

浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资
基金联接基金
清算报告

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年3月28日

清算报告送出日：2023年4月7日

§ 1 重要提示

浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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”）证监许可[2019]609号《关于准予浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》准予注册，于2020年4月1日成立并正式运作。

为顺应市场环境变化，保护基金份额持有人的利益，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》等法律法规的规定和《浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关约定，本基金管理人经与本基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，提议终止《浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据基金管理人2023年1月13日公告的《关于浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议生效公告》”），本次基金份额持有人大会于2023年1月12日表决通过了《关于终止浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》，本基金最后运作日为2023年1月15日，自2023年1月16日进入清算期。

基金管理人浦银安盛基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和国浩律师（上海）事务所于2023年1月16日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，国浩律师（上海）事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛中证高股息 ETF 联接
基金主代码	007410
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2020年4月1日	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末(2023年1月15日)基金份额总额	3,480,813.66份	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛中证高股息ETF联接A	浦银安盛中证高股息ETF联接C
下属分级基金的交易代码	007410	007411
报告期末下属分级基金的份额总额	2,969,476.64份	511,337.02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。	
投资策略	本基金以目标ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金不参与目标ETF的投资管理。	
业绩比较基准	中证高股息精选指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%	
风险收益特征	<p>本基金为ETF联接基金,通过投资于目标ETF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证券市场相似的风险收益特征。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>	

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]609号准予注册,由基金

管理人浦银安盛基金管理有限公司依照法律法规、《浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》等规定于2020年3月2日至2020年3月27日向社会公开发行人募集，基金合同于2020年4月1日生效。基金合同生效日的基金总份额为207,832,290.49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。

为顺应市场环境变化，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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》等法律法规的规定和《浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关约定，经与本基金托管人协商一致，提议终止《浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据管理人2023年1月13日公告的《关于浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于2023年1月12日表决通过了《关于终止浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》，本基金最后运作日为2023年1月15日，自2023年1月16日进入清算期。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表（经审计）

会计主体：浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2023年1月15日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2023年1月15日
资 产：	
货币资金	287,920.39
结算备付金	41,463.31
存出保证金	4,996.18
交易性金融资产	4,171,260.24

其中：基金投资	4,171,260.24
应收申购款	340.81
资产总计：	4,505,980.93
负债和净资产	最后运作日 2023年1月15日
负 债：	
应付赎回款	173.23
应付管理人报酬	53.48
应付托管费	10.69
应付销售服务费	83.06
应交税费	70.03
其他负债	110,000.07
负债合计	110,390.56
净资产：	
实收基金	3,480,813.66
未分配利润	914,776.71
净资产合计	4,395,590.37
负债和净资产总计	4,505,980.93

注 1、本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于基金最后运作日，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。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。

2、报告截止日 2023 年 1 月 15 日(基金最后运作日)，浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额总额 3,480,813.66 份，其中 A 类基金份额净值 1.2645 元，基金份额 2,969,476.64 份；C 类基金份额净值 1.2529 元，基金份额 511,337.02 份。

3、本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师赵钰、沈俐签字出具了普华永道中天特审字(2023)第 0451 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 清算情况

自 2023 年 1 月 16 日至 2023 年 3 月 28 日止（即清算期间），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。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 自 2023 年 1 月 16 日本基金进入清算程序起至 2023 年 3 月 21 日止期间，本基金银行存款、结算备付金及存出保证金产生的利息收入已经于 2023 年 3 月 21 日划入本基金托管账户；自 2023 年 3 月 22 日起至基金财产返还投资人前一日止期间，本基金银行存款的应收利息中未结息的部分将由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司先行垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归本基金的基金管理人所有，待实际结息资金到账后再归还本基金的基金管理人，与之前预估数所产生的误差也由本基金的基金管理人承担。

5.1.2 本基金 2023 年 1 月 15 日（基金最后运作日）存放于上海证券交易所的结算备付金 41,450.49 元已于 2023 年 2 月 8 日归还本基金的基金管理人。

5.1.3 本基金 2023 年 1 月 15 日（基金最后运作日）存放于上海证券交易所的存出保证金 4,991.72 元已于 2023 年 2 月 2 日归还本基金的基金管理人。

5.1.4 于 2023 年 1 月 15 日（基金最后运作日），本基金持有的交易性金融资产全部为目标 ETF 基金（浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金），市值为 4,171,260.24 元，均为上市流通份额。本基金持有的交易性金融资产已于 2023 年 1 月 16 日变现，收回金额合计人民币 4,213,134.39 元。

5.1.5 本基金最后运作日已确认的应收申购款 340.81 元，已于 2023 年 1 月 17 日前划入本基金托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日已确认的应付赎回款 173.23 元，已于 2023 年 1 月 18 日前支付。

5.2.2 于 2023 年 1 月 15 日（基金最后运作日），本基金已计提的应付管理人报酬 53.48 元、应付托管费 10.69 元和应付销售服务费 83.06 元，已于 2023 年 2

月2日支付。

5.2.3 本基金最后运作日已确认的应交税费 70.03 元，已于 2023 年 2 月 2 日支付。

5.2.4 本基金 2023 年 1 月 15 日(基金最后运作日)的其他负债为 110,000.07 元，该款项包括应付赎回费 0.07 元，预提审计费 50,000.00 元，预提清算律师费 15,000.00 元，预提持有人大会律师费 35,000.00 元，预提持有人大会公证费 10,000.00 元。其中，应付赎回费已于 2023 年 1 月 17 日支付，预提审计费中的 40,000.00 元已于 2023 年 1 月 31 日支付，预提持有人大会公证费已于 2023 年 1 月 31 日支付，剩余款项于本财务报表批准报出日(2023 年 3 月 28 日)后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2023年1月16日至2023年3月28日止清算期间
一、收入	45,881.32
1、利息收入	6,382.40
2、投资收益（损失以“-”填列）	118,322.59
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-78,858.34
4、其他收入	34.67
二、费用	115.14
1、税金及附加	115.14
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	45,766.18

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2023年1月15日基金净资产	4,395,590.37
加：清算期间净收益	45,766.18
加：清算期间收到申购款	754.30
减：清算期间支付赎回、转出款（含费用）	32,479.55
二、2023年3月28日基金净资产	4,409,631.30

根据本基金的基金合同的约定，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、缴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、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算财务报表及审计报告
- 2、国浩律师（上海）事务所关于浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算事宜之法律意见书

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.py-axa.com](http://www.py-axa.com)）、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。

浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金财产清算小组

清算报告出具日：2023年3月28日

清算报告公告日：2023年4月7日