

华宝英国富时100指数发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：华宝基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023年12月

华宝英国富时 100 指数发起式证券投资基金
2023 年 11 月 10 日(基金最后运作日)资产负债表

单位：人民币元

	最后运作日 2023 年 11 月 10 日
资产：	
银行存款	1,158,284.80
交易性金融资产	15,596,606.24
应收清算款	615,560.23
应收股利	46,310.01
应收申购款	99.99
资产总计	17,416,861.27
负债：	
应付赎回款	736,803.86
应付管理人报酬	3,808.12
应付托管费	1,190.04
应付销售服务费	473.71
其他负债	17,161.35
负债合计	759,437.08
所有者权益：	
实收资金	14,876,281.93
未分配利润	1,781,142.26
所有者权益合计	16,657,424.19
负债和所有者权益总计	17,416,861.27

注：本基金最后运作日 2023 年 11 月 10 日，华宝富时 100A 份额净值人民币 1.1231 元，华宝富时 100C 份额净值人民币 1.1095 元，基金份额总额 14,876,281.93 份，其中华宝富时 100A 份额 11,186,019.66 份，华宝富时 100C 份额 3,690,262.27 份。

一、 华宝英国富时100指数发起式证券投资基金简介

1、 基本情况

华宝英国富时100指数发起式证券投资基金（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[2019]77号文《关于准予华宝英国富时100指数证券投资基金（LOF）注册的批复》及证监许可[2020]1126号文《关于准予华宝英国富时100指数证券投资基金（LOF）变更注册的批复》准予注册，由华宝基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于2020年11月10日正式生效，首次设立募集规模为10,874,812.34份基金份额。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人和注册登记机构均为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括：标的指数成分股、备选成分股、已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的跟踪同一标的指数的公募基金（包括ETF）；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于基金资产的80%；投资于跟踪同一标的指数的公募基金(包括ETF)的比例不超过基金资产净值的10%。本基金持有现金（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%。本基金的业绩比较基准为：经人民币汇率调整的富时100指数收益率×95%+人民币活期存款利率（税后）×5%。

根据《关于华宝英国富时100指数发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自2023年11月11日起，本基金进入清算程序。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。本基金进入清算程序后,如因本基金所持证券的流动性受限等客观因素影响，本基金将先以已变现基金资产为限进行分配，待本基金所持证券全部变现后进行再次分配。

2、 清算原因

根据《华宝英国富时100指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）第五部分“基金备案”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。”

本基金基金合同生效日为2020年11月10日，基金合同生效日起三年后的对应日为2023年11月10日。截至2023年11月10日日终，本基金已出现上述触发基金合同终止的情形（即本基金基金资产规模低于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。

一、 华宝英国富时100指数发起式证券投资基金简介（续）

3、 清算起始日

根据《关于华宝英国富时100指数发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自2023年11月11日起，本基金进入清算程序。由于本基金持有的流通受限股票无法确定变现时间，本基金计划将进行二次清算，其中第一次清算期间为2023年11月11日至2023年11月29日，之后的二次清算期间将根据流通受限股票的变现时间确定。

二、 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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

三、 清算情况

自2023年11月11日起至2023年11月29日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行第一次清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

1、 资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日境内银行存款本金为人民币 371,504.03 元和英镑 40,002.53GBP，境内银行存款应计利息为人民币 248.85 元；境外银行存款本金为美元 4.28USD、英镑 49,208.23GBP 和欧元 0.04EUR，境外银行存款应计利息为英镑 9.22GBP；上述金额合计为人民币 1,158,284.80 元。截止 2023 年 11 月 29 日，境内银行存款本金为人民币 16,996,804.44 元，境内银行存款应计利息为人民币 677.53 元；境外银行存款本金为美元 4.28USD、英镑 396.77GBP 和欧元 0.04EUR，境外银行存款应计利息为英镑 13.76GBP；上述金额合计为人民币 17,001,220.34 元。
- (2) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产人民币 15,596,606.24 元，为股票投资和基金投资。本基金于 2023 年 11 月 11 日至 2023 年 11 月 29 日进行第一次清算，对部分股票投资和基金投资进行处置变现，变现产生的清算款合计为人民币 15,783,879.16 元，剩余款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。
- (3) 本基金最后运作日应收清算款余额为人民币615,560.23元，应收申购款余额为人民币99.99元，上述全部款项已于清算期间划至基金托管账户。

三、 清算情况（续）

2、 负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币736,803.86元，该款项已于2023年11月13日、2023年11月14日、2023年11月15日、2023年11月16日、2023年11月17日和2023年11月20日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币3,808.12元，该款项已于2023年11月15日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,190.04元，该款项已于2023年11月15日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币473.71元，该款项已于2023年11月15日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 17,161.35 元，其中包括：应付赎回费为人民币 260.96 元，该款项已于 2023 年 11 月 13 日、2023 年 11 月 14 日、2023 年 11 月 15 日、2023 年 11 月 16 日、2023 年 11 月 17 日和 2023 年 11 月 20 日支付；其他应付款为人民币 1,900.39 元，该款项已于 2023 年 11 月 29 日支付；预提费用为人民币 15,000.00 元，该款项已于 2023 年 11 月 13 日支付。

3、 清算期间的清算损益情况

项目	单位：人民币元	
	自2023年11月11日 至2023年11月29日	止清算期间
一、 收益		
1、 利息收入（注1）		468.94
2、 投资收益		858,794.56
3、 公允价值变动损益		-665,972.12
4、 汇兑损益		311,664.10
5、 其他收入		0.72
收益小计		<u>504,956.20</u>
二、 费用		
1、 其他费用（注2）		226.40
费用小计		<u>226.40</u>
三、 清算期间净损益		<u><u>504,729.80</u></u>

注1：利息收入系自2023年11月11日至2023年11月29日止清算期间计提的银行存款利息收入。

注2：其他费用系自2023年11月11日至2023年11月29日止清算期间计提的指数使用费及银行汇划费用。

四、 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11月10日基金净资产	16,657,424.19
加：清算期间净损益	504,729.80
减：清算期间支付赎回款、赎回费	116,015.56
二、2023年11月29日基金净资产	17,046,138.43

资产处置及负债清偿后，于2023年11月29日，本基金剩余财产为人民币17,046,138.43元，根据本基金的基金合同及《关于华宝英国富时100指数发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》的约定，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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。截止第一次清算结束日2023年11月29日，无法变现的流通受限股票的成本总额为人民币30,775.30元，估值总额为人民币5,549.52元。由于本基金持有的流通受限股票无法确定变现时间，第一次清算期间为2023年11月11日至2023年11月29日，之后的二次清算期间将根据流通受限股票的变现时间确定。此估值金额与实际变现金额可能存在差异，将根据变现情况在第二次清算时按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。截止本次清算结束日2023年11月29日，本基金持有停牌股票均未复牌。

因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估本次清算结束日至清算款划出日前一日银行存款、结算备付金及存出保证金产生的利息，该期间利息亦属全体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，最终将于清算结束日以基金净资产合计数按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

五、 基金剩余资产的分配

单位：人民币元

项目	分配顺序
一、2023年11月29日基金净资产	17,046,138.43
减：未变现资产	83,316.13
二、第一次可供分配剩余财产总额	16,962,822.30

剩余未变现资产待变现后再行分配。实际分配以注册登记机构确认为准。

六、 备查文件

1、 备查文件目录

- (1) 《华宝英国富时100指数发起式证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《华宝英国富时100指数发起式证券投资基金清算报告》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。

华宝英国富时100指数发起式证券投资基金基金财产清算小组
2023年12月