

民生加银中证 200 指数增强型发起式 证券投资基金 清算报告

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日期：2024 年 1 月 5 日

报告送出日期：2024 年 1 月 12 日

一、重要提示

民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金（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【2020】1282 号文准予注册，《民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于 2020 年 12 月 16 日正式生效。本基金基金管理人为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中的约定，“基金合同生效满三年之日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止并按照本基金合同约定的程序进行清算，并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。”

截至基金合同生效满三年之日，即2023年12月16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》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，基金管理人根据相关法律法规、基金合同等约定履行基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人于2023年12月18日发布《关于民生加银中证200指数增强型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金最后运作日为2023年12月16日，并自2023年12月17日（最后运作日的次日）起进入基金财产清算程序。

本基金清算期为2023年12月17日至2024年1月5日，由本基金管理人民生加银基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、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）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

| | |
|--------------------------|--|
| 基金名称 | 民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 民生加银中证 200 指数增强 |
| 基金主代码 | 009904 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 12 月 16 日 |
| 2023 年 12 月 16 日日终基金份额总额 | 12,922,040.96 份 |
| 投资目标 | 本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 200 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，力争实 |

| | | |
|---------------------------------|--|-------------------|
| | 现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 | |
| 投资策略 | 本基金为指数增强基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 200 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 民生加银基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属基金份额类别的基金简称 | 民生加银中证 200 指数增强 A | 民生加银中证 200 指数增强 C |
| 下属基金份额类别的交易代码 | 009904 | 009905 |
| 2023 年 12 月 16 日日终下属基金份额类别的份额总额 | 11,284,807.31 份 | 1,637,233.65 份 |

三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2020]1282 号)注册，由民生加银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》、《民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的规定发售，基金合同于 2020 年 12 月 16 日生效。本基金为契约型开放式，首次设立募集规模为 22,788,615.50 份基金份额。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司(以下简称“民生加银基金公司”)，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》以及民生加银基金管理有限公司于 2023 年 12 月 18 日发布的《关于民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2023 年 12 月 17 日进入财产清算期，本基金的基金管理人已根据相关法律法规和本基金基金合同的规定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

四、 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：民生加银中证 200 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 16 日

单位：人民币元

| | 最后运作日 2023 年 12 月 16 日 |
|-------------|---------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 5,236,798.82 |
| 结算备付金 | 116.71 |
| 其他资产 | 5,279,028.84 |
| 资产总计 | 10,515,944.37 |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | 121,500.09 |
| 应付管理人报酬 | 4,763.82 |
| 应付托管费 | 952.76 |
| 应付销售服务费 | 214.64 |
| 其他负债 | 59,054.12 |
| 负债合计 | 186,485.43 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 12,922,040.96 |
| 未分配利润 | -2,592,582.02 |
| 净资产合计 | 10,329,458.94 |
| 负债和净资产总计 | 10,515,944.37 |

注 1：截至最后运作日 2023 年 12 月 16 日，民生加银中证 200 指数增强 A 基金份额为 11,284,807.31 份，基金份额净值为人民币 0.8003 元，基金资产净值为人民币 9,031,029.49 元；民生加银中证 200 指数增强 C 基金份额为 1,637,233.65 份，基金份额净值为人民币 0.7931 元，基金资产净值为人民币 1,298,429.45 元。

注 2：本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《资产管理产品相关会计处理规定》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了呈报本基金全体基金份额持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表不适用于其他用途。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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、 清算情况

清算期间自 2023 年 12 月 17 日至 2024 年 1 月 5 日止，本基金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、负债清偿及清算期间的清算损益情况如下：

1、 资产处置情况

- (1) 本基金于 2023 年 12 月 16 日(最后运作日)银行存款为人民币 5,236,798.82 元, 其中应计利息为人民币 323.01 元, 已于 2023 年 12 月 21 日全部划入本基金托管账户。
- (2) 本基金于 2023 年 12 月 16 日(最后运作日)结算备付金及其应计利息合计人民币 116.71 元, 均为应计利息, 已于 2023 年 12 月 21 日划入本基金托管账户。
- (3) 本基金于 2023 年 12 月 16 日(最后运作日)其他资产为 5,279,028.84 元, 为应收证券清算款等, 已于 2023 年 12 月 18 日、2023 年 12 月 21 日及 2024 年 1 月 3 日先后划入本基金托管账户。

2、负债清偿情况

- (1) 本基金于 2023 年 12 月 16 日(最后运作日)应付管理人报酬为人民币 4,763.82 元, 已于 2023 年 12 月 18 日支付。
- (2) 本基金于 2023 年 12 月 16 日(最后运作日)应付托管费为人民币 952.76 元, 已于 2023 年 12 月 18 日支付。
- (3) 本基金于 2023 年 12 月 16 日(最后运作日)应付销售服务费为人民币 214.64 元, 已于 2023 年 12 月 18 日支付。
- (4) 本基金于 2023 年 12 月 16 日(最后运作日)其他负债为人民币 59,054.12 元。其中包括预提审计费人民币 20,000.00 元、应付交易费用人民币 15,289.55 元、预提律师费人民币 15,000.00 元、应付指数使用费人民币 8,369.57 元和预提汇划费人民币 395.00 元, 除交易费用人民币 15,289.55 元、指数使用费人民币 8,369.57 元及汇划费人民币 190.00 元以外, 其余款项尚未支付。
- (5) 于 2023 年 12 月 13 日提出申请并于 2023 年 12 月 14 日确认的基金赎回款项人民币 32,869.93 元, 已于 2023 年 12 月 18 日划付完毕。于 2023 年 12 月 14 日提出申请并于 2023 年 12 月 15 日确认的基金赎回款项 88,630.16 元, 已于 2023 年 12 月 19 日划付完毕。

3、清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

| 项目 | 自2023年12月17日起至 2024年1月5日止清算期间 |
|------------|----------------------------------|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入(注1) | 1,962.56 |
| 2、其他收入 | 2.70 |
| 清算收益小计 | 1,965.26 |
| 二、清算支出 | |
| 清算支出小计 | 2,543.39 |

| | |
|---------|---------|
| 三、清算净收益 | -578.13 |
|---------|---------|

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2023年12月17日起至2024年1月5日止清算期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入和存出保证金利息收入。其中，银行存款利息收入为人民币1,962.23元，结算备付金利息收入为人民币-0.26元，存出保证金利息收入为人民币0.59元。

注2：清算期间自2023年12月17日起至2024年1月5日止。

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12月16日基金净资产 | 10,329,458.94 |
| 加：清算期间净收益 | -578.13 |
| 减：基金净赎回金额（于2023年12月18日确认的投资者赎回申请） | 22,129.62 |
| 二、清算结束日2024年1月5日基金净资产 | 10,306,751.19 |

资产处置及负债清偿后，2024年1月5日本基金剩余财产为人民币10,306,751.19元。根据《民生加银中证200指数增强型发起式证券投资基金基金合同》以及民生加银基金管理有限公司于2023年12月18日发布的《关于民生加银中证200指数增强型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，依据基金财产清算的分配方案，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。自清算结束日次日至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 民生加银中证200指数增强型发起式证券投资基金清算财务报表及审计报告
- (2) 关于《民生加银中证200指数增强型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公场所

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

民生加银中证200指数增强型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2024年1月5日