

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

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 1 月 18 日

清算报告送出日：2023 年 2 月 02 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上述事项。根据基金管理人 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。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛沪港深基本面 LOF
场内简称	基本面 100LOF
基金主代码	166402
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
报告期末(2022 年 12 月 27 日) 基金份额总额	11,307,932.15 份
基金合同存续期	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 9 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。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.40% 以内,年跟踪误差控制在 5% 以内。
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条件下,构建指数化的投资组合。
业绩比较基准	中证锐联沪港深基本面 100 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%
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。本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

§ 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总份额为 344,633,224.79 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 日进入清算期。

§ 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:2022 年 12 月 27 日

单位:人民币元

资 产	最后运作日 2022 年 12 月 27 日
资 产:	
货币资金	5,307,953.22
存出保证金	2,317.93
交易性金融资产	9,733,170.72
其中:股票投资	9,733,170.72
债券投资	-
应收清算款	229,806.41
应收股利	528.00
其他资产	-
资产总计	15,273,776.28

负债和净资产	最后运作日 2022 年 12 月 27 日
负 债:	
应付清算款	-
应付赎回款	4,478,363.29
应付管理人报酬	11,447.32
应付托管费	2,518.40
其他负债	265,893.64
负债合计	4,758,222.65
净资产:	
实收基金	11,307,932.15
未分配利润	-792,378.52
净资产合计	10,515,553.63
负债和净资产总计	15,273,776.28

注:1、本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于基金最后运作日,所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量,负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致,本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

2、报告截止日 2022 年 12 月 27 日(基金最后运作日),浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额净值 0.9299 元,基金份额总额 11,307,932.15 份。

3、本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,注册会计师赵钰、沈俐签字出具了普华永道中天特审字(2023)第 0100 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 清算情况

本基金的本次清算期间为 2022 年 12 月 28 日至 2023 年 1 月 18 日止。由于本基金持有处于停牌期股票,本基金将在其停牌状态解除完成变现后按照基金份额持有人的基金份额比例进行二次分配,二次分配的时间安排根据变现时间确定。

自2022年12月28日至2023年1月18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:

5.1 资产处置情况

5.1.1 自2022年12月28日本基金进入清算程序起至本财务报表批准报出日(2023年1月18日)止期间,本基金银行存款及存出保证金产生的利息收入和2022年12月27日(基金最后运作日)的应收利息中未结息的部分将于银行结息到账后再支付给投资者。

5.1.2 本基金2022年12月27日(基金最后运作日)存放于上海证券交易所的存出保证金2,016.04元及存放于深圳证券交易所的存出保证金301.19元已于2023年1月4日归还本基金的基金管理人。

5.1.3 于2022年12月27日(基金最后运作日),本基金持有的交易性金融资产全部为股票,股票市值为9,733,170.72元,其中上市流通股票为9,726,543.24元,长期停牌而无法卖出的股票为6,627.48元(最后运作日估值市值)。截至2023年1月18日(本财务报表批准报出日),剩余的交易性金融资产全部为长期停牌而无法卖出的股票投资,金额为6,398.86元(采用2023年1月17日的汇率),将在其锁定解除后及时变现,并二次向基金份额持有人分配。除因尚处于长期停牌而无法卖出的股票投资外,本基金持有的其他交易性金融资产已于2022年12月29日前卖出,收回金额合计人民币9,803,131.99元。

5.1.4 本基金最后运作日已确认的应收清算款229,806.41元,已于2022年12月29日前划入本基金托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日已确认的应付赎回款4,478,363.29元,已于2022年12月30日前支付。

5.2.2 于2022年12月27日(基金最后运作日),本基金已计提的应付管理人报酬11,447.32元和应付托管费2,518.40元,已于2023年1月5日支付。

5.2.3 本基金2022年12月27日(基金最后运作日)的其他负债为265,893.64元,该款项包括应付赎回费73.17元,应付交易费用5,820.47元,应付指数使用费50,000元,预提上市费60,000.00元,预提信息披露费50,000.00元,预提审计费40,000.00元,预提律师费15,000.00元,预提持有人大会费35,000.00元,预提持有人大会公证费10,000.00元。其中,应付赎回费已于2022年12月30日前支付,应付交易费用、预提持有人大会费以及预提持有人大会公证费已于2023年1月5日支付,剩余款项于本财务报表批准报出日(2023

年 1 月 18 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 2022 年 12 月 28 日至 2023 年 1 月 18 日止清算期间
一、收入	58,663.60
1、利息收入	8,425.82
2、投资收益（损失以“-”填列）	-1,268,385.77
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	1,318,623.55
二、费用	387.90
1、其他费用	387.90
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	58,275.70

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、最后运作日 2022 年 12 月 27 日基金净资产	10,515,553.63
加：清算期间净收益	58,275.70
二、2023 年 01 月 18 日基金净资产	10,573,829.33

本基金于 2023 年 1 月 18 日剩余财产为 10,573,829.33 元，扣除清算结束日未变现资产，2023 年 1 月 18 日首次可供分配净资产为 10,557,765.53 元。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。由于本基金截至清算结束日（2023 年 1 月 18 日）仍持有未变现资产，故需进行二次清算。本基金将于上述未变现资产全部变现后进入二次清算程序，并将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行二次分配。

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、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）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）清算事宜之法律意见书

6.2 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 (<http://www.py-axa.com>)、中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)，清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

6.3 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。

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 1 月 18 日

清算报告公告日：2023 年 2 月 02 日