

宝盈中证沪港深科技龙头指数型 发起式证券投资基金清算报告

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：2025 年 12 月 8 日

清算报告公告日：2025 年 12 月 11 日

一、重要提示

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》、《宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，《基金合同》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），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的方式延续基金合同期限。

截至 2025 年 11 月 23 日日终，宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金资产净值低于 2 亿元，触发了《基金合同》终止的情形。宝盈基金管理有限公司自 2025 年 11 月 24 日起根据相关法律法规、《基金合同》等规定组织基金财产清算。

本基金最后运作日为 2025 年 11 月 23 日，自 2025 年 11 月 24 日起进入清算期。基金管理人宝盈基金管理有限公司、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰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，并由容诚会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称	宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金	
基金简称	宝盈中证沪港深科技龙头指数发起式	
基金主代码	015820	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 23 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
基金最后运作日（2025 年 11 月 23 日） 基金份额总额（运作日后有赎回确认）	22,523,180.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	宝盈中证沪港深科技龙头指数发起式 A	宝盈中证沪港深科技龙头指数发起式 C
下属分级基金的交易代码	015820	015821

基金最后运作日（2025 年 11 月 23 日） 下属分级基金的份额总额	15,515,631.52 份	7,007,548.51 份
--	-----------------	----------------

2、基金产品说明

投资目标	本基金进行被动指数化投资，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>本基金的投资策略主要包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（含可交换债券）投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、参与融资业务策略、参与转融通证券出借业务策略和存托凭证的投资策略。</p> <p>本基金为被动式指数基金，主要采用完全复制策略进行股票投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。在正常情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。</p>
业绩比较基准	中证沪港深科技龙头指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数表现，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> <p>本基金可投资于港股通标的股票，会面临汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

三、基金运作情况概述

宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金经 2022 年 4 月 29 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2022〕918 号《关于准予宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册。本基金自 2022 年 10 月 26 日起向社会公开募集，基金募集工作于 2022 年 11 月 21 日顺利结束。本次基金募集总额为 21,411,728.14 元人民币，有效认购户数为 885 户。上述资金于 2022 年 11 月 23 日全额划入本基金在基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司开立的宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金托管专户。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资并向中国证监会备案，《宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 11 月 23 日正式生效。

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》、《基金合同》的有关规定，《基金合同》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延

至下一日)，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的方式延续基金合同期限。截至 2025 年 11 月 23 日日终，本基金基金资产净值低于 2 亿元，触发了《基金合同》终止的情形。基金管理人宝盈基金管理有限公司根据《基金合同》的规定对基金财产进行清算，履行清算职责。基金管理人于 2025 年 11 月 24 日发布了《关于宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》，本基金最后运作日为 2025 年 11 月 23 日，本基金自 2025 年 11 月 24 日起进入基金财产清算程序。

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：宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金
报告截止日：2025 年 11 月 23 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	2025 年 11 月 23 日（基金最后运作日）
资产：	
货币资金	1,236,910.16
结算备付金	1,619,441.06
交易性金融资产	30,986,497.82
其中：股票投资	30,683,603.60
债券投资	302,894.22
应收证券清算款	851,121.00
资产合计：	34,693,970.04
负债和所有者权益	2025 年 11 月 23 日（基金最后运作日）
负债：	
应付赎回款	2,336,204.22
应付管理人报酬	13,694.99
应付托管费	2,739.00
应付销售服务费	2,496.19
其他负债	6,042.85
负债合计：	2,361,177.25
所有者权益：	
实收基金	22,523,180.03
未分配利润	9,809,612.76
所有者权益合计：	32,332,792.79
负债和所有者权益总计：	34,693,970.04

注：1、报告截止日 2025 年 11 月 23 日（基金最后运作日），基金份额总额为 22,523,180.03 份；其中宝盈中证沪港深科技龙头指数发起式 A 基金份额总额 15,515,631.52 份，基金份额净值 1.4386 元；宝盈中证沪港深科技龙头指数发起式 C 基金份额总额 7,007,548.51 份，基金份额净值 1.4287 元。

