

浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)第二次清算报告

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
清算报告出具日:2023年09月27日
清算报告送出日:2023年10月13日

§1 重要提示

浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)(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[2017]113号《关于准予浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)注册的批复》准予注册,于2017年4月27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《浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关约定,本基金管理人经与本基金托管人招商证券股份有限公司协商一致,提议终止《浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)基金合同》并终止上市,并召开基金份额持有人大会审议通过上述事项。根据管理人2022年12月27日公告的《关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)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2022年12月26日表决通过了《关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)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2022年12月27日,自2022年12月28日起进入清算期。

基金管理人浦银安盛基金管理有限公司、基金托管人招商证券股份有限公司、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2022年12月28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。

本基金第一次清算期间为2022年12月29日至2023年1月18日,本基金的基金管理人于2023年2月2日对《浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)清算报告》进行了公告,并于2023年2月6日支付了首笔清算款。本基金于2023年1月19日进入第二次清算期间,本次清算期间为2023年1月19日至2023年9月8日。

§2 基金产品概况

基金名称	浦银安盛中证锐联沪港深LOF
场内简称	基金LOF
基金代码	106402
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2017年4月27日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
二次清算截止日(2023年9月8日)基金份额总额	15,497,209份
基金存续期限	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年6月6日
投资目标	本基金采用被动式投资策略,紧密跟踪中证锐联沪港深基本面100指数,在正常市场条件下,力争基金净值增长率与业绩比较基准(中证锐联沪港深基本面100指数收益率)的日均超额收益不超过0.5%。
投资策略	本基金以跟踪标的指数的跟踪误差长期稳定的投资策略,在降低跟踪误差和控制波动风险的前提下,构建和优化投资组合。
业绩比较基准	中证锐联沪港深基本面100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,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,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。本基金投资港股通标的股票,需承担汇率波动及境外市场波动带来的风险。

§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[2017]113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、《浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)基金合同》等规定于2017年3月22日至2017年4月21日向社会公开发行募集,基金合同于2017年4月27日生效。基金合同生效日的基金份额为344,633,224.70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《浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)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《浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)基金合同》并终止上市,并召开基金份额持有人大会审议通过上述事项。根据管理人2022年12月27日公告的《关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)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2022年12月26日表决通过了《关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)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2022年12月27日,自2022年12月28日起进入清算期。

第一次清算期间为自2022年12月29日至2023年1月18日止期间。因本基金第一次清算结束日所持交易性金融资产为停牌股票,本基金于2023年1月19日起进入第二次清算期间,截至2023年9月8日(基金第二次清算结束日)止,本基金持有的交易性金融资产已全部出售变现。

§4 财务报告

4.1 资产负债表(经审计)

会计主体:浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)
报告截止日:2023年9月8日(第二次清算结束日)

单位:人民币元

资产	第二次清算结束日 2023年9月8日
资产:	
货币资金	140,074.96
结算备付金	0.21
存出保证金	0.01
交易性金融资产	-
其中:股票投资	-
应收清算款	-
应收股利	-
资产合计	140,075.18
负债和净资产	第二次清算结束日 2023年9月8日
负债:	
应付赎回款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	-
其他负债	110,009.96
负债合计	110,009.96
净资产:	
实收基金	15,497.21
未分配利润	14,877.82
净资产合计	30,375.03
负债和净资产合计	140,075.18

§5 清算情况

本基金的本次清算期间为2023年1月19日至2023年9月8日。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

本基金2023年9月8日(基金第二次清算结束日)确认的应计活期存款利息411.88元及自2023年9月9日(基金第二次清算结束日)次日起至2023年9月20日止期间银行存款产生的利息收入,已于2023年9月21日划入本基金托管账户。2023年9月21日起受基金财产清偿投资(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。

5.2 负债清偿情况

本基金2023年9月8日(基金第二次清算结束日)确认的其他负债为110,009.96元,包括计提上市费60,000.00元、预提中证报告信息披露费50,000.00元,应付佣金9.96元。其中应付佣金已于2023年9月11日支付,其他款项均于本财务报表批准报出日(2023年9月27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1月19日至2023年9月8日止清算期间
一、收入	12,062.32
1.利息收入	8,572.97
2.投资收益(损失以“-”填列)	-136,521.76
3.公允价值变动损益(损失以“-”填列)	129,000.10
二、费用	-1,946.00
1.其他费用	-1,946.00
三、清算期间净收益(损失以“-”填列)	14,000.32

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、首次清算结束日2023年1月18日基金净资产	30,573,826.32
二、清算期间净收益	14,000.32
减:首次清算实际付款(2023年2月6日)	30,559,766.32
二、第二次清算结束日2023年9月8日基金净资产	30,375.03

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、应交纳相关税费并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。自本次清算结束日次日起至清算款项支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有,后续产生的各类划付手续费由基金份额持有人承担。为保护基金份额持有人利益,加快清偿速度,基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。该金额可能与实际结息金额存在细微差异,供清算分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金份额持有人。

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

1.浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)2022年12月28日(基金最后运作日)至2023年9月8日(基金第二次清算结束日)止期间的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锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)第二次清算事宜之法律意见书

6.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的办公场所。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金(LOF)基金财产清算小组
清算报告出具日:2023年09月27日
清算报告送出日:2023年10月13日