

海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券 投资基金清算报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：光大证券股份有限公司

清算报告出具日期：二〇二五年六月二十七日

清算报告公告日期：二〇二五年七月十四日

§1 重要提示

海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2023】2910号文准予注册募集，《海富通中证汽车零部件主题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》”或“基金合同”）于2024年4月19日正式生效。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为光大证券股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，基金管理人于2025年5月21日至2025年6月19日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于海富通中证汽车零部件主题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》。本次基金份额持有人大会于2025年6月20日计票表决通过了《关于海富通中证汽车零部件主题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》，大会决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日定为2025年6月22日，并于2025年6月23日进入清算程序。

基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所（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，并由毕马威华振会计师事务所（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。

§2 基金产品概况

| | |
|------|----------------------------|
| 基金名称 | 海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 海富通中证汽车零部件主题ETF |

| | |
|----------------------------|--|
| 基金主代码 | 562260 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2024年4月19日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2024年5月10日 |
| 基金最后运作日(2025年06月22日)基金份额总额 | 10,331,483.00 份 |
| 投资目标 | 本基金采用被动指数化投资策略，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 | (一) 股票投资策略；(二) 债券投资策略；(三) 可转换债券和可交换债券投资策略；(四) 资产支持证券投资策略；(五) 股指期货投资策略；(六) 国债期货投资策略；(七) 股票期权投资策略；(八) 融资及转融通证券出借策略；(九) 存托凭证投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证汽车零部件主题指数收益率 |
| 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合型基金、债券型基金与货币市场基金。 同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 光大证券股份有限公司 |

§3 基金运作情况概述

海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会证监许可【2023】2910号文准予注册募集，于2024年4月19日成立并正式运作，共募集262,331,483.00份基金份额。

依据《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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，“《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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”由于本基金规模持续处于小微基金状态，为保护投资人利益，基金管理人拟定了终止基金合同并终止上市的解决方案，经与基金托管人协商一致并履行规定程序后，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于 2025 年 6 月 20 日计票表决通过了《关于海富通中证汽车零部件主题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》。

根据《基金合同》及相关公告规定，本基金的最后运作日确定为 2025 年 6 月 22 日，清算期间为 2025 年 6 月 23 日至 2025 年 6 月 27 日。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金
报告截止日：2025 年 6 月 22 日

单位：人民币元

| 资 产 | 基金最后运作日 2025年6月22日 |
|-------------|-----------------------|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 666,619.68 |
| 结算备付金 | 5.55 |
| 存出保证金 | 8,734.54 |
| 交易性金融资产 | 10,448,900.05 |
| 其中：股票投资 | 10,448,900.05 |
| 基金投资 | - |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |

| | |
|---------------|-------------------------------|
| 贵金属投资 | - |
| 衍生金融资产 | - |
| 买入返售金融资产 | - |
| 应收清算款 | - |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | - |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 11,124,259.82 |
| 负债和净资产 | 基金最后运作日 2025年6月22日 |
| 负 债： | |
| 短期借款 | - |
| 交易性金融负债 | - |
| 衍生金融负债 | - |
| 卖出回购金融资产款 | - |
| 应付清算款 | - |
| 应付赎回款 | - |
| 应付管理人报酬 | 3,571.81 |
| 应付托管费 | 714.35 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应交税费 | - |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 104,915.49 |
| 负债合计 | 109,201.65 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 10,331,483.00 |
| 未分配利润 | 683,575.17 |
| 净资产合计 | 11,015,058.17 |
| 负债和净资产总计 | 11,124,259.82 |

注：本基金最后运作日2025年6月22日，基金份额净值1.0662元，基金份额总额10,331,483.00份。

4.2 利润表

会计主体：海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金

报告期间：2025年1月1日至2025年6月22日(基金最后运作日)

