

华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券 投资基金清算报告

基金管理人：华泰证券（上海）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：2024年8月2日

报告送出日：2024年8月14日

一、重要提示

华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]1748号）批准募集，《华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》或“基金合同”）于2021年7月28日生效并正式运作。基金管理人为华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国光大银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“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：

“基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。”

本基金基金合同生效日为2021年7月28日，基金合同生效之日起三年后的对应日为2024年7月28日。截至2024年7月28日日终，本基金资产净值低于2亿元，已触发基金合同中约定的基金终止条款。本基金根据《基金合同》约定终止并进入清算程序，且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7月28日，自2024年7月29日起进入清算期，由本基金管理人华泰证券（上海）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、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和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，并由毕马威华振会计师事务所（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

基金名称	华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金
基金简称	华泰紫金中证细分食品饮料主题指数发起
基金主代码	012763
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年7月28日
清算起始日	2024年7月29日
最后运作日(2024年7月28日)基金份额总额	26,679,485.05份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>1、大类资产配置；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、参与融资及转融通证券出借业务策略；6、其他金融工具投资策略</p>
业绩比较基准	中证细分食品饮料产业主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混

	<p>合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>	
基金管理人	华泰证券（上海）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	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金中证细分食品饮料主题指数发起 A	华泰紫金中证细分食品饮料主题指数发起 C
下属分级基金的交易代码	012763	012764
最后运作日(2024年7月28日)下属分级基金的份额总额	16,404,113.36份	10,275,371.69份

三、基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]1748号）注册，由华泰证券（上海）资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《基金合同》负责公开募集，基金合同于2021年7月28日正式生效，生效日的基金份额总额为55,664,732.11份，其中认购利息折合5,001.20份。

自2021年7月28日至2024年7月28日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“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：“基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。”

根据《基金合同》以及基金管理人于2024年7月29日发布的《华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型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》，本基金基金合同生效日为2021年7月28日，基金合同生效之日起三年后的对应日为2024年7月28日。截至2024年7月28日日终，本基金资产净值低于2亿元，已触发基金合同中约定的基金终止条款。本基金根据《基金合同》约定终止并进入清算程序，且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7月28日，自2024年7月29日起进入清算程序。

四、财务会计报告

4.1 最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年7月28日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2024年7月28日 (基金最后运作日)
资 产：	
货币资金	1,455,014.06
结算备付金	10,056.72
存出保证金	4,202.99
应收证券清算款	17,176,457.02
资产总计	18,645,730.79
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	503,460.83
应付管理人报酬	5,083.48
应付托管费	847.25
应付销售服务费	737.26
应交税费	2.66
其他负债	24,732.42
负债合计	534,863.90
所有者权益：	
实收基金	26,679,485.05
未分配利润	-8,568,618.16
净资产合计	18,110,866.89
负债和净资产总计	18,645,730.79

注：报告截止日 2024 年 7 月 28 日(基金最后运作日)，基金总份额 26,679,485.05 份，其中 A 类基金份额净值 0.6795 元，A 类基金份额 16,404,113.36 份；C 类基金份额净值 0.6777 元，C 类基金份额 10,275,371.69 份。

4.2 清算损益表（已经审计）

单位：人民币元

项 目	2024 年 7 月 29 日至 2024 年 7 月 31 日 (清算期间)
一、清算收入	-37,750.52
利息收入	1,065.09
投资收益（损失以“-”填列）	-38,947.76
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-
其他业务收入	132.15
二、清算支出	-
税金及附加	-
其他费用	-
三、清算收益	-37,750.52
减：所得税费用	-
四、清算净收益（净亏损以“-”号填列）	-37,750.52

注：投资收益为中国证券登记结算有限责任公司代扣代缴的股票红利税，其他业务收入为归基金资产的赎回费收入。

五、清算事项说明

自 2024 年 7 月 29 日至 2024 年 7 月 31 日止为清算期间，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 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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。根据本基金的基金合同约定，本基金的清算费用由基金财产承担。

5.2 资产处置情况

1、本基金最后运作日银行存款余额为人民币 1,455,014.06 元(含应计利息 904.90 元);清算期间净流入人民币 15,294,427.45 元,清算结束日银行存款余额为人民币 16,749,441.51 元;

2、本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 10,056.72 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本金和应计利息。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 6 个工作日对结算备付金进行调整,存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金应计利息预计于 2024 年 9 月 23 日收回;

3、本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 4,202.99 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本金和应计利息。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 2 个工作日对存出保证金进行调整,存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金应计利息预计于 2024 年 9 月 23 日收回;

4、本基金最后运作日应收证券清算款余额为人民币 17,176,457.02 元,该款项已于清算期间全额划至托管户;

5.3 负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 503,460.83 元,该款项已于清算期间支付;

2、本基金最后运作日应付管理费余额为人民币 5,083.48 元,该款项已于清算期间支付;

3、本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 847.25 元,该款项已于清算期间支付;

4、本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 737.26 元,该款项已于清算期间支付;

5、本基金最后运作日应交税费为人民币 2.66 元,该款项已于清算期间支付;

6、本基金最后运作日其他负债为 24,732.42 元,包括应付交易费用、预提清算律师费、预提清算审计费。其中:

1) 应付交易费为人民币 4,732.42 元,均为应付佣金,该款项已于清算期间支付;

2) 预提清算审计费为人民币 10,000.00 元,该款项已于清算期间支付;

3) 预提清算律师费为人民币 10,000.00 元,该款项已于清算期间支付;

5.4 截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位:人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 7 月 28 日基金净资产	18,110,866.89
加：清算报告期间净收益	-37,750.52
减：2024 年 7 月 29 日赎回转出确认金额	1,309,413.23
二、清算结束日 2024 年 7 月 31 日基金净资产	16,763,703.14

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算期结束日 2024 年 7 月 31 日，本基金剩余财产为 16,763,703.14 元。根据《基金合同》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各类基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日(2024 年 8 月 1 日)至清算款项支付日前一日(2024 年 8 月 13 日)的归属于基金份额持有人的银行存款、结算备付金和存出保证金孳生的利息归基金份额持有人所有，最终支付清算款金额以基金管理人登记机构的记录为准，清算款项将于 2024 年 8 月 14 日由基金托管户划出。

为加快清盘速度，清盘过程中的冻结资产（包括未到账的利息等款项）由基金管理人自有资金先行垫付，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，基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5.5 基金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。

六、备查文件目录

6.1、备查文件目录

(1) 《华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金的清算审计报告》；

(2) 《上海市通力律师事务所关于〈华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金清算报告〉的法律意见》。

6.2、存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2024年8月2日