

海富通中证长三角领先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:海富通基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

清算报告出具日期:二〇二三年三月十三日

清算报告公告日期:二〇二三年五月四日

§1 重要提示

海富通中证长三角领先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”)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]2905号文准予注册募集,《海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)于2020年08月17日正式生效。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

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《基金合同》的有关约定,基金管理人于2023年01月09日至2023年01月31日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,审议《关于海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金终止基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于2023年02月01日计票表决通过了《关于海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金终止基金合同有关事项的议案》,大会决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定,组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日定为2023年02月01日,并于2023年02月02日进入清算程序。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(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,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海市通力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	海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	海富通中证长三角领先ETF联接
基金主代码	008832
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年8月17日
基金最后运作日(2023年02月01日)基金份额总额	8,422,348.65份
投资目标	通过主要投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数即中证长三角领先指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标ETF,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。 为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF,其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股以及其他资产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。另外,本基金采用目标ETF投资策略、成份股、备选成份股投资策略、衍生品金融产品投资策略、债券投资策略、存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略等策略进行投资。
业绩比较基准	中证长三角领先指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*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,因此本基金的预期收益及预期风险水平与股票型基金相同,高于混合型基金、债券型基金、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表征的股票市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]2905号文准予注册募集,于2020年08月17日成立并正式运作,共募集269,118,300.93份基金份额。

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《基金合同》的有关约定,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。基金管理人已就上述情形拟定了终止基金合同的解决方案,经与基金托管人协商一致后,向中国证监会提出申请,并于2023年01月09日至2023年01月31日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会,于2023年02月01日计票表决通过了《关于海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金终止基金合同有关事项的议案》。

根据《基金合同》及相关公告规定,本基金的最后运作日确定为2023年02月01日,清算期间为2023年02月02日至2023年03月13日。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体:海富通中证长三角领先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02月01日

单位:人民币元

资产	基金最后运作日 2023年02月01日
资产:	
银行存款	580,348.35
结算备付金	8,805.32
存出保证金	5,505.29
交易性金融资产	7,623,664.63
其中:股票投资	
基金投资	7,623,664.63
债券投资	
资产支持证券投资	
贵金属投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收清算款	
应收股利	
应收申购款	1,552.02
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	8,219,875.61
负债和净资产	基金最后运作日 2023年02月01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	
应付管理人报酬	459.47
应付托管费	153.20
应付销售服务费	
应交税费	
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	55,000.00
负债合计	55,612.67
净资产:	
实收基金	8,422,348.65
未分配利润	-258,085.71
净资产合计	8,164,262.94
负债和净资产总计	8,219,875.61

注:本基金最后运作日2023年02月01日,基金份额净值0.9694元,基金份额总额8,422,348.65份。

4.2 利润表

会计主体:海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金
报告期间:2023年01月01日至2023年02月01日(基金最后运作日)

单位:人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年02月01日(基金最后运作日)
一、营业总收入	568,014.71
利息收入	2,785.04
其中:存款利息收入	1,233.02

债券利息收入	
资产支持证券利息收入	
申购款利息收入	1,552.02
其他利息收入	
投资收益(损失以“-”填列)	-622,281.29
其中:股票投资收益	
基金投资收益	-622,281.29
债券投资收益	
资产支持证券投资收益	
贵金属投资收益	
衍生工具收益	
股利收益	
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,165,766.73
汇兑收益(损失以“-”号填列)	
其他收入(损失以“-”号填列)	21,744.23
减:二、营业总支出	11,048.21
管理人报酬	459.47
托管费	153.20
销售服务费	
利息支出	
其中:卖出回购金融资产支出	
税金及附加	
其他费用	10,435.54
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	556,966.50
减:所得税费用	
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	556,966.50
五、其他综合收益的税后净额	
六、综合收益总额	556,966.50

注: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,注册会计师朱宏宇、胡莲莲签字出具了普华永道中天特审字(2023)第0564号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

本基金自2023年02月02日起进入清算程序,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。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下:

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金金额8,805.32元,其中存放于上海东证期货有限公司的备付金为8,786.84元,应计利息为18.48元。上海东证期货有限公司备付金账户于2023年03月09日销户结息,账户内剩余资金8,821.10元于当日划回托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额5,505.29元,其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所结算保证金为5,496.47元,应计利息为8.82元。根据中国证券登记结算有限责任公司结算规则,结算保证金在每月第二个工作日进行调整,截至本次清算期末,结算保证金及应计利息余额6,940.75元,将于清算期后陆续划回托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产市值为7,623,664.63元,为持有的目标ETF基金。目标ETF基金于2023年02月02日至2023年03月13日期间进行了基金财产清算,其终止清算款7,617,131.86元拟于2023年04月03日划入托管账户,交易性金融资产全部变现。

5.1.4 本基金最后运作日其他资产1,552.02元,为应收直销申购款利息,已于2023年03月23日划回托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金截止最后运作日的应付管理人报酬459.47元和应付托管费153.20元,分别于2023年02月02日、2023年03月02日支付完毕。

5.2.2 本基金截止最后运作日的其他负债55,000.00元为应付审计费用,已于2023年03月22日支付完毕。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	自2023年02月02日至2023年03月13日(本次清算期截止日)止
一、清算收益	

1、利息收入(注1)	254.30
2、公允价值变动损益(注2)	-7,870.81
清算收入小计	-7,616.51
二、清算费用	
1、银行汇划手续费	10.00
清算费用小计	10.00
三、清算净收益	-7,626.51

注:

(1)利息收入金额254.30元,系以当前适用的利率计提的自2023年02月02日至2023年03月13日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息。

(2)公允价值变动损益为持有的目标ETF基金清算期间份额净值变动损益。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位:人民币元

项目	金额
一、最后运作日2023年02月01日基金净资产	8,164,262.94
加:清算期间净收益	-7,626.51
二、2023年03月13日基金剩余资产净值	8,156,636.43

注:截至本次清算期结束日2023年03月13日,本基金剩余财产8,156,636.43元。本基金将于2023年04月03日收到目标ETF基金终止清算款,清算款与03月13日目标ETF基金公允价值7,615,793.82元的差额为1,338.04元。上述财产将根据本基金的《基金合同》约定,依据基金财产清算的分配方案,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2023年03月13日至清算款划出日前一日的银行存款、结算保证金产生的利息亦属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,基金管理人将先行垫付尚未收回的结算保证金、应计银行存款利息、应计结算保证金利息供清盘分配使用,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。

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

6.1 备查文件目录

1、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算审计报告

2、《上海市通力律师事务所关于〈海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告〉的法律意见》

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

海富通中证长三角领先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
二〇二三年三月十三日