

信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金 清算报告

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年7月10日

清算报告公告日：2023年7月19日

一、 重要提示

信澳中证沪港深高股息精选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 2018 年 3 月 5 日《关于准予信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金注册的批复》（证监许可 2018【375】号）注册公开募集，自 2018 年 11 月 02 日起基金合同生效，基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。2022 年 3 月 21 日，基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 6 月 1 日，本基金名称变更为“信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。根据《信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的“二、《基金合同》的终止事由”中约定，“有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人已于 2023 年 5 月 17 日刊登了《信达澳亚基金管理有限公司关于以通讯方式召开信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2023 年 5 月 18 日、2023 年 5 月 19 日陆续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会于 2023 年 6 月 19 日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效，基金管理人于 2023 年 6 月 21 日刊登了《关于信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

二、 基金概况

基金名称	信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金
基金简称	信澳中证沪港深高股息精选
基金主代码	005770
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月02日
最后运作日基金份额总额 (2023年6月21日)	4,330,889.00份
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。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0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资范围	本基金可投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于标的指数成份股及备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他2/6银行存款)、同业存单、货币市场工具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的相关规定)。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

	<p>在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金 90%以上的基金资产投资于股票，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的 90%。现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
投资策略	<p>本基金按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，原则上采用指数复制法，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，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，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对实际投资组合进行适当处理和调整，力争实现对跟踪误差的有效控制。</p>
业绩比较基准	<p>中证沪港深高股息精选指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。</p>

	险。
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金系经中国证监会证监许可 2018【375】号文《关于准予信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金注册的批复》的注册，由信达澳亚基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开募集，基金合同于2018年11月02日生效。首次设立募集规模为412,720,623.28份基金份额。

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》、《信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，经本基金份额持有人大会 2023年6月19日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于2023年6月21日刊登了《关于信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金的最后运作日为2023年6月21日，自2023年6月26日起进入清算期。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

报告截止日：2023年6月21日

单位：人民币元

	最后运作日 2023年6月21日
资产：	
银行存款	297,247.97
存出保证金	826.73
交易性金融资产	2,843,409.95
应收清算款	106,956.84
应收股利	60,905.50
资产总计	3,309,346.99
负债：	
应付赎回款	11,989.66
应付管理人报酬	1,838.58
应付托管费	404.50
其他负债	116,523.50
负债合计	130,756.24
净资产：	
实收基金	4,330,889.00
未分配利润	-1,152,298.25
净资产合计	3,178,590.75
负债和净资产总计	3,309,346.99

注：基金最后运作日2023年6月21日，信澳中证沪港深高股息精选份额净值0.7339元，基金份额为4,330,889.00份。

五、清算情况

自2023年6月22日至2023年7月10日止清算期间，信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资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。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

1、资产清算情况

(1) 本基金最后运作日银行存款人民币297,247.97元，其中银行存款为人民币297,242.03元，应计银行存款利息为人民币5.94元，截至2023年7月10日银行存款人民币3,240,681.94元，其中银行存款为人民币3,239,791.91元，应计银行存款利息为人民币890.03元，该款项将于扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后向基金份额持有人分配。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币826.73元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币184.01元，应计上海存出保证金利息为人民币0.01元；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642.68元，应计深圳存出保证金利息为人民币0.03元。存出保证金已于自2023年6月22日至2023年7月10日止的清算期间划回托管户。截至2023年7月10日应计存出保证金利息0.84元，将于2023年9月21日结息并划入托管户。该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币2,843,409.95元，其中：

1) 因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票人民币5,596.81元，其明细如下：

单位：人民币元

证券代码	证券名称	最后运作日 估值单价	数量 (单位:股)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
01995	旭辉永升 服务	2.80	2,000	9,125.20	5,596.81

注：停牌股票最后运作日估值金额与实际变现金额可能存在差异，实际变现金额存在不确定性。待停牌股票变现后，基金管理人将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。于2023年7月10日，本基金持有停牌股票尚未复牌。

2) 本基金最后运作日持有非流通受限股票人民币2,837,813.14元，已于自2023年6月22日至2023年7月10日止清算期间处置变现，实际变现金额为人民币

2,810,035.56元。

(4) 本基金最后运作日应收清算款人民币106,956.84元，已于自2023年6月22日至2023年7月10日止清算期间划至托管户存款。

(5) 本基金最后运作日应收股利人民币60,905.50元，截至2023年7月10日应收股利人民币31,946.65元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

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11,989.66元，该款项已分别于2023年6月26日、2023年6月27日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,838.58元，该款项已于2023年7月4日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币404.50元，该款项已于2023年7月4日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币116,523.50元，其中应付赎回费为人民币18.43元，该款项已于2023年6月26日、2023年6月27日支付；应付交易费用为人民币114.36元，该款项已于2023年7月5日支付；应付指数使用费为人民币116,390.71元，截至2023年7月10日应付指数使用费人民币116,043.96元，该款项预计于清算期结束后安排支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2023年6月22日至2023年7月10日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	884.90
2、投资收益（注2）	-79,165.81
3、公允价值变动收益（注3）	61,548.90
清算收入小计	-16,732.01
二、清算费用	
其他费用（注4）	-330.01
清算费用小计	-330.01
三、清算净收益	-16,402.00

注1：利息收入系计提的自2023年6月22日至2023年7月10日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

注2：投资收益系计提的自2023年6月22日至2023年7月10日止清算期间确认的股利收益、扣除交易费用后的股票投资收益。

注3：公允价值变动收益系自2023年6月22日至2023年7月10日止清算期间确认的股票估值、股票卖出公允价值变动损益。

注4：其他费用系自2023年6月22日至2023年7月10日止清算期间确认的指数使用费、银行结算费用、证券组合费。

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 2023 年 6 月 21 日基金净资产	3,178,590.75
加：清算期间净收益	-16,402.00
二、2023 年 7 月 10 日基金净资产	3,162,188.75

根据本基金的《基金合同》及《关于终止信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本基金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（本基金清算过程中发生的审计费、律师费由基金管理人承担）、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。具体方式如下：

（1）非受限基金净资产金额人民币3,156,585.47元，其中：银行存款金额为人民币3,239,791.91元，扣除尚未支付的应付指数使用费人民币116,043.96元，管理人将预留人民币10,000.00元用于支付处置未变现资产产生的费用，剩余金额人民币3,113,747.95元将于第一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；应计银行存款利息890.03元、应计存出保证金利息0.84元、应收股利31,946.65元，将于第二次清算时向基金份额持有人进行分配，于第二次清算款划出日如有未变现部分，则由基金管理人信达澳亚基金管理有限公司以自有资金垫付；应付指数使用费人民币116,043.96元预计于清算期结束后从可分配财产中安排支付。

(2) 受限基金净资产金额人民币5,603.28元,其中:交易性金融资产5,603.28元(该金额为停牌股票于清算结束日的估值金额),上述资产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期间按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

因清算款划出日不能确定,暂不能准确预估清算结束日至清算款划出日前一日银行存款产生的利息,该期间利息亦属全体份额持有人所有,将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。

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,报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 《信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《关于信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。

信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金财产清算小组

2023年7月10日