

华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金清算报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：2026年4月21日

§1 重要提示

华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》（证监许可[2023]297号）的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2023年4月11日生效，首次设立募集规模为75,627,735.42份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

2026年4月12日基金管理人发布《关于华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金触发基金合同终止情形的公告》，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》《华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》（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。

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”的约定，《基金合同》生效日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。本基金《基金合同》生效日为2023年4月11日。《基金合同》生效日起三年后的对应日为2026年4月11日。截至2026年4月11日日终，本基金的基金资产净值低于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。本基金于2026年4月12日起进入清算程序，并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人华泰证券股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2026年4月13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，上海源泰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 | 华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 |
| 基金简称 | 华安中证数字经济主题 ETF 发起式联接 |
| 基金主代码 | 018031 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 4 月 11 日 |
| 报告期末(2026 年 4 月 11 日) 基金份额总额 | 24,659,183.64 份 |
| 投资目标 | 通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.35%，年跟踪误差争取不超过 4%。 |
| 投资策略 | <p>本基金为目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。</p> <p>本基金通过把接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。在正常市场情况下，本基金的日均跟踪偏离度的绝对值争取不超过 0.35%，年跟踪误差争取不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、资产配置策略</p> |

| | |
|--------|--|
| | 2、目标 ETF 投资策略 3、股票投资策略 4、存托凭证投资策略 5、债券投资策略 6、股指期货投资策略 7、资产支持证券的投资策略 8、参与转融通证券出借业务策略 9、融资业务策略 今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。 |
| 业绩比较基准 | $\text{中证数字经济主题指数收益率} \times 95\% + \text{商业银行税后活期存款利率} \times 5\%$ |
| 风险收益特征 | 本基金属于目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的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。本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 华泰证券股份有限公司 |

§3 基金运作情况概述

本基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》（证监许可[2023]297号）的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2023年4月11日生效，首次设立募集规模

为 75,627,735.42 份基金份额。

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。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”的约定，《基金合同》生效日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。本基金《基金合同》生效日为 2023 年 4 月 11 日。《基金合同》生效日起三年后的对应日为 2026 年 4 月 11 日。截至 2026 年 4 月 11 日日终，本基金的基金资产净值低于 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。本基金于 2026 年 4 月 12 日起进入清算程序，并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人于 2026 年 4 月 12 日发布了《关于华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金触发基金合同终止情形的公告》。本基金最后运作日为 2026 年 4 月 11 日，自 2026 年 4 月 12 日进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
 报告截止日：2026 年 4 月 11 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末（基金最后运作日） 2026 年 4 月 11 日 |
|------------|---------------------------------|
| 资产： | |
| 货币资金 | 26,725,423.53 |
| 结算备付金 | 6,398.33 |
| 存出保证金 | 18,950.70 |
| 交易性金融资产 | - |
| 其中：股票投资 | - |
| 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 | - |
| 债权投资 | - |
| 其中：债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 其他投资 | - |
| 其他债权投资 | - |
| 其他权益工具投资 | - |
| 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 | 26,750,772.56 |
| 负债和净资产 | 本期末 本期末（基金最后运作日） 2026年4月11日 |
| 负 债： | |
| 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 | - |
| 应付赎回款 | 679,138.86 |
| 应付管理人报酬 | 2,697.32 |
| 应付托管费 | 539.48 |
| 应付销售服务费 | 240.68 |
| 应付投资顾问费 | - |
| 应交税费 | 74,152.55 |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 113,012.97 |
| 负债合计 | 869,781.86 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 24,659,183.64 |
| 其他综合收益 | - |
| 未分配利润 | 1,221,807.06 |
| 净资产合计 | 25,880,990.70 |
| 负债和净资产总计 | 26,750,772.56 |

注 1：本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。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，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

注 2：本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师杨亦颖、李雯签字出具了安永华明（2026）专字第 70015772_B05 号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2026 年 4 月 12 日至 2026 年 4 月 14 日止清算期间，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程序进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日货币资金金额为 26,725,423.53 元，其中存放在托管账户金额为 26,717,572.55 元，应收银行存款利息金额为 7,850.98 元。应收银行存款利息由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于清算期内划入托管户，结息之后产生的尾差归基金管理人所有。

5.1.2 本基金最后运作日应收最低清算备付金金额为 6,398.33，其中存放在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的最低备付金金额为 6,398.21，应收利息金额为 0.12 元，该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于清算期内划入托管户，结息之后产生的尾差归基金管理人所有。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金金额为 18,950.70 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金金额为 18,946.92 元，应计存出

保证金利息金额为 3.78 元。上述款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于清算期内划入托管户，结息之后产生的尾差归基金管理人所有。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款金额为 679,138.86 元，已于清算期间内完成支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬金额为 2,697.32 元，已于清算期间内完成支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费金额为 539.48 元，已于清算期间内完成支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费金额为 240.68 元，已于清算期间内完成支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付税费金额为 74,152.55 元，已于清算期间内完成支付。

5.2.6 本基金最后运作日应付其他负债金额为 113,012.97 元，其中应付赎回费金额为 25.88 元，已于清算期间内完成支付。预提审计费用 19,151.10 元，其中 15,000.00 元是尚未支付的 2025 年度的审计费用，将于清算期后支付；4,151.10 元将于本基金年度财务报表审计报告出具后支付，若因本基金终止运作未出具年度财务报表审计报告，冲回该预提费用产生的收益按照基金份额持有人持有的基金份额分配给基金份额持有人。预提证券日报信息披露费用 93,835.99 元，其中 80,000.00 元是尚未支付的 2025 年度信息披露费用；13,835.99 元是今年预提的信息披露费用，经与证券日报协商一致，给予减免优惠，冲回该预提费用产生的收益按照基金份额持有人持有的基金份额分配给基金份额持有人。

5.3 清算期间的清算损益情况

| 项目 | 自2026年4月12日 至2026年4月14日止清算期间 |
|---------------------|---------------------------------|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入（注1） | 3,106.10 |
| 2、其他收入 | - |
| 3、投资收益 | - |
| 清算收入小计 | 3,106.10 |
| 二、清算费用 | |
| 其他费用小计 | - |
| 三、清算净收益（净损失以“-”号填列） | 3,106.10 |

注1：利息收入系计提的自2026年4月12日至2026年4月14日止清算期间的银行存款利息、最低备付金利息和存出保证金利息。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于清算期间内划入托管户，结息之后产生的尾差归基金管理人所有。

5.4 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2026年4月11日基金净资产 | 25,880,990.70 |
| 加：清算期间净收益 | 3,106.10 |
| 减：清算期间确认的应付赎回款 | 293,247.35 |
| 二、2026年4月14日基金净资产 | 25,590,849.45 |

根据本基金的基金合同及《关于华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金触发基金合同终止情形的公告》的约定，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。

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。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1、华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金清算财务报表及审计报告

2、关于华安中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金清算事宜之法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 (<http://www.huaan.com.cn>)、中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)，清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安中证数字经济主题交易型开放式指数
证券投资基金发起式联接基金
基金财产清算小组

二〇二六年四月二十日（清算报告出具日）