

# 海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资 基金清算报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二三年三月十三日

清算报告公告日期：二〇二三年三月二十三日

## §1 重要提示

海富通中证长三角领先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”）证监许可[2019]2906号文准予注册募集，于2020年08月13日成立并正式运作。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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》等法律法规的规定和《海富通中证长三角领先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”）的有关约定，基金管理人于2023年01月09日至2023年01月31日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于终止海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金基金合同并终止基金份额上市有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于2023年02月01日计票表决通过了《关于终止海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金基金合同并终止基金份额上市有关事项的议案》，基金份额持有人大会决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日定为2023年02月01日，并于2023年02月02日进入清算程序。

基金管理人、基金托管人、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组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（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报告出具法律意见。

## §2 基金产品概况

基金名称	海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	海富通中证长三角领先ETF
基金主代码	515500

基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年8月13日
基金最后运作日(2023年02月01日)基金份额总额	23,404,795.00 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。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过0.2%，年跟踪误差争取不超过2%。
主要投资策略	本基金主要采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来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。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证长三角领先指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证长三角领先指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### §3 基金运作情况概述

海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]2906号文准予注册募集，于2020年08月13日成立并正式运作，本基金共募集434,404,795.00份基金份额。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。基金管理人就上述情形拟定了终止基金合同的解决方案，经基金管理人与基金托管人协商一致后，向中国证监会提出申请，于 2023 年 1 月 9 日至 2023 年 1 月 31 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于 2023 年 02 月 01 日计票表决通过了《关于终止海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金基金合同并终止基金份额上市有关事项的议案》。

根据《基金合同》及相关公告规定，本基金的最后运作日确定为 2023 年 02 月 01 日，清算期间为 2023 年 02 月 02 日至 2023 年 03 月 13 日。

## §4 财务报告

### 4.1 资产负债表

会计主体：海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 02 月 01 日

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日 2023年02月01日
<b>资 产：</b>	
银行存款	814,006.29
结算备付金	55,518.82
存出保证金	3,646.43
交易性金融资产	22,045,408.60
其中：股票投资	22,045,408.60
基金投资	
债券投资	
资产支持证券投资	
贵金属投资	

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	
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	22,918,580.14
<b>负债和净资产</b>	<b>基金最后运作日 2023年02月01日</b>
<b>负 债：</b>	
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	3,398.98
应付托管费	1,132.98
应付销售服务费	
应付投资顾问费	
应交税费	
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	243,669.28
负债合计	248,201.24
<b>净资产：</b>	
实收基金	23,404,795.00
未分配利润	-734,416.10
净资产合计	22,670,378.90
负债和净资产总计	22,918,580.14

注：本基金最后运作日2023年02月01日，基金份额净值0.9686元，基金份额

总额23,404,795.00份。

#### 4.2 利润表

会计主体：海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金

报告期间：2023年01月01日至2023年02月01日(基金最后运作日)

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年02月01日(基金最后运作日)
<b>一、营业总收入</b>	1,516,683.53
利息收入	409.88
其中：存款利息收入	409.88
债券利息收入	
资产支持证券利息收入	
买入返售金融资产收入	
其他利息收入	
证券出借利息收入	
投资收益(损失以“-”填列)	233,825.33
其中：股票投资收益	256,107.78
基金投资收益	
债券投资收益	
资产支持证券投资收益	
贵金属投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	-22,282.45
其他投资收益	
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,284,431.71
汇兑收益(损失以“-”号填列)	
其他收入(损失以“-”号填列)	-1,983.39
<b>减：二、营业总支出</b>	19,675.45
管理人报酬	3,398.98
托管费	1,132.98
销售服务费	
利息支出	
其中：卖出回购金融资产支出	
税金及附加	
其他费用	15,143.49

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,497,008.08
减：所得税费用	
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,497,008.08
五、其他综合收益的税后净额	
六、综合收益总额	1,497,008.08

注：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师朱宏宇、胡莲莲签字出具了普华永道中天特审字(2023)第 0565 号标准无保留意见的审计报告。