2、本财务报告已经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并出具了无保留意见的审计报告。

五、清算情况

自 2025 年 11 月 24 日起至 2025 年 12 月 5 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，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式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”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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。

2、资产处置情况

（1）本基金最后运作日的货币资金为银行存款，共计人民币 1,236,910.16 元，其中 1,236,031.05 元为存储于基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司的活期存款本金，879.11 元为应计活期存款利息。

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币 1,619,441.06 元，全部为存放在证券营业部的证券交易资金，其中本金 1,616,153.82 元，应计利息 3,287.24 元。

（3）本基金最后运作日股票投资为人民币 30,683,603.60 元，截至 2025 年 11 月 26 日全部变现，变现金额为人民币 31,571,932.75 元。

（4）本基金最后运作日债券投资为人民币 302,894.22 元，截至 2025 年 11 月 26 日全部变现，变现金额为人民币 302,886.79 元。

（5）本基金最后运作日应收证券清算款为深港通资金清算往来，共计人民币 851,121.00 元，该部分资金分别于 2025 年 11 月 24 日、25 日交收，划入本基金证券交易资金账户。

3、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 13,694.99 元，该款项已于 2025 年 12 月 3 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,739.00 元，该款项已于 2025 年 12 月 3 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 2,496.19 元，该款项已于 2025 年 12 月 3 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付赎回款 2,336,204.22 元，截至 2025 年 11 月 26 日已全部支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 6,042.85 元，其中：
证券交易资金账户预收股票分红款 2,000.00 元，已于 2025 年 11 月 24 日结转；
应付赎回费 10.94 元，截至 2025 年 11 月 26 日已全部支付；
应付审计费 4,031.91 元，该款项将于收到审计公司账单时支付。

4、清算期间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（2025 年 11 月 23 日）基金净资产	32,332,792.79
加：清算期间（2025 年 11 月 24 日至 2025 年 12 月 5 日）收入	883,417.26
其中：利息收入（注 1）	3,995.15
交易性金融资产投资收益（注 2）	879,422.11
减：清算期间（2025 年 11 月 24 日至 2025 年 12 月 5 日）支出	720,833.76
其中：基金份额赎回产生的基金净值变动（注 3）	720,501.30
银行费用（注 1）	314.34
其他费用—证券组合费	18.12
二、清算结束日（2025 年 12 月 5 日）基金资产净值（注 4）	32,495,376.29

注 1：利息收入和银行费用系以当前适用利率和银行收费标准预估，预估金额可能与实际结算金额存在略微差异。

注 2：交易性金融资产投资收益包括，清算期间股票资产所产生的损益 879,429.54 元；清算期间债券资产所产生的损益-7.43 元。

注 3：本基金最后运作日为 2025 年 11 月 23 日，基金份额持有人在该日前一工作日提交的有效赎回申请，基金管理人于 2025 年 11 月 24 日对其进行确认，并于 2025 年 11 月 27 日支付赎回款。

注 4：根据本基金《基金合同》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。截至 2025 年 12 月 5 日，本基金资产处置及负债清偿后剩余财产为人民币 32,495,376.29 元，清算期结束日次日至清算款划出日前一日的资金账户孳生的利息归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，基金管理人将在清算付款日以自有资金先行垫付上述结算备付金（若有）、存出保证金（若有）和未结息金额（若有），供清盘分配使用，待实际资金到账后再返还基金管理人，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有，利息收入和银行费用预估金额与实际结算金额的差额由基金管理人承担。

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，在经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

- （1）《宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金清算审计报告》
- （2）《上海源泰律师事务所关于宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的住所和/或办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的住所和/或办公场所或在基金管理人网站免费查阅。

宝盈中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2025 年 12 月 8 日（清算报告出具日）