

宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金清算报告

基金管理人：宏利基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年7月12日

清算报告公告日：2023年7月19日

目录

重要提示.....	2
一、基金概况.....	2
二、基金运作情况.....	3
三、财务会计报告.....	4
四、清算情况.....	5
五、备查文件.....	7

重要提示

宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金（基金原名：泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金，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】2110号予以注册，于2020年7月17日成立并正式运作。

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》和《宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，宏利基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）以通讯开会方式召开了本基金基金份额持有人大会（以下简称“本次基金份额持有人大会”、“本次持有人大会”或“会议”），本次持有人大会表决投票时间为2023年5月22日至2023年6月21日17:00止，会议审议了《关于终止泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”）。同意本次会议议案的基金份额符合《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》的相关规定以及《宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金基金合同》的约定，本次基金份额持有人大会于2023年6月26日表决通过了本次会议议案。本基金最后运作日为2023年6月27日。自本次基金份额持有人大会决议生效并公告后的下一日起，也即2023年6月28日起本基金进入清算程序。

本基金于2023年6月28日起进入清算期，由基金管理人宏利基金管理有限公司、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和北京观韬中茂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）对清算报告进行审计，北京观韬中茂律师事务所对清算报告出具法律意见。

一、基金概况

基金名称	宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金
基金简称	宏利中证绩优指数基金 A/宏利中证绩优指数基金 C
基金代码	009194/009195
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年7月17日

基金管理人	宏利基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
最后运作日	2023年6月27日
最后运作日基金份额总额	25,161,079.63份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对中证申万绩优策略指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，力争获取超越标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，在控制与比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中证申万绩优策略指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

二、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2019】2110号《关于准予泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册。由泰达宏利基金管理有限公司（注：2023年4月20日变更名称为宏利基金管理有限公司，并办理完成工商变更登记）于2020年4月28日起至2020年7月15日止期间向社会公开发行募集，基金合同于2020年7月17日生效，募集规模为275,202,622.69份基金份额。自2020年7月17日至2023年6月27日期间，本基金按基金合同正常运作。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》和《宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金基金合同》等有关规定，宏利基金管理有限公司以通讯开会方式召开了本基金基金份额持有人大会，本次持有人大会表决投票时间为2023年5月22日至2023年6月21日17:00止，会议审议了《关于终止泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。同意本次会议议案的基金份额符合《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》的相关规定以及《宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金基金合同》的约定，本次基金份额持有人大会于2023年6月26日表决通过了本次会议议案。本基金最后运作日为

2023年6月27日。自本次基金份额持有人大会决议生效并公告后的下一日起，也即2023年6月28日起本基金进入清算程序。

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023年6月27日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日
	2023年6月27日
资产：	
银行存款	2,359,961.29
结算备付金	131,590.50
存出保证金	7,352.47
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
应收证券清算款	16,767,351.98
应收申购款	64,448.24
资产总计	19,330,704.48
负债和所有者权益	最后运作日
	2023年6月27日
负债：	
应付赎回款	41,351.40
应付管理人报酬	20,592.09
应付托管费	2,059.19
应付销售服务费	3,853.18
其他负债	128,223.33
负债合计	196,079.19
所有者权益：	
实收基金	25,161,079.63
未分配利润	-6,026,454.34
所有者权益合计	19,134,625.29
负债和所有者权益总计	19,330,704.48

四、清算情况

自 2023 年 6 月 28 日至 2023 年 7 月 12 日止为本次清算期间，基金财产清算小组对本基金的基金财产进行清算，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：

（一）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，包括支付给律师事务所的费用，分配基金剩余财产的银行汇划费等，根据基金合同的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（二）资产清算情况

截至本次清算期结束日（2023 年 7 月 12 日），部分资产尚未收回。根据 2023 年 6 月 26 日本基金基金份额持有人大会表决通过的《关于终止泰达宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金基金合同有关事项的议案》约定，为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金对未到账的存出保证金、应收利息进行垫付。各项资产清算情况如下：

