

汇添富沪港深优势精选定期开放混合型 证券投资基金清算报告

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二四年二月二日

报告公告日期：二〇二四年三月二十一日

目 录

一、重要提示	1
二、基金概况	2
三、基金运作情况概述	4
四、财务会计报告	5
五、清算情况	6
六、备查文件	9

一、重要提示

汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金（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”）2016年12月15日证监许可【2016】3084号文准予注册，并经2018年3月5日证监许可【2018】376号文准予变更注册后募集，于2018年9月21日成立并正式运作，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》、《汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）的有关规定，本基金已触发基金合同终止情形，本基金管理人将依据法律法规的规定及基金合同的约定履行基金财产清算程序并终止基金合同，此事项不需召开基金份额持有人大会。

根据基金管理人于2024年1月30日发布的《关于汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金进入清算期及终止基金合同的公告》，本基金自2024年1月30日起进入清算程序，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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于2024年1月30日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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	汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金
基金简称	汇添富沪港深优势定开
基金代码	006205
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018年9月21日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
最后运作日(2024年1月29日)基金份额总额	26,904,200.48份
投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选优质个股，为基金份额持有人谋求基金资产的中长期稳健增值。
主要投资策略	本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘股票市场中具有核心竞争优势和长期持续增长模式的上市公司。本基金封闭期的投资策略主要包括：资产配置策略、个股精选策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、权证投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关

	<p>投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。同时，结合市场流动性特点，本基金将提前合理安排组合流动性，统筹考虑投资者申购赎回特征和客户大额资金流向特征，以确定本基金在不同投资品种的配置比例，确保开放期内流动性充裕。</p>
业绩比较基准	<p>恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*65%+中债综合财富指数收益率*20%+沪深300指数收益率*15%</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中等收益/风险特征的基金。本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会 2016 年 12 月 15 日证监许可【2016】3084 号文准予注册，并经 2018 年 3 月 5 日证监许可【2018】376 号文准予变更注册后募集，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司于 2018 年 9 月 3 日至 2018 年 9 月 19 日向社会公开发行募集，基金合同于 2018 年 9 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 217,758,457.39 份（含募集期间利息结转的份额）。自 2018 年 9 月 21 日至 2024 年 1 月 29 日期间，本基金按基金合同正常运作。

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”约定：

“《基金合同》生效后，若在任一开放期最后一日基金资产净值加上当日申购的基金份额对应的资产净值减去当日赎回的基金份额对应的资产净值低于 5000 万元，本基金将进行基金财产清算并终止，不需召开基金份额持有人大会。如没有触发前述自动终止情形，且连续 20 个工作日出现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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。”

本基金最近一次开放期为 2024 年 1 月 2 日(含)至 2024 年 1 月 29 日(含)。截至该次开放期的最后一日（即 2024 年 1 月 29 日）日终，基金资产净值加上当日申购的基金份额对应的资产净值减去当日赎回的基金份额对应的资产净值低于 5000 万元，触发基金合同约定的终止情形。本基金将根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会。

根据基金管理人于 2024 年 1 月 30 日发布的《关于汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金进入清算期及终止基金合同的公告》，本基金自 2024 年 1 月 30 日起进入清算程序。

四、财务会计报告

1. 基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2024年1月29日（本基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024年1月29日
资产：	
银行存款	8,299,917.17
结算备付金	1,765.06
存出保证金	869.68
交易性金融资产	2,466,323.53
其中：股票投资	2,466,323.53
应收清算款	6,628,520.00
应收股利	5,120.00
资产总计：	17,402,515.44
负债和所有者权益	最后运作日 2024年1月29日
负债：	
应付赎回款	1,311,770.08
应付管理人报酬	20,071.14
应付托管费	3,345.19
其他负债	90,966.91
负债合计	1,426,153.32
净资产：	
实收基金	26,904,200.48
未分配利润	-10,927,838.36
净资产合计	15,976,362.12
负债和净资产总计	17,402,515.44

注：本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《资产管理产品相关会计处理规定》等有关规定编制的。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，本清算报表并无可比期间的相关数据列示。

五、清算情况

本基金的清算期间为自 2024 年 1 月 30 日至 2024 年 2 月 2 日。基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序对本基金的资产、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 8,299,917.17 元，其中托管户存款为人民币 8,295,890.54 元，应计银行存款利息为人民币 4,026.63 元，应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 1,765.06 元，其中应计结算备付金利息为人民币 1,765.06 元，上述款项将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 869.68 元，其中存放于中国证券登记结算有限公司的存出保证金为人民币 869.15 元，该款项已于 2024 年 2 月 2 日划回托管户；应计存出保证金利息为人民币 0.53 元，应计存出保证金利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 2,466,323.53 元，均为股票投资，于清算期间进行处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 2,429,026.86 元，已于清算期间划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 6,628,520.00 元，该款项已于清算期间完成交收。

(6) 本基金最后运作日应收股利为人民币 5,120.00 元，该款项将由基金管理人以自有资金先行垫付。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1,311,770.08 元，该款项已于清算期间完成支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 20,071.14 元，该款项已于 2024 年 2 月 2 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,345.19 元, 该款项已于 2024 年 2 月 2 日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 90,966.91 元, 其中应付交易佣金 10,966.91 元, 已计提尚未支付的 2023 年度信息披露费 50,000.00 元, 清算产生的清算律师费 15,000.00 元, 上述款项已于 2024 年 2 月 2 日支付; 清算审计费 15,000.00 元, 该款项将于清算结束后划付。

3、清算损益情况说明

单位: 人民币元

项目	自 2024 年 1 月 30 日至 2024 年 2 月 2 日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注 1)	848.08
2、投资收益	-2,621,140.02
3、公允价值变动收益	2,581,897.11
清算收益小计	-38,394.83
二、清算支出	
1、其他费用(注 2)	54.18
清算支出小计	54.18
三、清算净收益	-38,449.01

注 1: 利息收入系预提的自 2024 年 1 月 30 日起至 2024 年 2 月 2 日止清算期间的银行存款、结算备付金、存出保证金利息收入。

注 2: 其他费用系自 2024 年 1 月 30 日起至 2024 年 2 月 2 日止清算期间的银行存款汇划手续费和港股证券组合费。

4、剩余资产分配情况说明

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 1 月 29 日基金净资产	15,976,362.12
加: 清算期间净收益	-38,449.01
减: 基金净赎回金额(于 2024 年 1 月 30 日确认的投资者赎回申请)	787,114.03
二、清算结束日 2024 年 2 月 2 日基金净资产	15,150,799.08

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2024 年 2 月 2 日，本基金剩余财产为人民币 15,150,799.08 元，根据本基金的基金合同，本基金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。

自本次清算期起始日 2024 年 1 月 30 日至清算款划出前一日产生的银行存款、结算备付金、存出保证金利息归基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，该部分利息将由基金管理人以自有资金垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

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，报上海证监局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分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 汇添富沪港深优势精选定期开放混合型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<汇添富沪港深优势精选定期开放混合型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。

汇添富沪港深优势精选定期开放混合型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二四年二月二日