

国联安中证新材料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：国联安基金管理有限公司

基金托管人：国泰海通证券股份有限公司

报告送出日：二零二五年九月十日

§ 1 重要提示

国联安中证新材料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”）《关于准予国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]854 号文）注册，由国联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《国联安中证新材料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”）发售，基金合同于 2021 年 5 月 27 日生效。本基金为交易型开放式基金，存续期限为不定期。首次设立募集规模为 299,146,061.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。（由国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月变更名称而来）

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》等法律法规的规定及《基金合同》的约定，并经基金份额持有人大会于 2025 年 8 月 5 日表决通过的《关于国联安中证新材料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》，2025 年 8 月 6 日起，本基金进入基金财产清算程序。

根据上述法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金基金财产清算小组于 2025 年 8 月 6 日成立。本基金基金财产清算小组由基金管理人国联安基金管理有限公司、基金托管人国泰海通证券股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成。其中，基金管理人的授权代表为仲晓峰、张志远；基金托管人的授权代表为岳汉武；安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）会计师为石静筠、骆文慧；上海市通力律师事务所律师为陆奇、狄家璐。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国联安新材料 ETF
基金主代码	516480
交易代码	516480
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 5 月 27 日
基金最后运作日（2025 年 8	18,146,061.00 份

月 5 日) 基金份额总额	
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内,年化跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组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及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时,基金管理人可采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于:(1) 法律法规的限制;(2) 标的指数成份股流动性严重不足;(3) 标的指数的成份股票长期停牌;(4) 标的指数成份股进行配股或增发;(5) 标的指数成份股派发现金股息;(6) 其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况,导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。 对于存托凭证投资,本基金将在深入研究的基础上,通过定性分析和定量分析相结合的方式,精选出具有比较优势的存托凭证。
业绩比较基准	中证新材料主题指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司

注:基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。(由国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 4 月变更名称而来)

§ 3 基金运作情况概述

国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会《关于准予国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》(证监许可[2021]854 号文)注册,由国联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《基金合同》发售,基金合同于 2021 年 5 月 27 日生效。本基金为交易型开放式基金,存续

期限为不定期。首次设立募集规模为 299,146,061.00 份基金份额。2021 年 5 月 27 日至 2025 年 8 月 5 日期间，本基金按基金合同正常运作。

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》等法律法规的规定及《基金合同》的约定，并经基金份额持有人大会于 2025 年 8 月 5 日表决通过的《关于国联安中证新材料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》，2025 年 8 月 6 日起，本基金进入基金财产清算程序。

§ 4 财务报表

4.1 资产负债表

会计主体：国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 8 月 5 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产：		负 债：	
货币资金	523,503.72	短期借款	-
结算备付金	22,080.73	交易性金融负债	-
存出保证金	18,133.74	衍生金融负债	-
交易性金融资产	11,089,006.72	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	11,089,006.72	应付清算款	-
基金投资	-	应付赎回款	-
债券投资	-	应付管理人报酬	954.05
资产支持证券投资	-	应付托管费	190.81
贵金属投资	-	应付销售服务费	-
其他投资	-	应付投资顾问费	-
衍生金融资产	-	应交税费	-
买入返售金融资产	-	应付利润	-
应收清算款	-	递延所得税负债	-
应收股利	-	其他负债	1,794.95
应收申购款	-	负债合计	2,939.81
递延所得税资产	-	净资产：	
其他资产	-	实收基金	18,146,061.00
		其他综合收益	
		未分配利润	-6,496,275.90
		净资产合计	11,649,785.10
资产合计：	11,652,724.91	负债和净资产总计	11,652,724.91

注：本报告期的基金财务会计报告经审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

根据《国联安基金管理有限公司关于国联安中证新材料主题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》，本基金将从该公告之日起，即 2025 年 8 月 6 日进入清算程序，故本基金最后运作日为 2025 年 8 月 5 日，清算起始日为 2025 年 8 月 6 日。

本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。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，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

自 2025 年 8 月 6 日至 2025 年 8 月 21 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：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日货币资金余额为人民币 523,503.72 元，其中银行存款余额为人民币 522,169.41 元，应计利息余额为人民币 1,334.31 元。于清算结束日银行存款余额为人民币 11,832,826.11 元，应计利息余额为人民币 5,996.26 元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币 22,080.73 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金为人民币 22,072.82 元，应计结算备付金利息为人民币 7.91 元。于清算结束日存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金为人民币 94,245.45 元，应计结算备付金利息余额为人民币 21.23 元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币 18,133.74 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金为人民币 18,130.32 元，应计存出保证金利息为人民币 3.42 元。于清算结束日存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金为人民币 18,130.32 元，应计存出保证金利息余额为人民币 6.14 元。

5.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 11,089,006.72 元，全部为股票投资，已于清算期内处置变现，于清算结束日交易性金融资产余额为人民币 0.00 元。

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为人民币 954.05 元，清算期间已支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为人民币 0.00 元。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 190.81 元，清算期间已支付，于清算结束日应付托管费余额为人民币 0.00 元。

5.2.3 本基金最后运作日其他负债为人民币 1,794.95 元，其中应付交易费用为人民币 1,794.95 元，清算期间已支付，于清算结束日应付交易费用余额为人民币 0.00 元。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2025年8月6日(基金清算起始日)至2025年8月21日(基金清算结束日)止期间
一、资产处置损益	161,440.41
1.利息收入	4,677.99
其中：银行存款利息收入	4,661.95
结算备付金利息收入	13.32
保证金利息收入	2.72
2.投资收益（损失以“-”填列）	891,998.37
其中：股票投资收益	892,926.21
股利收益	-927.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-735,235.95
4.其他收入（损失以“-”号填列）	-
二、清算费用	-
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	161,440.41

注：此处的股利收益为红利补税款。

5.4 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2025年8月5日基金净资产	11,649,785.10
加：清算期间净收益	161,440.41
加：因清算期间确认的交易份额产生的净值变动	-
二、2025年8月21日基金净资产	11,811,225.51

注：本基金最后运作日基金份额总额为 18,146,061.00 份，于清算期间无变动。

资产处置及负债清偿后，截止至清算结束日本基金剩余财产为人民币 11,811,225.51 元。其中，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计人民币 11,832,826.11 元。另有银行存款应计利息人民币 5,996.26 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金人民币 94,245.45 元，应计结算备付金利息余额人民币 21.23 元。存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金人民币 18,130.32 元，应计存出保证金利息余额人民币 6.14 元。应付基金管理人在清算期内垫付资金人民币 140,000.00 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的剩余资产，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。本基金清算费用包括基金份额持有人大会费用、律师费等由国联安基金管理有限公司承担。

2025年8月22日至清算划款日前一日的银行存款、结算备付金、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，基金管理人已先行垫付尚未收回的最低结算备付金及其应计利息、存出保证金及其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向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金清算审计报告
- 2、关于《国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金清算报告》的法律意见

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

国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金 基金财产清算小组

二零二五年九月十日