- 1、 本基金最后运作日银行存款为人民币 2,359,961.29 元，其中本金为人民币 2,359,951.29 元，应计利息为人民币 10.00 元。
- 2、 本基金最后运作日结算备付金为人民币 131,590.50 元，其中上海结算备付金为人民币 79,829.91 元，包含本金人民币 79,808.37 元、应计利息人民币 21.54 元，上海结算备付金全部本金人民币 79,808.37 元已于 2023 年 7 月 10 日划入托管账户。深圳结算备付金为人民币 51,760.59 元，包含本金人民币 51,746.61 元、应计利息人民币 13.98 元，深圳结算备付金全部本金人民币 51,746.61 元已于 2023 年 7 月 10 日划入托管账户。
- 3、 本基金最后运作日存出保证金为人民币 7,352.47 元，其中上海存出保证金为人民币 4,288.09 元，包含本金人民币 4,286.95 元、应计利息人民币 1.14 元，上海存出保证金全部本金人民币 4,286.95 元已于 2023 年 7 月 4 日划入托管账户。深圳存出保证金为人民币 3,064.38 元，包含本金人民币 3,063.54 元、应计利息人民币 0.84 元，深圳存出保证金全部本金人民币 3,063.54 元已于 2023 年 7 月 4 日划入托管账户。
- 4、 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 16,767,351.98 元，该款项已于 2023 年 6 月 28 日划入托管账户。

5、 本基金最后运作日应收申购款为人民币 64,448.24 元，该款项已于 6 月 28 日划入托管账户。

（三）负债清偿情况

1、 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 41,351.40 元，该款项已于 6 月 28 日支付。

2、 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 20,592.09 元，该款项已于 2023 年 7 月 5 日支付。

3、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,059.19 元，该款项已于 2023 年 7 月 5 日支付。

4、 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 3,853.18 元，该款项已于 2023 年 7 月 5 日支付。

5、 本基金最后运作日其他负债为人民币 128,223.33 元，包括预提审计费、预提信息披露费、应付赎回费、应付交易费用和应付指数使用费。本基金最后运作日预提审计费为人民币 19,507.02 元，已于 2023 年 7 月 10 日支付。本基金最后运作日预提信息披露费为人民币 24,384.22 元，已于 2023 年 7 月 10 日支付。本基金最后运作日应付赎回费为人民币 472.12 元，已于 2023 年 6 月 28 日支付。本基金最后运作日应付交易费用为人民币 82,778.59 元，已于 2023 年 7 月 5 日支付。本基金最后运作日应付指数使用费为人民币 1,081.38 元，已于 2023 年 7 月 5 日支付。

（四）本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2023 年 6 月 28 日至 2023 年 7 月 12 日止 清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	2,215.17
2、其他收入（注 2）	451.02
3、股利收入（注 3）	-28,036.81
清算期间收入小计	-25,370.62
二、清算期间费用	
1、律师费	-10,000.00
2、其他清算期间费用（注 4）	-346.68
清算期间费用小计	-10,346.68
三、清算期间净收益	-35,717.30

注：

- (1) 利息收入为自 2023 年 6 月 28 日至 2023 年 7 月 12 日止清算期间的银行存款、结算备付金、存出保证金利息收入。
- (2) 其他收入为赎回费、补差费收入。
- (3) 股利收入为自 2023 年 6 月 28 日至 2023 年 7 月 12 日止清算期间扣减的股息红利税款。
- (4) 其他清算期间费用为银行汇划费。

(五) 截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 6 月 27 日基金净资产	19,134,625.29
加：清算期间净收益	-35,717.30
加：基金申购金额（于 2023 年 6 月 28 日确认的投资者申购申请）	7,425.84
减：基金赎回金额（于 2023 年 6 月 28 日确认的投资者赎回申请）	3,841,810.24
二、2023 年 7 月 12 日基金净资产	15,264,523.59

截至本次清算期结束日 2023 年 7 月 12 日，本基金剩余财产为人民币 15,264,523.59 元。自本次清算期结束日次日即 2023 年 7 月 13 日起至本次清算款划出前一日止期间的银行存款产生的利息亦归基金份额持有人所有。

本基金所有剩余财产将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

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。

五、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、《宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《北京观韬中茂律师事务所关于〈宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

(二) 存放地点备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

(三) 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件

宏利中证申万绩优策略指数增强型证券投资基金

基金财产清算小组

2023年7月12日