

华泰柏瑞基金管理有限公司  
华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证  
券投资基金联接基金  
清算报告

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2022年11月30日

清算报告公告日：2022年12月9日

# 华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接 基金 清算报告

## 一、重要提示

华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）根据 2010 年 11 月 3 日中国证券监督管理委员会《关于核准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可【2010】1535 号）核准募集。《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》自 2011 年 1 月 26 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，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《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，提议终止《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。

本基金基金份额持有人大会以现场开会方式召开，本次会议召开时间为 2022 年 11 月 18 日上午 11 点。本次大会审议了《关于华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金终止基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

本次基金份额持有人大会决议生效后，根据基金份额持有人大会表决通过的议案及方案说明，本基金于 2022 年 11 月 21 日进入清算期。基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司、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 2022 年 11 月 21 日成立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）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## 二、基金概况

基金名称	华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接
基金代码	460220
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 日
最后运作日 (2022-11-18) 基金份额总额	7,054,142.95 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金。华泰柏瑞上证中小盘 ETF 是采用完全复制法实现对上证中小盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于华泰柏瑞上证中小盘 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式对华泰柏瑞上证中小盘 ETF 进行投资。
业绩比较基准	上证中小盘指数×95% + 银行活期存款税后收益率×5%
风险收益特征	本基金为华泰柏瑞上证中小盘 ETF 的联接基金，采用主要投资于上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与上证中小盘指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### 三、基金运作情况

华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金经 2010 年 11 月 3 日中国证券监督管理委员会《关于核准上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可【2010】1535 号）核准募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2010 年 12 月 20 日至 2011 年 1 月 18 日期间向社会公开募集，基金合同于 2011 年 1 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 482,562,901.50 份。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，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《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，提议终止《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。本基金基金份额持有人大会以现场开会方式召开，本次会议召开时间为 2022 年 11 月 18 日上午 11 点。本次大会审议了《关于华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金终止基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。

本次基金份额持有人大会决议生效后，根据基金份额持有人大会表决通过的议案及方案说明，本基金于 2022 年 11 月 21 日进入清算期。

## 四、财务会计报告

### 1、资产负债表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2022年11月18日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年11月18日 (基金最后运作日)	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	5	689,637.24	651,609.59
结算备付金	6	182,452.44	831.19
存出保证金		334.28	171.03
交易性金融资产	7	8,669,427.07	11,351,019.34
其中：股票投资		2,452,462.00	415,645.00
基金投资		6,115,406.55	10,935,374.34
债券投资		101,558.52	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收清算款		58,488.72	7,715.61
应收股利		-	-
应收申购款		-	10,620.28
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	71.26
资产总计		9,600,339.75	12,022,038.30

负债和净资产	附注号	本期末 2022年11月18日 (基金最后运作日)	上年度末 2021年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		287.68	73,041.11
应付管理人报酬		248.18	492.59
应付托管费		49.64	98.48
应付销售服务费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	8	117,798.68	40,655.93
负债合计		118,384.18	114,288.11
<b>净资产：</b>			
实收基金	9	7,054,142.95	7,513,933.10
未分配利润	10	2,427,812.62	4,393,817.09
净资产合计		9,481,955.57	11,907,750.19
负债和净资产总计		9,600,339.75	12,022,038.30

注：

1.报告截止日 2022 年 11 月 18 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.3442 元，基金份额总额 7,054,142.95 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 11 月 18 日(基金最后运作日)止期间。

财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师朱宏宇、朱寅婷签字出具了普华永道中天特审字(2022)第 5741 号标准无保留意见的审计报告。

## 五、基金财产分配

自 2022 年 11 月 21 日至 2022 年 11 月 30 日为止为本基金清算报告期,本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

1.1 本基金最后运作日托管户活期存款 687,674.12 元, 应收活期银行存款利息为 1,963.12 元, 上述利息按照季度结息日划至基金托管户。

1.2 本基金最后运作日清算备付金金额 182,452.44 元, 其中结算备付金 182,312.24 元, 应收清算备付金利息金额为 140.20 元, 结算备付金按照结算规则, 逐步划回托管户, 上述利息按照季度结息日划至基金托管户。