## §5 基金财产分配

本基金自 2023 年 02 月 02 日起进入清算程序，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。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

### 5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金金额 55,518.82 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所最低结算备付金为 29,966.89 元，应计利息为 32.70 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司的深交所最低结算备付金为 14,079.80 元，应计利息为 17.06 元；存放于东证期货备付金为 11,398.43 元，应计利息为 23.94 元。上述款项中上交所、深交所最低结算备付金已分别于 2023 年 02 月 08 日和 2023 年 03 月 08 日划回托管账户，剩余应计结算备付金利息 115.42 元将于 2023 年 3 月 21 日之后划入托管账户。东证期货备付金账户于 2023 年 03 月 02 日销户结息，账户内剩余资金 11,438.88 元于当日划回托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 3,646.43 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所结算保证金为 1,899.76 元，应计利息为 3.64 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司的深交所结算保证金为 1,739.39 元，应计利息为 3.64 元。根据中国证券登记结算有限责任公司结算规则，结算保证金在每月第二个工作日进行调整，截至本次清算期末，结算保证金及应计利息余额 16,507.79 元，将于清算期后陆续划回托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产市值为 22,045,408.60 元。截至 2023 年 02 月 03 日，最后运作日持有的交易性金融资产已全部变现，扣除交易费用后的变现金额为 22,031,297.87 元，已划入托管账户。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日的应付管理人报酬 3,398.98 元，分别于 2023 年 02 月 02 日、2023 年 03 月 02 日支付完毕。

5.2.2 本基金最后运作日的应付托管费 1,132.98 元，分别于 2023 年 02 月 02 日、2023 年 03 月 02 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日其他负债为 243,669.28 元，其中包括：

5.2.3.1 应付交易佣金 3,808.94 元，于 2023 年 03 月 14 日支付完毕。

5.2.3.2 应付上证报信息披露费用 127,500.00 元，已分别于 2023 年 02 月 21 日、2023 年 03 月 09 日支付完毕。

5.2.3.3 应付指数使用费 2,976.66 元，其中 2022 年四季度计提的指数使用费 2,296.85 元已于 2023 年 02 月 14 日支付完毕，剩余 679.81 元于 2023 年 03 月 16 日支付完毕。

5.2.3.4 应付审计费用 55,000.00 元，将于收到会计师事务所审计费发票后支付；应付 IOPV 计算发布费 54,383.68 元，于 2023 年 03 月 16 日支付完毕。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2023年02月02日至2023年03月13日（本次清算期截止日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	8,537.73
2、股票变现损益（注2）	-32,150.19
清算收益小计	-23,612.46
二、清算费用	
1、银行汇划手续费	50.00



清算费用小计	50.00
三、清算净收益	-23,662.46

注：

(1) 利息收入金额 8,537.73 元，为以当前适用的利率计提的自 2023 年 02 月 02 日至 2023 年 03 月 13 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、结算保证金利息。

(2) 股票变现损益为本次清算期间股票资产卖出金额扣除交易费用后与最后运作日股票资产市值的差额。

#### 5.4 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2023年02月01日基金净资产	22,670,378.90
加：清算期间净收益	-23,662.46
二、2023年03月13日基金剩余资产净值	22,646,716.44

注：截至本次清算期结束日 2023 年 03 月 13 日，本基金剩余财产 22,646,716.44 元。将根据本基金《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2023 年 03 月 13 日至清算款划出日前一日的银行存款、结算保证金产生的利息亦属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，基金管理人将先行垫付尚未收回的结算保证金、应计银行存款利息、应计结算保证金利息供清盘分配使用，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有；同时，为维护份额持有人的利益，2023 年 03 月 13 日至清算款划出日前一日基金因清盘产生的相关费用亦由基金管理人承担。

#### 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，报中国证监会备案并公告。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

### 6.1 备查文件目录

- 1、海富通中证长三角领先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<海富通中证长三角领先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。

海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金  
基金财产清算小组

二〇二三年三月十三日