

华润元大臻选回报混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中泰证券股份有限公司

清算报告出具日：二〇二四年四月十六日

清算报告公告日：二〇二四年四月二十二日

目录

重要提示	3
一、基金概况	3
二、基金运作情况及清算原因.....	4
三、财务会计报告	5
四、清算情况	5
五、备查文件	8

重要提示

华润元大臻选回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2021年8月25日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2021】2788号文准予募集注册，由华润元大基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）作为基金管理人向社会公开发行人募集，基金合同于2022年2月18日正式生效。本基金基金管理人为华润元大基金管理有限公司，基金托管人为中泰证券股份有限公司。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定和《华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，基金管理人经与本基金基金托管人中泰证券股份有限公司协商一致，由基金管理人召集，以通讯方式二次召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于终止华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金份额持有人大会已于2024年3月12日表决通过了该议案。根据会议通过的议案及《关于终止华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》，本基金最后运作日为2024年3月15日，于2024年3月16日起进入清算期。

本基金清算期自2024年3月16日至2024年4月11日止。本基金的基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和北京金诚同达（深圳）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，并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，北京金诚同达（深圳）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	华润元大臻选回报混合型证券投资基金
基金简称	华润元大臻选回报混合
基金主代码	013598
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年2月18日
基金管理人名称	华润元大基金管理有限公司

基金托管人名称	中泰证券股份有限公司
公告依据	《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》等相关法律法规以及《华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金合同》、《华润元大臻选回报混合型证券投资基金招募说明书》
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司
基金合同存续期	不定期
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过对不同资产类别的动态配置和个股精选，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金具有前瞻性的宏观策略分析，自上而下分析与自下而上选股相结合，进行深入的个股挖掘。首先根据不同的经济周期及市场趋势研判，决定本基金的大类资产配置以及行业偏离决策；其次是采取自下而上的分析方法，从定量和定性两个方面，通过对企业的全面深入研究，优选具备优质企业资质的公司。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*70%+中债综合全价指数收益率*20%+恒生指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期的收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

二、基金运作情况及清算原因

本基金经2021年8月25日中国证监会证监许可【2021】2788号文准予募集注册，自2021年12月10日至2022年2月16日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为215户，募集资金及其产生的利息共计209,023,762.00元，折合基金份额209,023,762.00份。华润元大基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后，于2022年2月18日获书面确认，《华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金合同》自该日起正式生效。

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定及《基金合同》的相关约定，经本基金份额持有人大会2024年3月12日表决通过，决定终止基金合同，并根据法律法规规定和基金合同约定履行基金财产清算程序。本基金管理人于2024年3月13日发布了《关于华润元大臻选回报混合型证券投资基金基金份额持有人大会（二次召开）表决结果暨决议生效的公告》，本基金最后运作日为2024年3月15日，自2024年3月16日起进入清算期。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：华润元大臻选回报混合型证券投资基金

报告截止日：2024年3月15日

单位：人民币元

	最后运作日 2024年3月15日
资产：	
货币资金	9,613.66
结算备付金	61,703.43
交易性金融资产	80,322.91
其中：股票投资	80,322.91
应收清算款	11,138.70
资产总计	162,778.70
负债：	
应付赎回款	23,260.71
应付管理人报酬	37.15
应付托管费	6.20
应付销售服务费	3.66
其他负债	16,000.04
负债合计	39,307.76
净资产：	
实收基金	117,709.12
未分配利润	5,761.82
净资产合计	123,470.94
负债和净资产总计	162,778.70

注：基金最后运作日2024年3月15日，基金份额总额117,709.12份，其中A类基金份额净值人民币1.0440元，份额总额56,891.13份；C类基金份额净值人民币1.0536元，份额总额60,817.99份。

四、清算情况

自2024年3月16日至2024年4月11日止的清算期间，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

金清算费用、资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币9,613.66元，其中本金人民币9,601.57元，应计利息人民币12.09元。基金管理人于清算结束后以自有资金垫付银行存款应计利息款项。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币61,703.43元，其中本金人民币61,667.47元，应计利息人民币35.96元。于清算期间计提应计利息人民币2.09元，收到证券交易结算款人民币92,193.65元，收到利息人民币32.90元，冲回应计利息人民币4.30元，自结算备付金划出人民币153,894.02元。截止至清算结束日结算备付金为人民币0.85元，均为应计利息。基金管理人于清算结束后以自有资金垫付剩余结算备付金应计利息款项。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币80,322.91元，均为上市流通的股票投资。截至清算结束日，股票投资均已处置变现，实际变现金额为人民币81,049.31元。

(4) 本基金最后运作日应收清算款为人民币11,138.70元。于清算期间交易港股通市场股票变现形成的应收清算款为人民币12,938.73元，上述款项已于2024年4月11日前（含当日）划入本基金托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 23,260.71 元。该款项已于2024年3月18日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 37.15 元。该款项已于2024年4月2日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 6.20 元。该款项已于2024年4月2日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 3.66 元。该款项已于2024年4月2日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 16,000.04 元。其中预提年度审计费和清算审计费人民币 16,000.00 元，应付赎回费人民币 0.04 元。于清算期间，上述款项均已于2024年4月11日前（含当日）支付。此外，于清算期间预提银行汇划费人民币 33.52 元。截至清算结束日其他负债为人民币 33.52 元，

该款项尚未支付。本基金因清算产生的律师费，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的律师费由基金管理人承担并支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2024年3月16日至 2024年4月11日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	32.58
2、投资收益（损失以“-”填列）（注2）	-880.96
3、公允价值变动损益（注3）	1,607.36
清算收益小计（损失以“-”填列）	758.98
二、清算支出	
1、其他费用（注4）	78.24
清算支出小计	78.24
三、清算净收益（损失以“-”填列）	680.74

注 1：利息收入为清算期间计提的银行存款利息收入、结算备付金利息收入。

注 2：投资收益均为清算期间股票投资处置产生的差价收入。

注 3：公允价值变动损益均为清算期间股票投资处置结转的公允价值变动损益。

注 4：其他费用为清算期间确认的银行汇划费和证券组合费。

5、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 2024 年 3 月 15 日基金净资产	123,470.94
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	680.74
二、清算结束日 2024 年 4 月 11 日基金净资产	124,151.68

根据本基金的《基金合同》的约定，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。

清算结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款及存出保证金产生的利息归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，于清算划款日的应收利息余额将由基金管理人以自有资金先行垫付（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），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。垫付资金及孳生的利息（以实际结息金额为准）将于

清算期后返还给基金管理人。

6、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。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《华润元大臻选回报混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于华润元大臻选回报混合型证券投资基金清算的法律意见书》

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

华润元大臻选回报混合型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二四年四月十六日