

# 上证非周期行业 100 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：二〇二三年七月十三日

清算报告公告日期：二〇二三年七月二十八日

## §1 重要提示

上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金（以下或简称“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，《上证非周期行业 100 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”）于 2011 年 4 月 22 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 28 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于终止上证非周期行业 100 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 06 月 29 日计票表决通过了《关于终止上证非周期行业 100 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》，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 29 日，并于 2023 年 06 月 30 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	上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	海富通上证非周期ETF
基金主代码	510120

基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
基金最后运作日(2023年06月29日)基金份额总额	1,792,376.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
主要投资策略	本基金采用完全复制法跟踪标的指数，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	上证非周期行业100指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，属于高风险、高预期收益的投资品种。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场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

上证非周期行业 100 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【2011】268 号文核准募集，基金合同于 2011 年 4 月 22 日正式生效，募集期共募集 652,308,409.00 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，基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。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，于 2023 年 06 月 01 日至 2023 年 06 月 28 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于 2023 年 06 月 29 日计票表决通过了《关于终止上证非周期行业 100 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 06 月 29 日，清算期间为 2023 年 06 月 30 日至 2023 年 07 月 13 日。

## §4 财务报告

### 4.1 资产负债表

会计主体：上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 29 日

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日 2023年06月29日
<b>资 产：</b>	
银行存款	539,952.03
结算备付金	342.22
存出保证金	143.63
交易性金融资产	5,827,126.32
其中：股票投资	5,827,126.32
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	6,367,564.20

负债和净资产	基金最后运作日 2023年06月29日
<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	47,105.27
应付赎回款	
应付管理人报酬	5,321.91
应付托管费	1,064.38
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	22,348.56
负债合计	75,840.12
<b>净资产：</b>	
实收基金	4,254,783.05
未分配利润	2,036,941.03
净资产合计	6,291,724.08
负债和净资产总计	6,367,564.20

注：本基金最后运作日2023年06月29日，基金份额净值3.5103元，基金份额总额1,792,376.00份。

#### 4.2 利润表

会计主体：上证非周期行业 100 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 06 月 29 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 29 日(基金最后运作日)
<b>一、营业总收入</b>	95,818.29
利息收入	1,061.21
其中：存款利息收入	1,061.21
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)	298,588.06
其中：股票投资收益	213,319.81
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	85,268.25
其他投资收益	
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-203,830.98
汇兑收益(损失以“-”号填列)	
其他收入(损失以“-”号填列)	
<b>减：二、营业总支出</b>	64,437.86
管理人报酬	35,385.44
托管费	7,077.09
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	21,975.33
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	31,380.43
减：所得税费用	
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	31,380.43
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	
<b>六、综合收益总额</b>	31,380.43

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 2790 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 30 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 342.22 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 342.06 元，应计利息为 0.16 元；根据中国证券登记结算有限责任公司结算规则，结算备付金在每月第六个工作日进行调整，截至 2023 年 07 月 13 日，结算备付金及应计利息余额 9,346.81 元，将于清算期后陆续划回托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 143.63 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所存出保证金为 143.55 元，应计利息为 0.08 元；根据中国证券登记结算有限责任公司结算规则，存出保证金已于 2023 年 07 月 04 日全部划回托管账户。剩余应计保证金利息将于 2023 年 9 月 21 日划入托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产市值为 5,827,126.32 元。截至 2023 年 07 月 13 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 5,822,095.86 元，已划入托管账户。

### 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金截止最后运作日应付证券清算款为 47,105.27 元，于 2023 年 06 月 30 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 5,321.91 元和应付托管费 1,064.38 元，于 2023 年 07 月 04 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日其他负债为 22,348.56 元，其中包括：

5.2.3.1 应付交易佣金 1,586.48 元，于 2023 年 07 月 11 日支付完毕。

5.2.3.2 应付指数使用费 1,035.88 元，将于收到指数使用费发票后支付。

5.2.3.4 应付审计费用 19,726.20 元，将于收到会计师事务所审计费发票后支付。

### 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30日至2023年07月13日（本次清算期截止日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	634.80
2、投资收益（注 2）	-72,091.32
3、公允价值变动损益（注 3）	62,807.76
清算收益小计	-8,648.76
二、清算费用	
1、银行汇划手续费	23.00
清算费用小计	23.00
三、清算净收益	-8,671.76

注：

（1）利息收入金额 634.80 元，为以当前适用的利率计提的自 2023 年 06 月 30 日至 2023 年 07 月 13 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息。

（2）投资收益系清算期间的股票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29日基金净资产	6,291,724.08
加：清算期间净收益	-8,671.76
二、2023年07月13日基金剩余资产净值	6,283,052.32

注：截至本次清算期结束日 2023 年 07 月 13 日，本基金剩余财产 6,283,052.32 元。上述财产将根据本基金《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 07 月 13 日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金及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结算备付金、应计银行存款利息、应计结算备付金利息、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。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、上证非周期行业 100 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<上证非周期行业 100 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。

上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金  
基金财产清算小组

二〇二三年七月十三日