

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
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：海通证券股份有限公司

清算报告出具日：2023 年 09 月 27 日

清算报告送出日：2023 年 10 月 14 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。

本基金第一次清算期间为 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 4 月 6 日。本基金的基金管理人于 2023 年 4 月 15 日对《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》进行了公告，并于 2023 年 4 月 21 日支付了首笔清算款。本基金于 2023 年 4 月 7 日进入第二次清算期间，本次清算期间为 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日。

§ 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
二次清算截止日（2023 年 9 月 8 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前提下，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。

第一次清算期间为自 2023 年 2 月 1 日至 2023 年 4 月 6 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期股票，本基金于 2023 年 4 月 7 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 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	68,843.57

结算备付金	1.39
存出保证金	0.04
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
应收股利	-
资产总计	68,845.00
负债和净资产	第二次清算结束日 2023年9月8日
负 债：	
应付清算款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	-
其他负债	2,000.00
负债合计	2,000.00
净资产：	
实收基金	9,451,060.00
未分配利润	-9,384,215.00
净资产合计	66,845.00
负债和净资产总计	68,845.00

§ 5 清算情况

本基金的本次清算期间为 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日止。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 639.03 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，已经于 2023 年 9 月 21 日划入本基金托管账户。自 2023 年 9 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 2,000.00 元，该款项为预提银行汇款费，将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 4 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日止清算期间
一、收入	42,667.03
1、利息收入	6,880.25
2、投资收益（损失以“-”填列）	-52,320.71
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	88,107.49
二、费用	-
1、其他费用	-
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	42,667.03

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 4 月 6 日基金净资产	10,043,719.33
加：清算期间净收益	42,667.03
减：首次清算实际划付款（2023 年 4 月 21 日）	10,019,541.36
二、2023 年 9 月 8 日基金净资产	66,845.00

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。自本次清算期结束日次日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，加快清盘速度，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略微差异），供清盘分配使用。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管理人。

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析。

§ 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 2023 年 2 月 1 日（基金最后运作日次日）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华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金第二次清算事宜之法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和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 09 月 27 日

清算报告公告日：2023 年 10 月 14 日