

浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金清算报告

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

清算报告出具日：2023 年 4 月 06 日

清算报告送出日：2023 年 4 月 15 日

§ 1 重要提示

浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金（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[2021]2126 号《关于准予浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，于 2022 年 3 月 8 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《浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金管理人经与本基金托管人海通证券股份有限公司协商一致，提议终止《浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》并终止上市，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 31 日公告的《关于浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资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 30 日表决通过了《关于浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，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 31 日，自 2023 年 2 月 1 日进入清算期。

基金管理人浦银安盛基金管理有限公司、基金托管人海通证券股份有限公司、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 2 月 1 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	浦银安盛中华交易服务沪深港 300ETF
场内简称	红 300
基金主代码	517780
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 3 月 8 日

基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	海通证券股份有限公司
报告期末（2023 年 1 月 31 日） 基金份额总额	9,451,060.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 3 月 18 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。
投资策略	本基金以紧密跟踪标的指数，获取指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的条件下，构建指数化的投资组合。
业绩比较基准	中华交易服务沪深港 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。本基金投资港股通标的股票时，会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。

§ 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[2021]2126 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、《浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等规定于 2021 年 12 月 21 日至 2022 年 3 月 2 日向社会公开发行募集，基金合同于 2022 年 3 月 8 日生效。基金合同生效日的基金总份额为 243,451,060.00 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

中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关约定，经与本基金托管人协商一致，提议终止《浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》并终止上市，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 31 日公告的《关于浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资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 30 日表决通过了《关于浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，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 31 日，自 2023 年 2 月 1 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：浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 1 月 31 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2023 年 1 月 31 日
资 产：	
货币资金	702,444.18
结算备付金	19,175.96
存出保证金	33,432.94
交易性金融资产	9,485,783.21
其中：股票投资	9,485,783.21
应收股利	185.35
资产总计	10,241,021.64
负债和净资产	最后运作日 2023 年 1 月 31 日
负 债：	

应付清算款	1.00
应付管理人报酬	4,489.68
应付托管费	897.93
其他负债	223,444.69
负债合计	228,833.30
净资产：	
实收基金	9,451,060.00
未分配利润	561,128.34
净资产合计	10,012,188.34
负债和净资产总计	10,241,021.64

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》、《浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 31 日（基金最后运作日），浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值 1.0594 元，基金份额总额 9,451,060.00 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 0449 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 清算情况

本基金的本次清算期间为 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 4 月 6 日止。由于本基金持有处于停牌期股票，本基金将在其停牌状态解除完成变现后按照基金份额持有人的基金份额比例进行二次分配，二次分配的时间安排根据变现时间确定。

自 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 4 月 6 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手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日确认的应计活期存款利息 1,436.90 元及自 2023 年 2 月 1 日本基金

进入清算程序起至 2023 年 3 月 20 日止期间银行存款产生的利息收入，已经于 2023 年 3 月 21 日划入本基金托管账户；自 2023 年 3 月 21 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计利息中未结息的部分将于银行结息到账后再支付给投资者。

5.1.2 本基金 2023 年 1 月 31 日（基金最后运作日）的结算备付金为 19,175.96 元（含应计备付金利息 186.03 元），其中存放于上海证券交易所的结算备付金 4,746.57 元及存放于深圳证券交易所的结算备付金 14,243.36 元已于 2023 年 3 月 8 日归还本基金的基金管理人。基金最后运作日确认的结算备付金应计利息 186.03 元及自 2023 年 2 月 1 日本基金进入清算程序起至 2023 年 3 月 20 日止期间结算备付金产生的利息收入，已经于 2023 年 3 月 21 日划入本基金托管账户。自 2023 年 3 月 21 日起至基金财产返还投资人前一日止期间，本基金深港通备付金的应计利息中未结息的部分将于结息到账后再支付给投资者。

5.1.3 本基金 2023 年 1 月 31 日（基金最后运作日）的存出保证金为 33,432.94 元（含应计存出保证金利息 74.67 元），其中存放于上海证券交易所的存出保证金 22,969.64 元及存放于深圳证券交易所的存出保证金 10,388.63 元已于 2023 年 3 月 2 日归还本基金的基金管理人。基金最后运作日确认的存出保证金应计利息 74.67 元及自 2023 年 2 月 1 日本基金进入清算程序起至 2023 年 3 月 20 日止期间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。

5.1.4 于 2023 年 1 月 31 日（基金最后运作日），本基金持有的交易性金融资产全部为股票，股票市值为 9,485,783.21 元，其中上市流通股票为 9,469,642.65 元，长期停牌而无法卖出的股票为 16,140.56 元（最后运作日估值市值）。截至 2023 年 4 月 6 日（本财务报表批准报出日），剩余的交易性金融资产全部为长期停牌而无法卖出的股票投资，金额为 16,377.61 元（采用 2023 年 4 月 4 日的汇率），将在其停牌状态解除后及时变现，并二次向基金份额持有人分配。除因尚处于长期停牌而无法卖出的股票投资外，本基金持有的其他交易性金融资产已于 2023 年 3 月 28 日前卖出，收回金额合计人民币 9,481,694.27 元。

5.1.5 本基金最后运作日已确认的应收股利 185.35 元，已于 2023 年 3 月 3 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清算款 1.00 元，已于 2023 年 2 月 1 日划出本基金托管账户。

5.2.2 于 2023 年 1 月 31 日（基金最后运作日），本基金已计提的应付管理人报酬 4,489.68

元和应付托管费 897.93 元，已于 2023 年 2 月 2 日支付。

5.2.3 本基金 2023 年 1 月 31 日（基金最后运作日）的其他负债为 223,444.69 元，该款项包括应付交易费用 3,444.69 元，预提信息披露费 120,000.00 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。上述款项将于本财务报表批准报出日（2023 年 4 月 6 日）后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 4 月 6 日止清算期间
一、收入	33,530.99
1、利息收入	29,264.79
2、投资收益（损失以“-”填列）	747,821.73
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-743,555.53
二、费用	2,000.00
1、其他费用	2,000.00
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	31,530.99

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 31 日基金净资产	10,012,188.34
加：清算期间净收益	31,530.99
二、2023 年 4 月 6 日基金净资产	10,043,719.33

本基金于 2023 年 4 月 6 日剩余财产为 10,043,719.33 元，扣除清算结束日未变现资产，2023 年 4 月 6 日首次可供分配净资产为 10,019,496.85 元。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、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。由于本基金截至清算结束日（2023 年 4 月 6 日）仍持有未变现资产，故需进行二次清算。本基金将于上述未变现资产全部变现后进

入二次清算程序，并将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行二次分配。

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进行分配。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1、浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资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华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资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>)、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指定报刊上。

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。

浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金财产清算小组

清算报告出具日：2023 年 4 月 06 日

清算报告公告日：2023 年 4 月 15 日