

摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指 数证券投资基金 清算报告

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二四年七月二十六日

报告公告日期：二〇二四年八月十二日

一、重要提示

摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金（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[2021]1336 号文《关于准予上投摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，于 2021 年 11 月 22 日成立并正式运作，基金托管人为中国银行股份有限公司。自 2023 年 4 月 12 日起，本基金由“上投摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金”变更为“摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金”。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，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》和《摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议本基金终止上市并终止《基金合同》，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 2024 年 7 月 5 日公告的《关于摩根中证沪港深科技 100 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已于 2024 年 7 月 3 日表决通过了《关于摩根中证沪港深科技 100 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》，本次大会决议自该日起生效。本基金最后运作日为 2024 年 7 月 5 日，自 2024 年 7 月 6 日进入清算期。

基金管理人摩根基金管理（中国）有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2024 年 7 月 6 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，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金基本情况

1、基金名称：摩根中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金（场内简称：科技AH；扩位简称：科技AHETF；基金代码：517960）

- 2、基金运作方式：交易型开放式
- 3、基金合同生效日：2021年11月22日
- 4、2024年7月5日基金份额总额：58,182,000.00份
- 5、投资目标：本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
- 6、标的指数：中证沪港深科技100指数
- 7、投资策略：本基金采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况（如港股通额度受限等）导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。
- 8、业绩比较基准：中证沪港深科技100指数收益率。
- 9、风险收益特征：本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还可投资港股通标的股票，还需承担汇率风险和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。
- 10、基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司
- 11、基金托管人：中国银行股份有限公司
- 12、基金份额上市的证券交易所：上海证券交易所
- 13、上市日期：2021年12月23日

三、基金运作情况概述

本基金根据中国证监会证监许可[2021]1336号文准予注册，自2021年10月12日起向

全社会公开募集，并于2021年11月12日募集工作顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为202,182,000.00元人民币，折合基金份额202,182,000.00份。经中国证监会备案，本基金的基金合同于2021年11月22日生效。自2023年4月12日起，本基金由“上投摩根中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金”变更为“摩根中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金”。

自基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，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》和《基金合同》的有关规定，本基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，提议本基金终止上市并终止《基金合同》，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2024年7月5日公告的《关于摩根中证沪港深科技100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已于2024年7月3日表决通过了《关于摩根中证沪港深科技100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》，本次大会决议自该日起生效。本基金最后运作日为2024年7月5日，自2024年7月6日进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 7 月 5 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 7 月 5 日 (基金最后运作日)	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产:		
货币资金	4,061,588.75	5,282,868.81
结算备付金	512.35	-
存出保证金	3,163.29	29,491.73
交易性金融资产	194,422.21	64,981,907.54
其中：股票投资	91,883.04	64,981,907.54
其他投资	102,539.17	-
应收股利	110,678.29	7,193.26
应收清算款	42,085,995.92	-
资产总计	46,456,360.81	70,301,461.34
负债和所有者权益		
负 债:		
应付清算款	-	7.09
应付管理人报酬	1,888.86	17,612.14
应付托管费	629.62	5,870.73
其他负债	179,446.09	398,006.18
负债合计	181,964.57	421,496.14
所有者权益:		
实收基金	58,182,000.00	88,182,000.00
未分配利润	-11,907,603.76	-18,302,034.80
所有者权益合计	46,274,396.24	69,879,965.20

负债和所有者权益总计	46,456,360.81	70,301,461.34
------------	---------------	---------------

注：

1. 报告截止日 2024 年 7 月 5 日(基金最后运作日)，基金份额净值 0.7953 元，基金份额总额 58,182,000.00 份。

2. 财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 7 月 5 日(基金最后运作日)。

五、清算情况

自 2024 年 7 月 6 日至 2024 年 7 月 26 日止清算期间，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：

1、资产处置情况

(1)自最后运作日(2024 年 7 月 5 日)后至基金财产返还投资人前一日止期间本基金由货币资金、结算备付金和存出保证金产生的利息收入将由基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司先行垫付，管理人垫付资金孳生的利息归管理人所有。托管账户销户后将由托管人退还基金管理人，与之前预估数所产生的差异也由基金管理人享有/承担。

(2)本基金最后运作日(2024 年 7 月 5 日)持有的交易性金融资产，已分别于 2024 年 7 月 9 日、2024 年 7 月 16 日和 2024 年 7 月 23 日卖出。

(3)本基金最后运作日(2024 年 7 月 5 日)确认的应收股利 110,678.29 元，其中 20,367.40 元已于 2024 年 7 月 9 日、2024 年 7 月 10 日、2024 年 7 月 11 日、2024 年 7 月 16 日、2024 年 7 月 17 日、2024 年 7 月 23 日、2024 年 7 月 26 日收回，资金划出日前一日剩余未收回部分将由基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司先行垫付，管理人垫付资金与之前预估数所产生的差异由基金管理人享有/承担。

(4)本基金最后运作日(2024年7月5日)确认的应收清算款42,085,995.92元，已分别于2024年7月8日和2024年7月9日收回。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日(2024 年 7 月 5 日)应付管理人报酬为人民币 1,888.86 元, 该款项已于 2024 年 7 月 16 日支付。

(2) 本基金最后运作日(2024年7月5日)应付托管费为人民币629.62元, 该款项已于2024年7月16日支付。

(3) 本基金最后运作日(2024年7月5日)确认的其他负债为人民币179,446.09元, 包括应付审计费20,000.00元, 应付信息披露费153,661.32元, 应付交易费用5,784.77元, 该款项已于2024年7月24日支付。

3、清算期的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	自2024年7月6日至2024年7月26日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入-银行存款利息收入(注1)	9,287.83
2、投资收益(注2)	-62,333.63
3、公允价值变动损益	23,052.23
清算收益小计	-29,993.57
二、清算费用	
银行划款手续费	120.00
三、清算净收益	-30,113.57

注1: 利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2024年7月6日至2024年7月26日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2: 投资收益为清算期间卖出金额与最后运作日估值金额、因卖出股票所产生的补缴股息红利税金额以及外币红利实际到账汇兑的差额。

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2024年7月5日基金净资产	46,274,396.24
加：清算期间净收益	-30,113.57
二、2024年7月26日基金净资产	46,244,282.67

资产处置及负债清偿后，2024年7月26日本基金剩余财产为人民币46,244,282.67元，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，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。

自本次清算结束日2024年7月26日的次日至本次清算款划出前一日的银行存款产生的利息以及已收回的应收股利亦归基金份额持有人所有。为便于及时向基金份额持有人分配剩余资产，基金管理人摩根基金管理（中国）有限公司以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息、未收回的应收股利等。基金管理人所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，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

本基金的银行存款应收利息、结算备付金利息、存出保证金利息及未收回的应收股利为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中基金管理人垫付资金与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

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。

六、备查文件目录

1.备查文件目录

(1) 摩根中证沪港深科技100交易型开放式指数证券投资基金清算财务报表及审计报告

(2) 《摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金清算报告》的法律意见

2.存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

3.查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金财产清算小组

2024年8月12日