

永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 清算报告

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告公告日：2023 年 7 月 6 日

目录

| | |
|---------------|---|
| 重要提示..... | 3 |
| 一、基金概况..... | 4 |
| 二、基金运作情况..... | 4 |
| 三、财务会计报告..... | 5 |
| 四、清盘事项说明..... | 5 |
| 五、清算情况..... | 6 |
| 六、备查文件..... | 8 |

重要提示

永赢沪深 300 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”）2019 年 11 月 26 日证监许可[2019]2525 号文准予募集注册，自 2020 年 4 月 13 日起《永赢沪深 300 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》”）生效，并于 2020 年 5 月 8 日在上海证券交易所上市交易，基金管理人为永赢基金管理有限公司，基金托管人为中国工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》《基金合同》等有关规定，基金份额持有人大会决定终止《基金合同》的，《基金合同》应当终止。本基金管理人于 2023 年 5 月 4 日发布《永赢基金管理有限公司关于以通讯方式召开永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议本基金终止《基金合同》并终止上市有关事项，会议议案于 2023 年 6 月 12 日表决通过，本次基金份额持有人大会决议自同日起生效，本基金管理人于 2023 年 6 月 13 日发布《永赢基金管理有限公司关于永赢沪深 300 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》，本基金最后运作日为 2023 年 6 月 12 日，自 2023 年 6 月 13 日起，本基金进入基金财产清算程序。本基金管理人于 2023 年 6 月 12 日发布《永赢基金管理有限公司关于永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的停牌公告》，本基金于 2023 年 6 月 12 日开市起停牌。

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，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，由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 | 永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 永赢沪深 300ETF |
| 场内简称 | 永赢 300 |
| 基金代码 | 515930 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 04 月 13 日 |
| 基金管理人 | 永赢基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2020 年 05 月 08 日 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 |

二、基金运作情况

本基金经中国证监会 2019 年 11 月 26 日证监许可[2019]2525 号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自 2020 年 3 月 23 日至 2020 年 4 月 3 日期间向社会公开募集。本基金《基金合同》于 2020 年 4 月 13 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额总数为 281,908,783.00 份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为 2,960 户。

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》《永赢基金管理有限公司关于以通讯方式召开永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》等规定，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于永赢沪深 300 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》，上述议案于 2023 年 6 月 12 日获得表决通过，基金份额持有人大会决议自同日起生效。根据《永赢基金管理有限公司关于永赢沪深 300 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》，本基金以 2023 年 6 月 12 日为最后运作日，自 2023 年 6 月 13 日起，本基金进入基金财产清算程序。本基金管理人于 2023 年 6 月 12 日发布《永赢基金管理有限公司关于永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的停牌公告》，本基金于 2023 年 6 月 12 日开市起停牌。

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：永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

单位：人民币元

| | 最后运作日 2023 年 6 月 12 日 |
|-------------|--------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 534,941.46 |
| 结算备付金 | 172,235.53 |
| 存出保证金 | 8,806.33 |
| 交易性金融资产 | 19,354,833.42 |
| 资产总计 | 20,070,816.74 |
| 负债： | |
| 应付管理人报酬 | 1,062.04 |
| 应付托管费 | 354.00 |
| 其他负债 | 95,751.86 |
| 负债合计 | 97,167.90 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 15,655,098.09 |
| 未分配利润 | 4,318,550.75 |
| 净资产合计 | 19,973,648.84 |
| 负债和净资产总计 | 20,070,816.74 |

四、清盘事项说明

1、清算原因

根据《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”之“二、基金合同的终止事由”有以下约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；4、基金合同约定的其他情形；5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

根据基金管理人于 2023 年 6 月 13 日发布的《永赢基金管理有限公司关于永赢沪深 300 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》，

永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会已于 2023 年 5 月 9 日起至 2023 年 6 月 9 日 17:00 止（以基金管理人收到表决票的时间为准）对《关于永赢沪深 300 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》进行了投票表决，根据 2023 年 6 月 12 日的计票结果，该议案获得表决通过，大会决议自 2023 年 6 月 12 日起生效。

2、清算起始日

根据《永赢基金管理有限公司关于永赢沪深 300 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》，本基金自 2023 年 6 月 13 日起进入清算程序，故本基金清算起始日为 2023 年 6 月 13 日。

