

华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金
发起式联接基金
清算报告

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024年9月

一、重要提示

华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2445号文准予注册，于2021年9月7日成立运作。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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》、《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，本基金已出现基金合同终止事由，本基金管理人根据法律法规的规定及基金合同的约定履行了基金财产清算程序，此事项无需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2024年9月7日，自2024年9月8日起，本基金进入清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见基金管理人于2024年9月9日发布的《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

基金管理人华宝基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，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，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

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】2445号文准予注册，由基金管理人依照法律法规的规定及《基金合同》的约定自2021年8月23日至2021年9月3日止期间向社会公开募集。本基金基金合同于2021年9月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为44,100,151.12份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为7,163户。本基金为契约型开放式、发起式基金，存续期限为不定期。本基金的基金管理人及登记机构均为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。本基金还可投资于国内依法发行上市的非成份股（包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、股指期货、国债期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的标的指数为深证创新 100 指数，业绩比较基准为：深证创新100指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%。

本基金根据销售服务费及认/申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，不从本类别基金资产中计提销售服务费且收取认/申购费的基金份额类别，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费且不收取认/申购费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。

三、基金运作情况

根据基金合同“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：

“基金合同生效日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。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7日，基金合同生效日起三年后的对应日为2024年9月7日。截至2024年9月7日日终，本基金的基金资产净值低于2亿元，出现触发基金合同终止的上述情形，本基金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。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

根据《关于华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于2024年9月8日起进入清算程序，本基金进入清算程序后，不再收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。

四、财务会计报告

华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金最后运作日资产负债表

单位：人民币元

	最后运作日 2024年9月7日
资产：	
货币资金	720,136.55
结算备付金	0.62
存出保证金	691.82
应收清算款	180,692.77
交易性金融资产	10,034,512.72
资产合计	10,936,034.48
负债：	
应付管理人报酬	61.63
应付托管费	12.33
应付销售服务费	91.18
应付赎回款	260,741.91
其他负债	15,669.11
负债合计	276,576.16
净资产：	
实收资金	16,837,639.98
未分配利润	-6,178,181.66
净资产合计	10,659,458.32
负债和净资产合计	10,936,034.48

五、清算报表编制基础

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》的有关规定编制的。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，本清算报表无比较期间的相关数据列示。

六、清算情况

自2024年9月8日起至2024年9月12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：

1、资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日银行存款为人民币720,136.55元，其中托管户存款为人民币719,474.96元，应计银行存款利息为人民币661.59元，由于银行尚未结息，应计银行存款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。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币0.62元，其中应计结算备付金利息为人民币0.62元，由于银行尚未结息，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。

- (3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币691.82元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币688.51元，该款项将由基金管理人以自有资金先行垫付；应计存出保证金利息为人民币3.31元，由于银行尚未结息，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。
- (4) 本基金最后运作日应收清算款为人民币180,692.77元，该款项已于2024年9月9日划入托管账户。
- (5) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币10,034,512.72元，均为基金投资，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9,971,167.49元，该款项已于清算期间划入托管账户。

2、 负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币61.63元，该款项已于2024年9月11日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币12.33元，该款项已于2024年9月11日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币91.18元，该款项已于2024年9月11日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币260,741.91元，该款项已于清算期间完成支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币15,669.11元。其中应付律师费为人民币10,000.00元，已于2024年9月12日支付；应付审计费为人民币5,000.00元，已于2024年9月12日支付；应付赎回费为人民币669.11元，该款项已于清算期间完成支付。

3、 清算期间的清算损益情况

项目	单位：人民币元	
	自2024年9月8日至2024年9月12日止清算期间	
一、收益		
1、利息收入（注1）		317.86
2、公允价值变动损益（注2）		4,881,900.83
3、投资收益（注3）		-4,947,011.91
收益小计		-64,793.22
二、费用		
1、其他费用（注4）		80.00
小计		80.00
三、清算期间净损益		-64,873.22

注1：利息收入系自2024年9月8日至2024年9月12日止清算期间计提的银行存款利息收入、存出保证金利息收入、结算备付金利息收入。

注2：公允价值变动损益系本基金于最后运作日持有的基金在其处置变现之前的市场价格波动导致。

注3：投资收益系本基金于最后运作日持有的基金自2024年9月8日起至2024年9月12日止清算期间处置变现后的金额。

注4：其他费用系自2024年9月8日至2024年9月12日止清算期间的银行汇划手续费。

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9月7日基金净资产	10,659,458.32
加：清算期间净损益	-64,873.22
减：清算期间支付赎回款、赎回费	347,919.20
二、2024年9月12日基金净资产	10,246,665.90

资产处置及负债清偿后，截至本次清算结束日2024年9月12日，本基金剩余财产为人民币10,246,665.90元，根据基金合同的约定，本基金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，按各类基金份额在基金合同终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自清算起始日2024年9月8日至清算款划出日前一日的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息亦属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，尚未结息的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。基金管理人自有资金垫款产生的利息归属基金管理人所有。

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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

七、备查文件

1、备查文件目录

(1) 《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金清算审计报告》；

(2) 关于《华宝深证创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所备投资者查阅。

3、查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件。

华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金财产清算小组
2024 年 9 月