

# 诺安基金管理有限公司关于上证新兴产业交易型开放式指数证券投资 基金清算报告

基金管理人：诺安基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
清算报告出具日：2019年10月10日  
清算报告公告日：2019年12月13日

## 一、重要提示

上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]240号文核准募集，于2011年4月7日成立并正式运作，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》、《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等相关法律法规的有关规定，上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”，基金代码“510260”）以通讯方式召开基金份额持有人大会，权益登记日为2019年5月21日，大会投票表决时间于2019年6月27日17:00截止。大会审议并于2019年6月28日通过了《关于上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》及《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市方案说明书》。本基金于2019年7月1日进入基金财产清算程序。本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见2019年7月1日在基金管理人的网站（[www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn)）上发布的《诺安基金管理有限公司关于上证新兴产业交易型开放式指数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》及《关于上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金财产清算的公告》。

本基金清算期自2019年7月1日至2019年10月10日止。由基金管理人诺安基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和北京颐合中鸿律师事务所于2019年7月1日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，北京颐合中鸿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 上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金  
基金简称 诺安上证新兴产业 ETF  
场内简称 新兴 ETF  
基金主代码 510260  
基金运作方式 交易型开放式  
基金合同生效日 2011年4月7日  
基金管理人 诺安基金管理有限公司  
基金托管人 中国工商银行股份有限公司  
注册登记机构 中国证券登记结算有限责任公司  
基金合同存续期 不定期  
基金份额上市的证券交易所 上海证券交易所  
上市日期 2011年6月8日  
投资目标

本基金的标的指数是上证新兴产业指数。 本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

#### 投资策略

本基金主要采取完全复制策略跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。 基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的 90%。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为上证新兴产业指数收益率。

#### 风险收益特征

本基金是股票型基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金;本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

### 三、财务会计报告

#### 资产负债表(经审计)

会计主体: 上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2019年6月28日

单位: 人民币元

最后运作日

2019年6月28日

#### 资产:

银行存款 322,997.25

结算备付金 30,647.56

存出保证金 995.95

交易性金融资产 14,484,704.05

应收利息 53.15

资产总计 14,839,397.96

#### 负债:

应付管理人报酬 5,946.57

应付托管费 1,189.29

应付交易费用 7,515.03

其他负债 118,901.10

应付证券清算款 52,596.67

负债合计 186,148.66

#### 所有者权益:

实收基金 13,982,658.00

未分配利润 670,591.30

所有者权益合计 14,653,249.30

负债和所有者权益总计 14,839,397.96

### 四、清盘事项说明

#### 1、基本情况

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[2011]240号《关于核准上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》的批准,由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套

规则和《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2011年4月7日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为912,482,658.00份基金份额，其中认购资金利息折合16,800.00份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经上海证券交易所上证债字[2011]106号文核准同意，本基金于2011年6月8日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新股、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。其中，本基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%，同时为有效管理投资组合，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具，该部分资产比例不超过基金资产净值的10%。

## 2、清算原因

本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，权益登记日为2019年5月21日，大会投票表决时间于2019年6月27日17:00截止。大会审议并于2019年6月28日通过了《关于上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》及《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市方案说明书》。

本基金的基金合同自2019年6月28日终止。

## 3、清算起始日

根据基金合同的约定，本基金于2019年7月1日起进入清算期，故本基金清算起始日为2019年7月1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2019年7月1日至2019年10月10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、资产处置情况

(1)本基金最后运作日应收活期存款利息余额人民币43.21元，清算期间计提应收活期存款利息人民币29,831.54元，共计人民币29,874.75元。于2019年9月21日收到活期存款三季度结息24,158.41元，该笔结息金额于2019年9月21日划入托管账户。于清算结束日应收活期存款利息余额为5,716.34元，该款项由基金管理人诺安基金管理有限公司以自有资金垫付，并于清算期间划入托管账户。

(2)本基金最后运作日应收最低备付金利息余额为人民币9.66元，清算期间计提应收最低备付金利息人民币41.24元，共计人民币50.90元，该款项于2019年9月23日季度结息划入托管账户。

(3)本基金最后运作日应收存出保证金利息余额为人民币0.28元，清算期间计提应收存出保证金利息人民币1.71元，共计人民币1.99元。该款项于2019年9月23日季度结息划入托管账户。