3、清算财务报表编制基础

本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。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，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自 2023 年 6 月 13 日至 2023 年 6 月 21 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) 本基金最后运作日银行存款为人民币 534,941.46 元，其中存放于托管账户金额为人民币 533,449.76 元，应计银行存款利息人民币 1,491.70 元。上述应计银行存款利息已于 2023 年 6 月 21 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 172,235.53 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结算备付金人民币 145,111.42 元，应计结算备付金利息人民币 47.49 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结算备付金人民币 22,442.74 元，应计结算备付金利息人民币 158.21 元；其中应计期货备付金利息人民币 4,475.67 元。上述款项中应计结算备付金利息合计人民币 205.70 元已于 2023 年 6 月 21 日划入托管账户，其余款项将于 2023 年 6 月 21 日之后划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 8,806.33 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 576.90 元，应计存出保证金利息人民币 1.06 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 8,203.28 元，应计存出保证金利息人民币 25.09 元。上述应计存出保证金利息合计人民币 26.15 元已于 2023 年 6 月 21 日划入托管账户，其余款项将于 2023 年 6 月

21 日之后划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 19,354,833.42 元,已于清算期间全部处置变现。

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 1,062.04 元,该款项已于 2023 年 6 月 14 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 354.00 元,该款项已于 2023 年 6 月 14 日支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币 95,751.86 元。其中应付 2022 年度财务报表审计费人民币 30,000.00 元,该款项已于 2023 年 6 月 13 日支付;应付交易费用为人民币 35,224.49 元,该款项已于 2023 年 6 月 14 日支付;应付清算财务报表审计费人民币 15,000.00 元,应付律师费人民币 10,000.00 元,应付汇划手续费人民币 224.00 元,应付指数使用费人民币 5,303.37 元,上述款项将于 2023 年 6 月 21 日之后支付。

3、 本次清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

| 项目 | 自2023年6月13日至2023年6月21日止清算期间 |
|---------------------------|-----------------------------|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入(注1) | 1,617.73 |
| 2、投资收益(损失以“-”号填列)(注2) | -1,334,794.70 |
| 3、公允价值变动收益(损失以“-”号填列)(注3) | 1,329,755.58 |
| 清算收益小计(损失以“-”号填列) | -3,421.39 |
| 二、清算费用 | |
| 1、其他费用(注4) | -63.00 |
| 清算费用小计(注5) | -63.00 |
| 三、清算净收益(净损失以“-”号填列) | -3,484.39 |

注 1: 利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2023 年 6 月 13 日至 2023 年 6 月 21 日止清算期间的银行存款利息人民币 1,546.34 元,结算备付金利息为人民币 67.67 元,存出保证金利息为人民币 3.72 元。上述利息中银行存款利息人民币 1,353.65 元,结算备付金利息人民币 60.13 元,存出保证金利息人民币 3.32 元已于 2023 年 6 月 21 日划入托管账户,其余利息将于 2023 年 6 月 21 日之后划入托管账户。经基金管理人确认,如截至划付清算款前一日仍有未变现的资产(银行存款利息、结算备付金及其利息、存出保证金及其利息),将由基金管理人以自有资金先行垫付,垫付资金将于划付清算款前划入本基金托管账户。2023 年 6 月 22 日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息属份额持有人所有。基金管理人垫付的资金将于清算期后的结息日或结算备付金与存出保证金调整日后退还给基金管理人,实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

注 2：投资收益系本次清算期间卖出股票事项所致，其中，卖出股票差价收入（卖出股票成交金额减去所卖出股票的初始投资成本）为人民币-1,298,562.53 元，因卖出股票而支付的红利补税款人民币 9,385.46 元以及卖出股票产生的交易费用人民币 35,014.31 元作为投资收益的扣减项；股利收入为人民币 8,167.60 元。

注 3：公允价值变动收益系清算期间处置交易性金融资产事项所致，为原计入交易性金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

注 4：其他费用系清算期间的银行汇划费人民币 63.00 元，已于清算期间支付。

注 5：根据基金合同，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

4、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2023年6月12日基金净资产 | 19,973,648.84 |
| 加：清算期间净收益（净损失以“-”号填列） | -3,484.39 |
| 二、2023年6月21日基金净资产 | 19,970,164.45 |

根据本基金的《基金合同》及《永赢基金管理有限公司关于永赢沪深 300 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》，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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2023 年 6 月 21 日止的剩余财产为人民币 19,970,164.45 元。

截至 2023 年 6 月 21 日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款（不含应计利息）余额共计人民币 19,819,681.18 元。

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。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。

六、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月

12 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

2、《上海市通力律师事务所关于〈永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金清算报告〉的法律意见》

（二）存放地点

基金管理人的办公场所

（三）查阅方式

投资者可通过登录基金管理人网站查阅清算报告，基金管理人在网站登载清算报告视为履行了告知义务。基金管理人网站：www.maxwealthfund.com

永赢沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金财产清算小组 2023 年 7 月 6 日