

汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式
证券投资基金清算报告

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二四年十月十一日

报告公告日期：二〇二四年十一月八日

目 录

一、重要提示	1
二、基金概况	2
三、基金运作情况概述	4
四、财务会计报告	5
五、清算情况	6
六、备查文件	9

一、重要提示

汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金（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”）2021年6月28日证监许可【2021】2238号文准予注册后募集，于2021年9月29日成立并正式运作，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》、《汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，本基金已触发基金合同终止情形，将根据基金合同约定进入基金财产清算程序并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。

根据基金管理人于2024年9月30日发布的《关于汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金进入清算期及终止基金合同的公告》，本基金自2024年9月30日起进入基金财产清算程序，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2024年9月30日组成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、基金概况

基金名称	汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金
基金简称	汇添富中证沪港深科技龙头指数发起式
基金代码	A 类份额基金代码：013093，C 类份额基金代码：013094
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2021 年 9 月 29 日
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
最后运作日（2024 年 9 月 29 日）基金份额总额	15,049,991.21 份
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的最小化。
主要投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。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%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资投资策略、参与转融通证券出借业务策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深科技龙头指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票，将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。</p>
--------	---

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会 2021 年 6 月 28 日证监许可【2021】2238 号文准予注册后募集，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司于 2021 年 9 月 22 日至 2021 年 9 月 27 日向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 9 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 14,027,066.50 份（含募集期间利息结转的份额）。自 2021 年 9 月 29 日至 2024 年 9 月 29 日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据基金合同“第五部分 基金备案”中“四、基金的自动终止”的约定：

“基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于 2 亿元人民币的，本基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

本基金的基金合同生效日为 2021 年 9 月 29 日，基金合同生效之日起三年后的对应日为 2024 年 9 月 29 日。截至 2024 年 9 月 29 日日终，本基金的基金资产净值低于 2 亿元，本基金已触发基金合同终止的上述情形，将根据基金合同约定进入基金财产清算程序并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。

根据基金管理人于 2024 年 9 月 30 日发布的《关于汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金进入清算期及终止基金合同的公告》，本基金自 2024 年 9 月 30 日起进入基金财产清算程序。

四、财务会计报告

1、基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年9月29日（本基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024年9月29日
资产：	
银行存款	725,300.48
结算备付金	37.06
存出保证金	5,515.45
交易性金融资产	10,181,147.69
其中：股票投资	10,181,147.69
应收清算款	405,612.25
应收股利	744.47
资产总计	11,318,357.40
负债和净资产	最后运作日 2024年9月29日
负债：	
应付赎回款	343,647.04
应付管理人报酬	5,107.26
应付托管费	1,021.47
应付销售服务费	657.24
其他负债	662.35
负债合计	351,095.36
净资产：	
实收基金	15,049,991.21
未分配利润	-4,082,729.17
净资产合计	10,967,262.04
负债和净资产总计	11,318,357.40

注：本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《资产管理产品相关会计处理规定》等有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无可比期间的相关数据列示。

五、清算情况

本基金的清算期间为自 2024 年 9 月 30 日至 2024 年 10 月 11 日。基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序对本基金的资产、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、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。按照《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。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的清算审计费、清算律师费由基金管理人承担。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 725,300.48 元，其中托管户存款为人民币 725,062.07 元，应计银行存款利息为人民币 238.41 元，应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 37.06 元，其中应计结算备付金利息为人民币 37.06 元，上述款项将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 5,515.45 元，其中存放于中国证券登记结算有限公司的存出保证金为人民币 5,513.20 元，该款项已于 2024 年 10 月 9 日划入托管账户；应计存出保证金利息为人民币 2.25 元，应计存出保证金利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 10,181,147.69 元，均为股票投资，于清算期间进行处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 10,843,653.93 元，已于清算期间划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 405,612.25 元，该款项已于清算期间划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收股利为人民币 744.47 元，已于 2024 年 10 月 9 日收

到人民币 741.09 元，并划入基金托管户；差额系汇兑损益，已于 2024 年 10 月 9 日对股利收入进行冲销。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款 343,647.04 元，该款项已于清算期间完成支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 5,107.26 元，该款项已于 2024 年 10 月 9 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,021.47 元，该款项已于 2024 年 10 月 9 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 657.24 元，该款项已于 2024 年 10 月 9 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 662.35 元，系应付交易佣金，该款项已于 2024 年 10 月 9 日支付。

4、清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	自 2024 年 9 月 30 日至 2024 年 10 月 11 日止 清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	669.11
2、投资收益	-491,991.82
3、公允价值变动收益	1,149,679.52
清算收益小计	658,356.81
二、清算支出（注 2）	
1、其他费用（注 3）	54.44
清算支出小计	54.44
三、清算净收益	658,302.37

注 1：利息收入系自 2024 年 9 月 30 日起至 2024 年 10 月 11 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。

注 2：考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的清算审计费、清算律师费由基金管理人承担。

注 3：其他费用系自 2024 年 9 月 30 日起至 2024 年 10 月 11 日止清算期间的银行存款汇划手续费及证券组合费。

5、剩余资产分配情况说明

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 9 月 29 日基金净资产	10,967,262.04
加：清算期间净收益	658,302.37
减：基金净赎回金额（于 2024 年 9 月 30 日确认的投资者赎回申请）	114,818.81
二、清算结束日 2024 年 10 月 11 日基金净资产	11,510,745.60

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2024 年 10 月 11 日，本基金剩余财产为人民币 11,510,745.60 元。根据本基金的基金合同，本基金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。

自本次清算期起始日 2024 年 9 月 30 日至清算款划出前一日产生的银行存款、结算备付金、存出保证金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投资者承担。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，该部分利息将由基金管理人以自有资金垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

6、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，报上海证监局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分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金清算审计报告
- (2) 《上海源泰律师事务所关于汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二四年十月十一日