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月22 日(基金最后运作日) |
|----------------------------|---|
| 一、营业总收入 | 364,329.43 |
| 利息收入 | 2,373.30 |
| 其中：存款利息收入 | 2,373.30 |
| 债券利息收入 | - |
| 资产支持证券利息收入 | - |
| 申购款利息收入 | - |
| 其他利息收入 | - |
| 投资收益(损失以“-”填列) | 625,486.97 |
| 其中：股票投资收益 | 529,219.25 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - |
| 贵金属投资收益 | - |
| 衍生工具收益 | - |
| 股利收益 | 96,267.72 |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -270,979.26 |
| 汇兑收益(损失以“-”号填列) | - |
| 其他收入(损失以“-”号填列) | 7,448.42 |
| 减：二、营业总支出 | 140,191.57 |
| 管理人报酬 | 30,313.75 |
| 托管费 | 6,062.75 |
| 销售服务费 | - |
| 利息支出 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - |
| 税金及附加 | - |
| 其他费用 | 103,815.07 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 224,137.86 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 224,137.86 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | - |

| | |
|----------|------------|
| 六、综合收益总额 | 224,137.86 |
|----------|------------|

注：本财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师王国蓓、何晨签字出具了毕马威华振审字第 2519403 号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

自 2025 年 6 月 23 日至 2025 年 6 月 27 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。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日货币资金金额 666,619.68 元，其中存放于托管账户的银行存款为 666,593.02 元，应计银行存款利息为 26.66 元。上述应计银行存款利息将于 2025 年三季度结息时全部划回托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金金额 5.55 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所最低结算备付金应计利息为 3.48 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司的深交所最低结算备付金应计利息为 2.07 元。上述款项已于 2025 年二季度结息时全部划回托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金金额 8,734.54 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所存出保证金为 5,865.18 元，应计利息为 16.19 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司的深交所存出保证金为 2,844.81 元，应计利息为 8.36 元。上述款项中存出保证金已于 2025 年 7 月初调整时全部划回托管账户；上交所和深交所存出保证金应计利息已于 2025 年二季度结息时分别划回托管账户 16.09 元和 8.08 元。剩余应计利息将于三季度存出保证金结息后划回托管账户。

5.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产为股票资产，市值为 10,448,900.05 元。股票资产已于 2025 年 6 月 24 日全部变现，卖出成交金额 10,583,777.36 元，股利收益 2,782.00 元，补缴股息红利税 8,965.58 元，交易费用 7,938.06 元。上述

变现金额已于 2025 年 6 月 25 日划回托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬 3,571.81 元，该款项已于 2025 年 6 月 24 日支付完毕。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费 714.35 元，该款项已于 2025 年 6 月 24 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日其他负债 104,915.49 元，其中包括：

5.2.3.1 应付 IOPV 计算与发布费 9,315.07 元，已于 2025 年 6 月 24 日支付完毕。

5.2.3.2 应付交易佣金 1,100.42 元，已于 2025 年 6 月 26 日支付完毕。

5.2.3.3 应付审计费 7,000.00 元，已于 2025 年 6 月 26 日支付完毕。

5.2.3.4 应付中登申赎服务费 87,500.00 元，已于 2025 年 6 月 27 日支付完毕。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 自2025年6月23日至2025年6月27日（本次清算期结束日）止 |
|---------------|-----------------------------------|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入（注 1） | 698.28 |
| 2、股票变现损益（注 2） | 120,755.67 |
| 清算收入小计 | 121,453.95 |
| 二、清算费用 | |
| 清算费用小计 | 0.00 |
| 三、清算净收益 | 121,453.95 |

注 1：利息收入金额 698.28 元，系以当前适用的利率计提的自 2025 年 6 月 23 日至 2025 年 6 月 27 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：股票变现损益为本次清算期间股票资产卖出金额与最后运作日股票资

产市值的差额，包含了股利收益、交易费用及卖出股票补缴股息红利税金额。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位：人民币元

| 项目 | 金额 |
|----------------------------------|---------------|
| 一、最后运作日 2025 年 6 月 22 日基金净资产 | 11,015,058.17 |
| 加：清算期间净收益 | 121,453.95 |
| 二、清算期结束日 2025 年 6 月 27 日基金剩余资产净值 | 11,136,512.12 |

注：截至本次清算期结束日 2025 年 6 月 27 日，本基金剩余财产 11,136,512.12 元。上述财产将根据本基金的《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日至清算款划出前一日的银行存款、最低备付金、存出保证金产生的利息亦属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，基金管理人将先行垫付尚未收回的最低结算备付金及其应计利息、存出保证金应计利息和应计银行存款利息供清盘分配使用，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。

5.5 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，报中国证监会备案并公告。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。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、《上海源泰律师事务所关于海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指

数证券投资基金清算事宜之法律意见》

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。

海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二五年六月二十七日