1.3 本基金最后运作日存出保证金金额 334.28 元, 其中结算保证金 333.74 元, 应收保证金利息金额为 0.54 元, 结算保证金按照结算规则, 逐步划回托管户, 上述利息按照季度结息日划至基金托管户。

1.4 本基金最后运作日交易性股票投资市值 2,452,462.00 元, 该资产已于 2022 年 11 月 23 日前全部卖出, 清算金额已全部划入基金托管户。

1.5 本基金最后运作日交易性债券投资市值 101,558.52 元, 该资产已于 2022 年 11 月 23 日前全部卖出, 清算金额已全部划入基金托管户。

1.6 本基金最后运作日交易性基金投资市值 6,115,406.55 元, 待上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金清算资金发放后划至基金托管户, 清算金额以发放日实际收到的清算资金为准。

1.7 证券清算款 58,488.72 元, 已于 2022 年 11 月 21 日划入基金托管户。

### 2、负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付赎回款 287.68 元, 该款项于 2022 年 11 月 22 日全部支付。

2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 248.18 元, 该款项于 2022 年 11 月 29 日支付。

2.3 本基金最后运作日应付托管费 49.64 元, 该款项于 2022 年 11 月 29 日支付。

2.4 其他负债 117,798.68 元，其中应付赎回费 1.09 元，该款项于 2022 年 11 月 22 日全部支付；应付交易费用 31,509.61 元，该款项于 2022 年 11 月 30 日支付；预提费用 86,287.98 元，其中 1,000.00 元为预提的清算期间可能产生的划款手续费，未使用部分将于清算资金发放日之前冲回；35287.98 元为应付审计费，该款项待收到会计师事务所审计费发票后支付；40,000.00 元为清算律师费，于 2022 年 11 月 29 日支付；10,000.00 元为应付公证费，于 2022 年 11 月 29 日支付。

### 3、清算费用

按照《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》第二十三部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，清算过程中发生的费用主要为交易费用、划款手续费等。

### 4、停止运作后的清算损益情况说明

项 目	最后运作日后一日至清算结束日： 2022 年 11 月 19 日至 2022 年 11 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>	-82,551.51
1.利息收入	403.82
其中：存款利息收入	403.82
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
证券出借利息收入	-
其他利息收入	-
<b>2.投资收益（损失以“-”填列）</b>	-40,076.30
其中：股票投资收益	-39,923.46
基金投资收益	-
债券投资收益	-152.84
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-

股利收益	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-
其他投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-42,879.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	0.17
<b>减：二、营业总支出</b>	-
1. 管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 投资顾问费	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 信用减值损失	-
7. 税金及附加	-
8. 其他费用	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-82,551.51
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-82,551.51
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	-
<b>六、综合收益总额</b>	-82,551.51

注 1：利息收入系计提的自 2022 年 11 月 19 日至 2022 年 11 月 30 日止的银行存款利息及结算备付金利息和存出保证金利息。

### 5、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

一、最后运作日 2022 年 11 月 18 日基金净资产	9,481,955.57
加：清算期间净收益	-82,551.51
减：确认赎回对净值的影响	269.42
<b>二、2022 年 11 月 30 日基金资产净值</b>	<b>9,399,134.64</b>

截至本次清算期结束日2022年11月30日，本基金剩余财产为9,399,134.64元。本基金剩余财产将在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。

本基金最后运作日后一日2022年11月19日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金利息亦属基金份额持有人所有，该部分利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担，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。

## **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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具法律意见书一并报上海证监局备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将根据法律法规及本基金的基金合同约定及时进行基金剩余财产的分配。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

(1) 华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 11 月 18 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告

(2)《华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告》的法律意见

### 2、存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 [www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)。

### 3、查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或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。

华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
基金财产清算小组

清算报告出具日：2022 年 11 月 30 日