

# 华润元大价值优选混合型发起式证券投资 基金清算报告

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二三年九月十二日

清算报告公告日：二〇二三年九月十五日

## 目录

重要提示.....	3
一、基金概况.....	3
二、基金运作情况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清算情况.....	6
五、备查文件.....	8

## 重要提示

华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经2018年7月12日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2018】1102号文准予募集注册，由华润元大基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）作为基金管理人向社会公开发行募集，基金合同于2020年7月24日正式生效。本基金基金管理人为华润元大基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》、《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，基金合同生效之日起三年后的对应自然日，若基金资产规模低于2亿元，基金合同应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。本基金已于2023年7月24日日终触发基金合同约定的终止事由，基金管理人应当在上述事由出现后终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日定为2023年7月24日，并于2023年7月25日进入清算程序。

本基金清算期自2023年7月25日至2023年9月11日止。本基金的基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所成立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）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

### 一、基金概况

基金名称	华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金
基金简称	华润元大价值优选
基金主代码	004930
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年7月24日
基金管理人名称	华润元大基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
公告依据	《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》等相关法律法规以及《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》、《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金招募说明书》
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司
基金合同存续期	不定期
投资目标	本基金进行深入的个股/个券挖掘，积极优选具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金具有前瞻性的宏观策略分析，自上而下分析与自下而上选股相结合，进行深入的个股/个券挖掘。本基金以价值投资理念为核心，根据中国股票市场的投资特点进行改良应用。首先根据不同的经济周期及市场趋势研判，决定本基金的大类资产配置以及行业偏离决策；其次在个股选择上，通过深入研究寻找优质企业，运用估值方法估算其内在投资价值，并根据国内市场的特殊性及波动性，综合考虑可能影响企业投资价值以及市场价格的所有因素，发现具备投资价值的个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中债总指数(全价)收益率×15%+恒生指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金。本基金将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

## 二、基金运作情况

本基金经2018年7月12日中国证监会证监许可【2018】1102号文准予募集注册，自2020年6月22日至2020年7月21日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为3930户，募集资金及其产生的利息共计81,642,582.59元，折合基金份额81,642,582.59份。华润元大基金管理有限公司向中国证监会办理完毕基金备案手续后，于2020年7月24日获书面确认，《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金基金合同》自该日起正式生效。

根据基金合同“第五部分 基金备案”“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中约定：“基金合同生效之日起三年后的对应自然日，若基金资产规模低于2亿元，基金合同应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”

本基金基金合同生效日为2020年7月24日。基金合同生效之日起三年后的对应自然日为2023年7月24日。根据上述约定，截至2023年7月24日日终，本基金的基金资产规模低于2亿元，已触发基金合同终止事由，将根据基金合同规定进入基金财产清算程序并终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会。

本基金管理人在上述事由出现后依法履行了基金财产清算程序。本基金的最后运作日为2023年7月24日，并于2023年7月25日进入清算程序。

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。

### 三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年7月24日

单位：人民币元

	最后运作日 2023年7月24日
<b>资产：</b>	
银行存款	9,751,334.06
结算备付金	219,810.90
存出保证金	39,486.71
交易性金融资产	38,181,291.58
其中：股票投资	38,181,291.58
资产总计	48,191,923.25
<b>负债：</b>	
应付清算款	1,660.40
应付赎回款	1,627,672.71
应付管理人报酬	61,391.11
应付托管费	10,231.87
应付销售服务费	22,443.50
其他负债	35,023.56
负债合计	1,758,423.15
<b>净资产：</b>	
实收基金	51,924,974.89
未分配利润	-5,491,474.79
净资产合计	46,433,500.10
负债和净资产总计	48,191,923.25

注：基金最后运作日2023年7月24日，基金份额总额51,924,974.89份，其中华润

元大价值优选A类基金份额净值人民币0.9083元，份额总额18,070,391.65份；华润元大价值优选C类基金份额净值人民币0.8867元，份额总额33,854,583.24份。

