

海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金清算报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二三年七月五日

清算报告公告日期：二〇二三年七月十七日

§1 重要提示

海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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”）证监许可【2011】268 号文核准募集，《海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于 2011 年 4 月 27 日正式生效。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”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（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《基金合同》的有关约定，基金管理人于 2023 年 06 月 01 日至 2023 年 06 月 19 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金终止基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2023 年 06 月 20 日计票表决通过了《关于海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金终止基金合同有关事项的议案》，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 06 月 20 日，并于 2023 年 06 月 21 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	海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	海富通上证非周期ETF联接

基金主代码	519032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月27日
基金最后运作日(2023年06月20日)基金份额总额	4,787,955.84 份
投资目标	通过投资于上证非周期行业100ETF, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金通过主要投资于上证非周期行业 100ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资, 紧密跟踪标的指数的表现。建仓完成后, 正常情况下投资于上证非周期行业 100ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。建仓期结束后, 在正常市场情况下, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%, 年跟踪误差不超过 4%。在目标 ETF 日均跟踪偏离度符合其基金合同所设定目标的前提下, 如因指数编制规则调整等其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围, 基金管理人应采取合理措施, 避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>本基金投资于上证非周期行业100ETF的方式以申购和赎回为主, 但在上证非周期行业100ETF二级市场流动性较好的情况下, 也可以通过二级市场交易买卖目标ETF。</p>
业绩比较基准	上证非周期行业100指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属 ETF 联接基金, 属于高风险、高预期收益的投资品种。同时本基金为上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金, 具有与上证非周期行业 100 指数相似的风险收益特征。
基金管理人	海富通基金管理有限公司

基金托管人

中国工商银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】268 号文核准募集，于 2011 年 4 月 27 日成立并正式运作，共募集 380,846,897.86 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，由于本基金规模持续处于小微基金状态，为保护投资人利益，基金管理人拟定了终止基金合同的解决方案，经与基金托管人协商一致后，向中国证监会提出申请，并于 2023 年 06 月 01 日至 2023 年 06 月 19 日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，于 2023 年 06 月 20 日计票表决通过了《关于海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金终止基金合同有关事项的议案》。

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 06 月 20 日，清算期间为 2023 年 06 月 21 日至 2023 年 07 月 05 日。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2023 年 06 月 20 日

单位：人民币元

资产	基金最后运作日 2023年06月20日
资产：	
银行存款	418,178.01

结算备付金	
存出保证金	80.36
交易性金融资产	6,078,715.70
其中：股票投资	
基金投资	6,078,715.70
债券投资	
资产支持证券投资	
贵金属投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收清算款	201,273.10
应收股利	
应收申购款	
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	6,698,247.17
负债和净资产	基金最后运作日 2023年06月20日
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	143,212.44
应付管理人报酬	773.08
应付托管费	154.59
应付销售服务费	
应交税费	207.09
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	18,745.13
负债合计	163,092.33

净资产:	
实收基金	4,787,955.84
未分配利润	1,747,199.00
净资产合计	6,535,154.84
负债和净资产总计	6,698,247.17

注：本基金最后运作日2023年06月20日，基金份额净值1.3649元，基金份额总额4,787,955.84份。

4.2 利润表

会计主体：海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告期间：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 20 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 06 月 20 日(基金最后运作日)
一、营业总收入	133,117.42
利息收入	1,431.93
其中：存款利息收入	1,431.93
债券利息收入	
资产支持证券利息收入	
申购款利息收入	
其他利息收入	
投资收益(损失以“-”填列)	25,594.97
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	25,594.97
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	
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	97,554.18
汇兑收益(损失以“-”号填列)	
其他收入(损失以“-”号填列)	8,536.34
减：二、营业总支出	20,960.33
管理人报酬	1,658.49

托管费	331.72
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	92.23
其他费用	18,877.89
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	112,157.09
减：所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	112,157.09
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	112,157.09

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 2788 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 06 月 21 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 本基金最后运作日存出保证金金额 80.36 元。根据中国证券登记结算有限责任公司结算规则，已于 2023 年 07 月 04 日全部划回托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日交易性金融资产市值为 6,078,715.70 元，为持有的目标 ETF 基金。本基金于基金最后运作日持有的交易性金融资产已全部卖出或赎回，扣除交易费用后的变现金额为人民币 5,910,805.76 元，已于 2023 年 6 月 30 日前全部划入基金托管户。

5.1.3 本基金最后运作日应收证券清算款为 201,273.10 元，该款项于 2023 年 6 月 21 日划入托管户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金截止最后运作日的应付赎回款 143,212.44 元，于 2023 年 06 月 26 日支付完毕。

5.2.2 本基金截止最后运作日的应付管理人报酬 773.08 元和应付托管费 154.59 元，于 2023 年 07 月 04 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日应交税费为人民币 207.09 元，预计将于清算期后支付。

5.2.4 本基金截止最后运作日的其他负债中 5.24 元为应付赎回费，已于 2023 年 06 月 26 日支付完毕；18,739.89 元为应付审计费用，待收到审计费发票后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2023年06月21日至2023年07月05日（本次清算期截止日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	777.60
2、投资收益（注 2）	20,294.54
3、公允价值变动损益（注 3）	-192,041.23
清算收入小计	-170,969.09
二、清算费用	
1、银行汇划手续费	17.00
2、税金及附加	36.49
清算费用小计	53.49
三、清算净收益	-171,022.58

注：

(1) 利息收入金额 777.60 元，系以当前适用的利率计提的自 2023 年 06 月 21 日至 2023 年 07 月 05 日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息及申购款利息收入。

(2) 投资收益系清算期间的股票差价收入、基金差价收入及股票股利收入。

(3) 公允价值变动损益系清算期间的股票投资、基金投资产生的公允价值变动。

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 06 月 20 日基金净资产	6,535,154.84
减：最后运作日有效赎回申请对应赎回款	121,693.23
加：清算期间净收益	-171,022.58
二、2023 年 07 月 05 日基金剩余资产净值	6,242,439.03

注：截至本次清算期结束日 2023 年 07 月 05 日，本基金剩余财产 6,242,439.03 元。上述财产将根据本基金的《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2023 年 06 月 21 日至清算款划出日前一日的银行存款、存出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存出保证金、应计银行存款利息、应计存出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。

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。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

1、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算审计报告

2、《上海市通力律师事务所关于〈海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告〉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。

海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金财产清算小组

二〇二三年七月五日