

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金 清算报告

基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告出具日：2023年9月4日

报告公告日：2023年9月22日

§ 1 基金情况

(一) 基本信息

1. 基本信息

基金名称	浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金
基金简称	浙商中证转型成长指数
基金主代码	003366
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月19日
最后运作日基金份额总额	2,789,673.96份
投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本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小于0.50%，年跟踪误差不超过6%，实现对中证转型成长指数的有效跟踪。
投资策略	<p>本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证转型成长指数中的基准权重构建指数化投资组合。</p> <p>(一) 资产配置策略；(二) 股票投资策略；(三) 债券投资策略；(四) 权证投资策略；(五) 股指期货投资策略；(六) 国债期货投资策略；(七) 资产支持证券投资策略。</p>
业绩比较基准	95%×中证转型成长指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	<p>本基金属于“中高风险”品种，为股票型基金，一般市场情况下，长期风险收益特征高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>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。</p>
基金管理人	浙江浙商证券资产管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

2. 基金运作情况

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金(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[2015] 2247号《关于准予浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金注册的批复》注册,由浙江浙商证券资产管理有限公司依照《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《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)向社会公开发行募集。《基金合同》于2016年12月19日正式生效,《基金合同》生效日的基金份额总额为225,139,846.09份,相关募集情况经北京兴华会计师事务所[2016]京会兴浙分验字第68000106号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。基金管理人为浙江浙商证券资产管理有限公司,登记机构为浙江浙商证券资产管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

(二) 清算原因

为保护基金份额持有人利益,根据市场环境的变化,本基金管理人依据《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《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金合同》的有关规定,经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,提议终止《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金合同》,并召开持有人大会进行表决。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金份额持有人大会于2023年8月14日表决通过了《关于终止浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,并于2023年8月15日进入清算程序。

(三) 最后运作日及清算期间

本基金的最后运作日为2023年8月14日,清算期为2023年8月15日至2023年9月4日。

§ 2 清算报表编制基础

本基金的清算报表是在持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。由于报告性质所致，本基金的清算报表并无比较期间的相关数据列示。

§ 3 财务会计报告

3.1 资产负债表(已审计)

会计主体：浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金

报告截止日：2023年8月14日(基金最后运作日)

单位：人民币元

资产	本期末 2023 年 8 月 14 日 (基金最后运作日)
资产：	
银行存款	524,251.07
结算备付金	19,984.81
存出保证金	3,033.41
交易性金融资产	2,162,723.46
其中：股票投资	2,162,723.46
债券投资	0.00
应收申购款	9.99
应收证券清算款	0.00
应收利息	0.00
资产合计	2,710,002.74
负债和所有者权益：	
负债：	
卖出回购金融资产款	0.00
应付证券清算款	0.00
应付赎回款	0.00
应付管理人报酬	1,122.11
应付托管费	140.28
应付销售服务费	0.00
应付交易费用	44,387.81

应交税费	0.00
应付利息	0.00
预提费用	3,600.00
其他负债	260,000.00
负债合计	309,250.20
所有者权益：	
实收基金	2,789,673.96
未分配利润	-388,921.42
所有者权益合计	2,400,752.54
负债和所有者权益总计	2,710,002.74

注：报告截止日2023年8月14日，基金份额净值0.861元，基金份额2,789,673.96份。

§ 4 清算情况

自2023年8月15日至2023年9月4日止的清算期间，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：

4.1 资产处置情况

4.1.1 本基金最后运作日银行存款余额524,251.07元，其中包含应计利息679.06元，为存放于中国光大银行股份有限公司的活期存款。银行存款应计利息由管理人先行垫付，待结息日返回给管理人。

4.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额3,033.41元，其中包含应计利息5.47元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金。存出保证金金额于2023年9月4日调整为0元，存出保证金应计利息由管理人先行垫付，待结息日返还给管理人。

4.1.3 本基金最后运作日结算备付金金额19,984.81元，其中包含应计利息24.68元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金。结算备付金金额预计于2023年9月8日调整为3,095.58元，结算备付金由管理人先行垫付，供清盘分配使用，待全部调整至托管户后返还给管理人。结算备付金应计利息由管理人先行垫付，待结息日返还给管理人。

4.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产2,162,723.46元,为了保护基金份额持有人利益,上述交易性金融资产已于2023年8月22日前全部卖出,扣除交易费用后的变现金额为人民币2,131,396.16元。

4.1.5 本基金最后运作日应收申购款9.99元。该款项于2023年8月15日划入托管户。

4.2 负债清偿情况

4.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬1,122.11元,该款项于2023年8月28日支付。

4.2.2 本基金最后运作日应付托管费140.28元,该款项于2023年8月28日支付。

4.2.3 本基金最后运作日应付交易费用44,387.81元,该款项于2023年8月28日支付。

4.2.4 本基金最后运作日预提费用3,600.00元,为产品清算审计费,该款项于2023年8月29日付清。

4.2.5 本基金最后运作日其他应付款260,000.00元,其中250,000.00元为指数使用费,该款项于2023年8月30日付清。10,000元为律师费,该款项于2023年8月23日付清。

4.3 清算期间（2023年8月15日截止至2023年9月4日）清算损益情况

4.3.1 清算期间的利息收入金额855.43元,包括计提的清算期间的存款利息收入、结算备付金利息收入、存出保证金利息收入。

4.3.2 清算期间的投资收益金额-64,713.23元,系本基金最后运作日持有的交易性金融资产变现所得,卖出的同时产生交易费用3,863.79元。

4.3.3 清算期间的股票红利金额-531.92元,系股票卖出后的补缴红利税款。

4.3.4 清算期间产生的公允价值变动损益金额35,691.53元,系本基金股票投资估值增值额。

4.3.5 清算期间产生其他收入金额372.86元,系赎回费收入。

4.4 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 2023 年 8 月 14 日基金净资产	2,400,752.54
加：申购款	99.85
减：赎回款	100,125.43
加：清算期间净收益	-32,189.12
二、2023 年 9 月 4 日基金净资产	2,268,537.84

根据《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2023年9月4日止的剩余净资产为2,268,537.84元。

截至2023年9月4日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币2,248,526.06元（含应计利息1,512.99元），存出保证金8.07元（含应计利息8.07元），清算备付金20,003.71元（含应计利息43.58元）。清算结束日次日（2023年9月5日）至清算资金划出前一日的银行存款利息、备付金利息、保证金利息亦属份额持有人所有。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

4.5 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。

§5 备查文件

5.1 备查文件目录

5.1.1 《浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金清算审计报告》

5.1.2 《上海市恒业律师事务所关于〈浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

5.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

5.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

浙商汇金中证转型成长指数型证券投资基金基金财产清算小组

清算报告出具日：2023年9月4日