

# 华宝中证 1000 指数证券投资基金 清算报告

基金管理人：华宝基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 2 月

## 一、重要提示

华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2015 年 4 月 20 日《关于准予华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】664 号）准予募集，《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日起正式生效。基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝中证 1000 指数分级证券投资基金。华宝中证 1000 指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于 2020 年 11 月 19 日表决通过了《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意华宝中证 1000 指数分级证券投资基金取消分级运作机制、由分级基金转为普通指数基金，修改基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配等内容。根据《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告》，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金于 2020 年 11 月 19 日起更名为华宝中证 1000 指数证券投资基金。

根据《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数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》，华宝中证 1000 指数证券投资基金自 2025 年 1 月 10 日起进入清算程序，进入清算程序后，不再收取基金管理费、托管费、C 类基金份额的销售服务费。

基金管理人华宝基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（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，由毕马威华振会计师事务所（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	华宝中证 1000 指数证券投资基金
基金简称	华宝中证 1000 指数
场内简称	中证 1000 基金
基金主代码	162413
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 19 日
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。

投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金标的指数为中证 1000 指数。本基金投资于中证 1000 指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。	
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整。在正常情况下，本基金力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时，由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致本基金无法及时完成投资组合同步调整的情况下，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。	
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝中证 1000 指数	华宝中证 1000 指数 C
下属分级基金的交易代码	162413	016033

### 三、基金运作情况

华宝中证 1000 指数证券投资基金（以下简称“本基金”）由华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型变更而来，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金由华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金更名而来。华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金经中国证监会证监许可【2015】664 号文准予注册，由基金管理人依照法律法规的规定及《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》的约定自 2015 年 5 月 25 日至 2015 年 5 月 29 日止期间向社会公开募集。《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 4 日正式生效，《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》生效日的基金份额总额为 330,711,104.54 份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为 5,350 户。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝中证 1000 指数分级证券投资基金。华宝中证 1000 指

数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于 2020 年 11 月 19 日表决通过了《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，同意华宝中证 1000 指数分级证券投资基金取消分级运作机制、由分级基金转为普通指数基金，修改基金的投资、基金资产估值、基金费用与税收、基金的收益与分配等内容。根据《关于华宝中证 1000 指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告》，华宝中证 1000 指数分级证券投资基金于 2020 年 11 月 19 日起更名为华宝中证 1000 指数证券投资基金。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《华宝中证 1000 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”）“第五部分 基金的存续”之“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，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 万元情形的，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之一的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2024 年 7 月 24 日日终，本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。根据《基金合同》约定，基金管理人向中国证监会提交解决方案报告，并分别于 2024 年 8 月 1 日、2024 年 12 月 4 日发布《华宝基金管理有限公司关于以通讯方式召开华宝中证 1000 指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《华宝基金管理有限公司关于以通讯方式二次召开华宝中证 1000 指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于华宝中证 1000 指数证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。根据《华宝基金管理有限公司关于华宝中证 1000 指数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》，本基金的最后运作日为 2025 年 1 月 9 日，自 2025 年 1 月 10 日起，本基金进入清算程序。

自《华宝兴业中证 1000 指数分级证券投资基金基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

## 四、 财务会计报告

华宝中证1000指数证券投资基金最后运作日资产负债表

(金额单位：人民币元)

2025年1月9日

(最后运作日)

资产：

货币资金

1,739,860.59

结算备付金

26,703.81

存出保证金	2,410.25
交易性金融资产	115,112.02
其中：股票投资	115,112.02
应收清算款	29,223,190.31
资产合计	31,107,276.98
负债：	
应付赎回款	2,327.56
应付管理人报酬	4,285.40
应付托管费	857.07
应付销售服务费	308.01
其他负债	122,078.95
负债合计	129,856.99
净资产：	
实收基金	86,016,938.85
未分配利润	(55,039,518.86)
净资产合计	30,977,419.99
负债和净资产总计	31,107,276.98

注：于最后运作日 2025 年 1 月 9 日，基金份额总额 35,991,626.56 份，其中，华宝中证 1000 指数基金份额总额 31,671,767.64 份，基金份额净值人民币 0.8615 元；华宝中证 1000 指数 C 基金份额总额 4,319,858.92 份，基金份额净值人民币 0.8549 元。

## 五、 清算报表编制基础

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《证券投资基金会计核算业务指引》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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 六、 清算情况

自 2025 年 1 月 10 日起至 2025 年 1 月 16 日止的清算期间，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。本基金的资产、负债及于清算期间的具体清算情况如下：

### 1、清算费用

按照《基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，“清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。”