#### 四、清算情况

自2023年7月25日至2023年9月11日止的清算期间，本基金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：

##### 1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币9,751,334.06元，其中本金人民币9,745,886.79元，应计利息人民币5,447.27元。基金管理人于清算结束后以自有资金垫付银行存款应计利息款项。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币219,810.90元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金本金人民币219,617.90元，应计利息人民币193.00元。中国证券登记结算有限责任公司每月初第6个交易日对结算备付金进行调整，上述结算备付金本金已于2023年8月8日及2023年9月8日划入本基金托管账户。本基金的基金管理人于清算结束后以自有资金垫付结算备付金应计利息款项。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币39,486.71元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金本金人民币39,428.40元，应计利息人民币58.31元。中国证券登记结算有限责任公司每月初第2个交易日对存出保证金进行调整，上述存出保证金本金已于2023年8月2日划入本基金托管账户。本基金的基金管理人于清算结束后以自有资金垫付存出保证金应计利息款项。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币38,181,291.58元，均为上市流通的股票投资。截至清算结束日，股票投资均已处置变现，实际变现金额为人民币33,539,028.42元。

##### 2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付清算款为人民币1,660.40元，为卖出股票应交而尚未交收的红利税补缴清算款，该款项已于2023年7月25日清算交收。

(2) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1,627,672.71 元,于清算期间确认应付赎回款人民币 1,063,337.88 元。上述款项已于 2023 年 7 月 27 日前(含当日)支付。

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 61,391.11 元该款项已于 2023 年 8 月 2 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 10,231.87 元。该款项已于 2023 年 8 月 2 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 22,443.50 元。该款项已于 2023 年 8 月 2 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 35,023.56 元。其中应付交易佣金人民币 21,016.43 元,预提审计费人民币 14,000.00 元,应付赎回费人民币 7.13 元。上述款项已于 2023 年 8 月 31 日前(含当日)支付。

### 3、清算期间的清算损益情况

项目	单位：人民币元
	自2023年7月25日至 2023年9月11日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	10,521.84
2、投资收益(损失以“-”填列) (注2)	-321,477.33
3、公允价值变动损益(注3)	-4,357,295.29
4、其他收入(注4)	491.15
清算收益小计(损失以“-”填列)	-4,667,759.63
二、清算支出	
1、其他费用(注5)	20,058.00
清算支出小计	20,058.00
三、清算净收益(损失以“-”填列)	-4,687,817.63

注 1: 利息收入系清算期间计提的银行存款利息收入、结算备付金利息收入及存出保证金利息收入。

注 2: 投资收益系清算期间股票差价收入扣除红利补税款及交易费用后的净额。

注 3: 公允价值变动损益系清算期间股票投资处置结转的公允价值变动损益。

注 4：其他收入系清算期间赎回费收入。

注 5：其他费用系清算期间确认的银行汇划费及清算律师费。

#### 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7月24日基金净资产	46,433,500.10
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-4,687,817.63
清算期间从持有人权益转出（注）	-1,063,833.48
二、清算结束日2023年9月11日基金净资产	40,681,848.99

注：清算期间从持有人权益转出系本基金份额持有人于最后运作日 2023 年 7 月 24 日提交的赎回申请，已于 2023 年 7 月 27 日支付基金赎回款及赎回费。

本基金于清算结束日剩余财产为人民币40,681,848.99元。根据本基金的《基金合同》的约定，依据基金财产清算的分配方案，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。

清算结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金及存出保证金产生的利息归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，于清算划款日的应收利息余额将由基金管理人以自有资金先行垫付（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），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。垫付资金及孳生的利息（以实际结息金额为准）将于清算期后返还给基金管理人。

#### 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。

### 五、备查文件

#### （一）备查文件目录

- 1、《华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于〈华润元大价值优选混合型发起式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。

华润元大价值优选混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二三年九月十二日