(4)本基金最后运作日最低备付金人民币 30,647.56 元，清算期间最低备付金净减少人民币 30,647.56 元，该笔最低备付金于 2019 年 7 月 2 日、2019 年 8 月 2 日分别划入托管账户。

(5)本基金最后运作日存出保证金人民币 995.95 元，清算期间存出保证金净减少人民币 995.95 元，该笔存出保证金于 2019 年 8 月 2 日划入托管账户。

(6)本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 14,484,704.05 元，该金额为各只股票的最后运作日估值金额之和。其中，非停牌股票资产为人民币 13,267,591.66 元（单只非停牌股票最后运作日估值金额=该只股票最后运作日收盘价\*股票数量），停牌股票资产为人民币 1,217,112.39 元（单只停牌股票最后运作日估值金额=该只停牌股票的停牌价格\*股票数量）。具体情况如下：

①非停牌股票处置情况：

本基金最后运作日（2019 年 6 月 28 日）持有的全部非停牌股票已于 2019 年 7 月 1 日卖出，卖出所得金额共计人民币 13,554,602.07 元。

②停牌股票处置情况：

本基金最后运作日（2019 年 6 月 28 日）持有的全部停牌股票明细如下：

序号	股票名称	股票代码	数量（股）	停牌价格（人民币元）	最后运作日估值金额（人民币元）
1	*ST 信威	600485	83,421	14.59	1,217,112.39
合计					1,217,112.39

本基金持有的全部停牌股票于 2019 年 9 月 10 日卖出，卖出所得金额共计人民币 137,494.80 元。截至清算结束日（2019 年 10 月 10 日），本基金交易性金融资产余额为零。

## 2、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 5,946.57 元，该款项已于 2019 年 7 月 3 日支付。

(2)本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,189.29 元，该款项已于 2019 年 7 月 3 日支付。

(3)本基金最后运作日应付交易费用为人民币 7,515.03 元，该款项已于 2019 年 7 月 5 日支付。

(4)本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 52,596.67 元，该款项已于 2019 年 7 月 1 日支付。

(5)本基金最后运作日其他负债为人民币 118,901.10 元，其中 30,000.00 元为预提上市年费，该款项已于 2019 年 7 月 12 日支付；其中 48,901.10 元为指数使用费，该款项已于 2019 年 7 月 5 日支付；其中 40,000.00 元为持有人大会律师费，该款项已于 2019 年 7 月 5 日支付。

## 3、清算期间的清算损益情况

项目 自 2019 年 7 月 1 日至 2019 年 10 月 10 日止清算期间

### 一、清算收益

1、利息收入 - 银行存款利息收入（注 1） 27,523.78

2、股票变现收益（注 2） -786,732.62

清算收入小计 -759,208.84

### 二、清算费用

1、交易费用 27,688.51

2、律师费 40,000.00  
3、审计费 30,000.00  
4、银行汇划手续费 80.00  
清算费用小计 97,768.51

三、清算净损失 -856,977.35

注 1：利息收入系计提的自 2019 年 6 月 29 日至 2019 年 10 月 10 日的银行存款利息、最低备付金利息及存出保证金利息。

注 2：股票变现损益为本次清算期间卖出股票所得收益及因卖出股票所产生的补缴股息红利税金额。

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 2019 年 6 月 28 日基金净资产 14,653,249.30

加：清算期间净收益 -856,977.35

二、2019 年 10 月 10 日基金净资产 13,796,271.95

资产处置及负债清偿后，于清算结束日（2019 年 10 月 10 日）本基金剩余财产为人民币 13,796,271.95 元，根据本基金的基金合同约定，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基金份额比例进行分配。

清算起始日 2019 年 7 月 1 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息属份额持有人所有，清算起始日 2019 年 7 月 1 日至清算款划出日当天因支付清算相关费用及划出清算款产生的汇划费亦由份额持有人承担。基金管理人诺安基金管理有限公司以自有资金垫付人民币 30,000.00 元，并已划入托管账户，用以垫付应收活期存款利息，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

(1) 《上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金清算审计报告》；

(2) 北京颐合中鸿律师事务所关于《上证新兴产业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。

上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金财产清算小组

2019 年 12 月 13 日