### 2、资产处置情况

- (1) 本基金于 2025 年 1 月 9 日(最后运作日)的货币资金余额为人民币 1,739,860.59 元，其中本金为人民币 1,739,480.97 元，应计利息为人民币 379.62 元。清算期间收支款项的净额为人民币 23,327,591.51 元。于 2025 年 1 月 16 日(清算结束日)的货币资金余额为人民币 25,067,452.10 元，其中本金为人民币 25,065,136.69 元，其中应计利息为人民币 2,315.41 元。
- (2) 本基金于 2025 年 1 月 9 日(最后运作日)的结算备付金余额为人民币 26,703.81 元，其中本金为人民币 26,703.56 元，应计利息人民币 0.25 元。于 2025 年 1 月 16 日(清算结束日)的结算备付金余额为人民币 26,705.56 元，其中本金为人民币 26,703.56 元，应计利息人民币 2.00 元。
- (3) 本基金于 2025 年 1 月 9 日(最后运作日)的存出保证金余额为人民币 2,410.25 元，其中本金为人民币 2,408.97 元，其中应计利息为人民币 1.28 元。于 2025 年 1 月 16 日(清算结束日)的存出保证金余额为人民币 2,410.39 元，其中本金为人民币 2,408.97 元，其中应计利息为人民币 1.42 元。
- (4) 本基金于 2025 年 1 月 9 日(最后运作日)的交易性金融资产余额为人民币 115,112.02 元，均为股票投资。本基金自 2025 年 1 月 10 日(清算起始日)至 2025 年 1 月 16 日(清算结束日)止期间进行第一次清算，对部分股票投资进行处置变现，变现产生的清算款合计为人民币 12,485.25 元，截至 2025 年 1 月 16 日(清算结束日)的交易性金融资产余额为人民币 109,035.02 元，将进行处置变现后于第二次清算时再向基金份额持有人分配。
- (5) 本基金于 2025 年 1 月 9 日(最后运作日)的应收清算款余额为人民币 29,223,190.31 元，为证券交易产生的应收清算款项。该款项已于 2025 年 1 月 10 日划至基金托管账户。

### 3、负债清偿情况

- (1) 本基金于 2025 年 1 月 9 日(最后运作日)的应付赎回款余额为人民币 2,327.56 元，该款项已于 2025 年 1 月 10 日和 2025 年 1 月 13 日相继支付完毕。

- (2) 本基金于 2025 年 1 月 9 日 (最后运作日) 的应付管理人报酬余额为人民币 4,285.40 元, 该款项已于 2025 年 1 月 13 日支付。
- (3) 本基金于 2025 年 1 月 9 日 (最后运作日) 的应付托管费余额为人民币 857.07 元, 该款项已于 2025 年 1 月 13 日支付。
- (4) 本基金于 2025 年 1 月 9 日 (最后运作日) 的应付销售服务费余额为人民币 308.01 元, 该款项已于 2025 年 1 月 13 日支付。
- (5) 本基金于 2025 年 1 月 9 日 (最后运作日) 的其他负债余额为人民币 122,078.95 元, 包括预提信息披露费人民币 50,000.00 元, 该款项已于 2025 年 1 月 13 日支付, 预提审计费人民币 8,000.00 元, 该款项已于 2025 年 1 月 15 日支付; 应付交易费用人民币 9,078.95 元, 该款项已于 2025 年 1 月 15 日支付; 应付指数使用费人民币 55,000.00 元, 该款项已于 2025 年 1 月 16 日支付。

#### 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

一、2025 年 1 月 9 日 (最后运作日) 基金净资产	30,977,419.99
加：清算期间收益 (损失以“-”填列)：	
利息收入 (注 1)	1,937.68
投资收益	(31,102.50)
公允价值变动收益	30,409.84
其他收入 (注 2)	32.72
减：其他费用 (注 3)	45.00
基金赎回金额 (注 4)	5,773,049.66
二、2025 年 1 月 16 日 (清算结束日) 基金净资产	<u>25,205,603.07</u>

注 1：利息收入系自 2025 年 1 月 10 日 (清算起始日) 至 2025 年 1 月 16 日 (清算结束日) 止期间的货币资金、结算备付金、存出保证金利息收入；

注 2：其他收入系基金赎回费收入；

注 3：其他费用系银行费用；

注 4：基金赎回金额系投资者 2025 年 1 月 9 日 (最后运作日) 提出赎回申请后，清算期内确认的应付赎回款。

资产部分处置及负债清偿后，截至 2025 年 1 月 16 日 (清算结束日) 本基金剩余净资产为人民币 25,205,603.07 元。根据基金合同的约定，本基金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。

截止 2025 年 1 月 16 日(清算结束日)，股票投资的成本总额为人民币 253,269.94 元，估值总额为人民币 109,035.02 元。由于本基金于 2025 年 1 月 16 日(清算结束日)尚持有股票投资，第一次清算期间为自 2025 年 1 月 10 日(清算起始日)至 2025 年 1 月 16 日(清算结束日)止期间，之后的二次清算期间将根据股票投资的变现时间确定。此估值金额与实际变现金额可能存在差异，将根据变现情况在第二次清算时按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2025 年 1 月 17 日至清算款划出日前一日的货币资金产生的利息亦属基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由基金份额持有人承担，最终将于二次清算结束日以基金净资产合计数按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后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进行分配。

## 七、备查文件

### 1、备查文件目录

- (1) 《华宝中证1000指数证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 关于《华宝中证1000指数证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 2、存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所备投资者查阅。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件。

华宝中证 1000 指数证券投资基金基金财产清算小组  
2025 年 2 月