码	股票名称	清算结束日 估值单价	数量 (单位:股)	清算结束日 成本总额	清算结束日 估值总额
301309	万得凯	24.44	42	1,638.00	1,026.48
301326	捷邦科技	37.09	55	2,844.60	2,039.95
301327	华宝新能	176.73	25	5,937.50	4,418.25
合计					7,484.68

注：上述股票清算结束日估值单价为 2022 年 12 月 29 日之估值价，与后续实际变现金额可能存在差异。根据《基金合同》第十四部分“基金资产估值”的约定，“在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。”由于上述股票流通受限，因此基金管理人参考《证券投资基金投资流通受限股票估值指引》，在同一股票交易所估值价格基础上应用流动性折扣调整其估值。

上述股票为本基金于 2022 年 9 月因认购新发证券持有的流通受限证券，锁定期为 6 个月。第一次清算期间仍处于锁定期，待该股票限售期满时，基金管理人将及时变现流通受限股票，并于第二次清算结束后再向基金份额持有人分配。

(4) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 0.00 元。于清算期间确认应收申购款人民币 19.85 元，其中应收华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金 A 类份额申购款人民币 9.85 元，应收华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金 C 类份额申购款人民币 10.00 元，该款项已于 2022 年 12 月 22 日划入本基金托管账户。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 0.00 元。于清算期间确认应付赎

回款人民币 116.34 元，其中应付华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金 A 类份额赎回款人民币 106.37 元，应付华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金 C 类份额赎回款人民币 9.97 元，该款项已于 2022 年 12 月 23 日从本基金托管账户划出。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 30.37 元。该款项已于 2022 年 12 月 21 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 5.06 元。该款项已于 2022 年 12 月 21 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 4.80 元。该款项已于 2022 年 12 月 21 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 30,000.00 元，系预提审计费。于清算期间支付审计费人民币 15,000.00 元。同时，确认应付赎回费人民币 0.13 元，该款项已于 2022 年 12 月 23 日支付。截止至清算结束日，其他负债为人民币 15,000.00 元，将于第二次清算时支付。

3、第一次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2022年12月21日至 2022年12月29日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	8.62
2、公允价值变动损益（注2）	-232.70
3、其他收入（注3）	0.40
清算收益小计	-223.68
二、清算支出	-
清算支出小计	-
三、清算净收益（损失以“-”填列）	-223.68

注 1：利息收入系计提的自 2022 年 12 月 21 日起至 2022 年 12 月 29 日止清算期间的银行存款利息收入。

注 2：公允价值变动损益系第一次清算期间股票投资公允价值变动产生的公允价值变动损益。

注 3：其他收入系最后运作日基金份额持有人发生赎回业务产生的赎回费收入。

4、第一次清算期间的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2022年12月20日基金净资产	10,979.81
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-223.68
清算期间转入持有人权益（注1）	19.85
清算期间从持有人权益转出（注2）	-116.87
二、清算结束日2022年12月29日基金净资产	10,659.11

注 1：本基金份额持有人于最后运作日 2022 年 12 月 20 日提交的申购申请，已于 2022 年 12 月 22 日收到基金申购款。

注 2：本基金份额持有人于最后运作日 2022 年 12 月 20 日提交的赎回申请，已于 2022 年 12 月 23 日支付基金赎回款。

根据本基金的《基金合同》及《关于终止华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》，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。

本基金于 2022 年 12 月 29 日剩余财产为人民币 10,659.11 元，其中可分配财产为人民币 2,832.51 元，剩余未变现的资产为 7,826.60 元，包括交易性金融资产人民币 7,484.68 元（该金额为流通受限证券清算结束日估值金额，与实际变现金额可能存在差异），结算备付金人民币 333.36 元，应收银行存款利息人民币 8.56 元。上述剩余未变现的资产将根据变现情况在第二次清算结束后按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

本基金自清算起始日至基金财产清算款划出日前一日银行存款所产生的利息及结算备付金均属基金份额持有人所有。如前述利息和结算备付金在第一次基金财产分配划出日前尚未结清，将于第二次清算结束后分配。

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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于〈华润元大 ESG 主题混合型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

华润元大ESG主题混合型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二二年十二月三十日