

华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金 发起式联接基金清算报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

清算报告出具日:二〇二三年五月十九日

清算报告公告日:二〇二三年五月二十六日

重要提示

华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(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”)2019年10月9日证监许可[2019]1882号文准予注册,本基金基金合同自2020年4月29日起生效,本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

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》《华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》等有关规定,基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,则基金合同自动终止,同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。如年度对应日为非工作日,则顺延至下一工作日。2023年5月4日日终本基金基金资产净值低于2亿元,触发上述基金合同终止情形,本基金基金合同自动终止。本基金最后运作日为2023年5月4日,自2023年5月5日起本基金进入基金财产清算程序。

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)、北京市天元律师事务所成立基金财产清算组履行基金财产清算程序,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,由北京市天元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	华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	华夏粤港澳大湾区创新100ETF联接	
基金主代码	008199	
各份额类别简称及基金交易代码	华夏粤港澳大湾区创新100ETF联接A 008199	华夏粤港澳大湾区创新100ETF联接C 008200
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年4月29日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	

二、基金运作情况

本基金基金合同自2020年4月29日起正式生效,基金合同生效日的基金份额总数为26,786,943.52份(含募集期间利息结转的份额),有效认购户数为2,300户。

本基金为发起式基金,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》等法律法规及本基金基金合同等有关规定,基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产规模低于2亿元,则基金合同自动终止,同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。如年度对应日为非工作日,则顺延至下一工作日。2023年5月4日日终本基金基金资产净值低于2亿元,触发上述基金合同终止情形,本基金基金合同自动终止。本基金最后运作日为2023年5月4日,自2023年5月5日起本基金进入基金财产清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间,本基金按基金合同约定正常运作。

三、财务会计报告

(一)基金最后运作日资产负债表(已经审计)

会计主体:华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
报告截止日:2023年5月4日

单位:人民币元

	最后运作日 2023年5月4日
资产:	
银行存款	6,075,678.51
结算备付金	0.84
存出保证金	498.66
交易性金融资产	22,758,643.96
其中:股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	22,758,643.96
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	999,959.02
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	29,834,780.99
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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	5,505,739.76
应付管理人报酬	469.37

应付托管费	156.48
应付销售服务费	1,303.50
应付交易费用	-
应付税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	70,120.68
负债合计	5,577,789.79
所有者权益：	
实收基金	23,545,509.75
未分配利润	711,481.45
所有者权益合计	24,256,991.20
负债和所有者权益总计	29,834,780.99

注：①报告截止日2023年5月4日(本基金最后运作日)，华夏粤港澳大湾区创新100ETF联接A基金份额净值为1.0317元，华夏粤港澳大湾区创新100ETF联接C基金份额净值为1.0224元；华夏粤港澳大湾区创新100ETF联接基金份额总额为23,545,509.75份(其中A类19,760,009.10份，C类3,785,500.65份)。

②本基金截至最后运作日的财务报表以清算基础编制。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

四、清算情况

自2023年5月5日起至2023年5月19日止为本基金清算报告期，基金财产清算组按照法律法规及本基金基金合同的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

(一)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财产中支付。

(二)最后运作日资产清算情况

截至清算报告期末日(2023年5月19日)，本基金最后运作日部分资产尚未收回。为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，本基金管理人以自有资金对尚未收回的银行存款应计利息、结算备付金应计利息、存出保证金及存出保证金应计利息进行垫付，该垫付资金将于收回款项后退还给基金管理人。各项资产清算情况如下：

1. 本基金最后运作日银行存款及银行存款应计利息为人民币6,075,678.51元，其中银行存款应计利息820.68元，已由基金管理人于2023年5月5日以自有资金垫付至托管账户。
2. 本基金最后运作日结算备付金应计利息为人民币0.84元，已由基金管理人于2023年5月5日以自有资金垫付至托管账户。
3. 本基金最后运作日存出保证金及存出保证金应计利息为人民币498.66元，已由基金管理人于2023年5月5日以自有资金垫付至托管账户。
4. 本基金最后运作日持有的基金投资为人民币22,758,643.96元，已全部处置变现，变现款项为人民币22,726,000.40元，已于2023年5月8日划至托管账户。
5. 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币999,959.02元，已于2023年5月5日划至托管账户。

(三)最后运作日负债清偿情况

1. 本基金最后运作日应付赎回款为人民币5,505,739.76元，该款项已于2023年5月5日、2023年5月8日支付。
2. 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币469.37元，该款项已于2023年5月5日支付。
3. 本基金最后运作日应付托管费为人民币156.48元，该款项已于2023年5月5日支付。
4. 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币1,303.50元，该款项已于2023年5月5日支付。
5. 本基金最后运作日其他负债为人民币70,120.68元，其中：应付赎回费人民币125.68元，已于2023年5月5日、2023年5月8日全部支付；预提审计费人民币53,000.00元，已于2023年5月9日、2023年5月17日支付；预提信息披露费人民币16,900.00元，已于2023年5月17日支付；预提银行汇划费人民币95.00元，已于2023年5月10日支付80.00元，剩余部分将于2023年5月19日后支付。

(四)本次清算报告期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2023年5月5日至2023年5月19日止清算报告期间
一、清算收益	
1. 利息收入(注1)	2,853.53
2. 投资收益(注2)	-2,941,066.37
3. 公允价值变动损益(注3)	2,909,332.08
4. 其他收入(注4)	1.38
清算收入小计	-28,879.38
二、清算费用	
1. 交易费用(注5)	909.27
2. 其他费用(注6)	185.12
清算费用小计(注7)	1,094.39
三、清算净收益	-29,973.77

表中相关项目具体说明如下：

注1：利息收入系以前适用的利率计提的自2023年5月5日起至2023年5月19日止清算报告期间的银行存款利息及存出保证金利息。

注2：投资收益系基金最后运作日持有的基金资产产生的收益。

注3：公允价值变动损益系基金最后运作日持有的基金资产产生的公允价值变动损益。

注4：其他收入系最后运作日有效赎回、转换转出申请对应的赎回费归基金资产金额。

注5：交易费用系基金最后运作日持有的基金资产产生的费用。

注6：其他费用系清算期间产生的银行费用。

注7：本基金的清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五)截至本次清算报告期末日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2023年5月4日基金净资产	24,256,991.20
减：最后运作日有效赎回、转换转出申请对应赎回款	495,781.63
加：清算报告期间净收益	-29,973.77
二、2023年5月19日基金净资产	23,731,235.80

截至本基金清算报告期末日2023年5月19日，本基金剩余财产为人民币23,731,235.80元。自清算报告期末日次日(2023年5月20日)至本次清算划出前一日(2023年5月19日)的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。

(六)基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

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。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剩余财产分配。

五、备查文件

(一)备查文件目录

1、《华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2023年1月1日至2023年5月4日(基金最后运作日)期间的财务报表及审计报告》

2、《北京市天元律师事务所关于华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金清算的法律意见》

(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。

华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金财产

清算组

二〇二三年五月二十六日