

富国中证ESG120策略交易型开放式指数证券投资基金
清算报告

2021年12月24日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

公告日期：2021年12月31日

一、重要提示及目录

1、重要提示

富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”),系证监许可[2021]1104 号《关于准予富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册募集,于 2021 年 06 月 16 日成立。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的有关规定,本基金出现了基金合同终止事由,本基金管理人履行适当程序并将在对本基金财产进行清算后终止基金合同,此事项不需召开基金份额持有人大会审议。本基金的最后运作日定为 2021 年 12 月 14 日,并于 2021 年 12 月 15 日进入清算程序。

本基金清算期自 2021 年 12 月 15 日起至 2021 年 12 月 24 日止。由基金管理人富国基金管理有限公司、基金托管人华夏银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于 2021 年 12 月 15 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并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。

2、目录

一、重要提示及目录	2
1、重要提示.....	2
2、目录.....	3
二、基金概况	4
三、财务会计报告	4
四、清盘事项说明	5
1、基金基本情况.....	5
2、清算原因.....	6
3、清算起始日.....	7
4、清算报表编制基础.....	7
五、清算情况	7
1、清算费用.....	7
2、资产处置情况.....	7
3、负债清偿情况.....	8
4、清算期间的清算损益情况.....	8
5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况.....	9
6、基金财产清算报告的告知安排.....	9
六、备查文件目录	10
1、备查文件目录.....	10
2、存放地点.....	10
3、查阅方式.....	10

二、基金概况

- 1、基金名称：富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金
- 2、基金扩位简称： ESG 龙头 ETF（基金主代码：516400）。
- 3、基金运作方式：契约型、交易型开放式
- 4、基金合同生效日：2021 年 06 月 16 日
- 6、基金管理人：富国基金管理有限公司
- 7、基金托管人：华夏银行股份有限公司
- 8、最后运作日（2021 年 12 月 14 日）基金份额总额：5,458,957.00。
- 9、最后运作日（2021 年 12 月 14 日）基金资产净值：5,212,625.69 元。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 14 日

单位：人民币元

	最后运作日 2021 年 12 月 14 日
资产：	
银行存款	323,657.46
结算备付金	2,289.63
存出保证金	219,051.82
交易性金融资产	5,092,051.74
应收证券清算款	2,790,769.40
应收利息	1,385.58
资产总计	8,429,205.63
负债：	
应付证券清算款	3,112,992.84

应付管理人报酬	2,409.64
应付托管费	481.93
应付交易费用	11,545.60
其他负债	89,149.93
负债合计	3,216,579.94
所有者权益：	
实收基金	5,458,957.00
未分配利润	-246,331.31
所有者权益合计	5,212,625.69
负债和所有者权益总计	8,429,205.63

四、清盘事项说明

1、基金基本情况

富国中证ESG120策略交易型开放式指数证券投资基金，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[2021]1104号《关于准予富国中证ESG120策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由富国基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行人募集。基金合同于2021年6月16日正式生效，首次设立募集规模为241,458,957.00份基金份额。本基金为契约型，交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为富国基金管理有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）和其他股票。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货等）、货币市场工具以及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。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不得低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如法律法规对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金业绩比较基准为：中证ESG120策略指数收益率。

2、清算原因

根据《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的“第五部分 基金备案”中约定：“基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，且无需召开基金份额持有人大会。”同时，“第二十一部分 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，经履行相关程序后，基金合同应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、基金合同约定的其他情形；4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

根据基金管理人于 2021 年 12 月 3 日发布的《富国基金管理有限公司关于富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金发生基金合同终止情形及基金财产清算的公告》，截至 2021 年 12 月 2 日日终，本基金基金资产净值已连续 50 个工作日低

于 5000 万元。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同的约定，本基金管理人应当对基金财产进行清算并终止本基金基金合同，并将按规定申请办理本基金终止上市的相关事宜。

3、清算起始日

根据《富国基金管理有限公司关于富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金发生基金合同终止情形及基金财产清算的公告》，本基金自 2021 年 12 月 15 日起进入清算程序，故本基金清算起始日为 2021 年 12 月 15 日。

4、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《证券投资基金会计核算业务指引》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。

五、清算情况

自 2021 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 24 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、清算费用

按照《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》第二十一部分“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) 本基金最后运作日结算备付金为人民币2,289.63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结算备付金人民币1,405.10元;存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金人民币884.53元。上述款将于2021年12月24日之后划入托管账户。
- (2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币219,051.82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人民币120,471.02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人民币98,580.80元。上述款项将于2021年12月24日之后划入托管账户。
- (3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币5,092,051.74元,已分别于2021年12月15日、2021年12月16日、2021年12月21日和2021年12月22日全部处置变现,成交金额(含交易费用)为人民币4,992,014.92元。
- (4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币2,790,769.40元,该款项已于2021年12月15日划入托管账户。
- (5) 本基金最后运作日应收利息为人民币1,385.58元,其中应收银行存款利息为人民币359.88元,应收保证金利息为人民币839.86元,应收备付金利息为人民币185.84元。上述款项已于2021年12月21日划入托管账户。

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2,409.64元,该款项将于2021年12月24日之后支付。
- (2) 本基金最后运作日应付证券清算款人民币3,112,992.84元,该款项已分别于2021年12月15日、2021年12月16日和2021年12月17日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币481.93元,该款项将于2021年12月24日之后支付。
- (4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币11,545.60元,该款项将于2021年12月24日之后支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币89,149.93元。其中应付律师费人民币20,000.00元,预提清算审计费人民币20,000.00元,预提中证报披露费人民币40,000.00元,预提IOPV计算发布费人民币9,149.93元。上述款项将于2021年12月24日之后支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	自2021年12月15日 至2021年12月24日 止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	284.37

2、处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	-106,823.42
清算收益小计	-106,539.05
二、清算费用	
1、交易费用（注3）	-9,983.95
清算费用小计（注4）	-9,983.95
三、清算净收益	-116,523.00

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2021年12月15日至2021年12月24日止清算期间的银行存款利息人民币184.68元，结算备付金利息为人民币1.17元，存出保证金利息为人民币98.52元。其中，银行存款利息人民币43.05元，结算备付金利息为人民币0.77元，存出保证金利息为人民币59.08元已于2021年12月21日划入托管账户，其余应收利息将于2021年12月24日之后或下一个结息日划入托管账户。

注2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出股票事项所致，包含卖出股票收益（卖出股票成交金额减去所卖出的股票在最后运作日的估值总额）以及因卖出股票而已支付的红利补税款。

注3：交易费用系清算期间处置交易性金融资产所致，其中剩余未支付交易费用人民币4,549.62元将于2021年12月24日之后支付。

注4：除上述清算费用外的其他与本次清算相关的支出由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

5、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2021年12月14日基金净资产	5,212,625.69
加：清算期间净收益	-116,523.00
二、2021年12月24日基金净资产	5,096,102.69

根据本基金的基金合同及《富国基金管理有限公司关于富国中证ESG120策略交易型开放式指数证券投资基金发生基金合同终止情形及基金财产清算的公告》，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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2021年12月24日止的剩余财产为人民币5,096,102.69元。

截至2021年12月24日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币4,982,716.49元。

6、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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

(1) 《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金清算审计报告》;

(2) 上海市通力律师事务所关于《富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金清算报告》的法律意见。

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内至基金管理人的办公场所免费查阅。

富国中证 ESG120 策略交易型开放式指数证券投资基金财产清算小组

2021 年 12 月 24 日