

# 财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告出具日期:2024年09月09日

报告送出日期:2024年09月24日

## § 1 重要提示

财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金(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[2021]2637号注册,于2021年9月1日正式生效,本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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》和《财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)的规定,本基金于基金合同生效满三年之日(2024年9月1日)日终基金资产净值低于2亿元,出现基金合同终止事由。财通证券资产管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)自2024年9月2日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

本基金自2024年9月2日起进入清算期,由基金管理人财通证券资产管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、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成立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)对本基金清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对本基金清算报告出具法律意见。

## § 2 基金概况

|                            |  |                  |
|----------------------------|--|------------------|
| 基金名称                       | 财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金   |                  |
| 基金简称                       | 财通资管中证有色金属指数发起式  |                  |
| 基金主代码                      | 013437   |                  |
| 基金运作方式                     | 契约型开放式   |                  |
| 基金合同生效日                    | 2021年09月01日  |                  |
| 基金管理人                      | 财通证券资产管理有限公司   |                  |
| 基金托管人                      | 中国农业银行股份有限公司   |                  |
| 基金最后运作日（2024年09月01日）基金份额总额 | 25,973,488.84份   |                  |
| 投资目标                       | 本基金采用指数化投资，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。  |                  |
| 投资策略                       | 1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、可转换债券和可交换债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、参与融资及转融通证券出借业务策略；6、股指期货投资策略；7、存托凭证投资策略。 |                  |
| 业绩比较基准                     | 中证有色金属指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%  |                  |
| 风险收益特征                     | 本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。    |                  |
| 下属分级基金的基金简称                | 财通资管中证有色金属指数发起式A   | 财通资管中证有色金属指数发起式C |
| 下属分级基金的交易代码                | 013437   | 013438           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额            | 17,295,428.11份   | 8,678,060.73份    |

### § 3 基金运作情况说明

财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金(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[2021]2637号《关于准予财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式、发起式,存续期限不定,首次募集期间为2021年8月30日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集11,649,101.18元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0883号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金基金合同》于2021年9月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,649,523.48份基金份额,其中认购资金利息折合422.30份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

自2021年9月1日至2024年9月1日期间,本基金按基金合同正常运作。

本基金自2024年9月2日起进入清算期,由基金管理人财通证券资产管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、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2024年9月2日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

### § 4 财务会计报告

资产负债表(已经审计)

会计主体:财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金

报告截止日:2024年9月1日(基金最后运作日)

单位:人民币元

| 资产          | 本期末 2024 年 9 月 1 日(基金最后运作日) |
|-------------|-----------------------------|
| <b>资产:</b>  |                             |
| 银行存款        | 3,188,274.70                |
| 结算备付金       | 34,867.67                   |
| 存出保证金       | 6,363.69                    |
| 交易性金融资产     | 15,473,824.00               |
| 其中:股票投资     | 15,473,824.00               |
| 应收清算款       | 5,450,913.76                |
| <b>资产总计</b> | <b>24,154,243.82</b>        |
| <b>负债:</b>  |                             |
| 应付赎回款       | 7,084,623.43                |
| 应付管理人报酬     | 4,551.99                    |
| 应付托管费       | 2,276.00                    |
| 应付销售服务费     | 1,173.99                    |
| 其他负债        | 29,083.56                   |
| <b>负债合计</b> | <b>7,121,708.97</b>         |

|                 |                      |
|-----------------|----------------------|
| <b>净资产：</b>     |                      |
| 实收基金            | 25,973,488.84        |
| 未分配利润           | -8,940,953.99        |
| <b>净资产合计</b>    | <b>17,032,534.85</b> |
| <b>负债和净资产总计</b> | <b>24,154,243.82</b> |

注：1. 报告截止日 2024 年 9 月 1 日(基金最后运作日)，基金份额总额 25,973,488.84 份，其中财通资管中证有色金属指数发起式 A 基金份额净值 0.6564 元，份额总额 17,295,428.11 份；财通资管中证有色金属指数发起式 C 基金份额净值 0.6545 元，份额总额 8,678,060.73 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 9 月 1 日(基金最后运作日) 止期间。

## § 5 清算情况

自 2024 年 9 月 2 日至 2024 年 9 月 9 日止为本基金清算期间，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算 手续进行。截至 2024 年 9 月 9 日，各项资产负债清算情况如下：

### 一、 资产处置情况：

1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 3,188,274.70 元，其中活期存款本金为人民币 3,185,184.98 元，应计利息为人民币 3,089.72 元；截至 2024 年 9 月 9 日银行存款 余额为人民币 15,350,198.72 元，其中活期存款本金为人民币 15,345,329.62 元，应计 利息为人民币 4,869.10 元。

2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 34,867.67 元，其中上交所最低备付金本金 为人民币 18,955.19 元，应计利息为人民币 31.20 元；深交所最低备付金本金为人民币 15,858.02 元，应计利息为人民币 23.26 元；截至 2024 年 9 月 9 日结算备付金余额为人民币 66.94 元，其中应计上海结算备付金利息为人民币 38.00 元，应计深圳结算备付金 利息为人民币 28.94 元。

3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 6,363.69 元，其中上交所结算保证金本金 为人民币 3,266.18 元，应计利息为人民币 8.90 元，深交所结算保证金本金为人民币 3,080.43 元，应计利息为人民币 8.18 元；截至 2024 年 9 月 9 日存出保证金余额为人民币 7,124.40 元，其中上交所结算保证金本金为人民币 4,248.16 元，应计利息为人民币 10.34 元，深交所结算保证金本金为人民币 2,856.66 元，应计利息为人民币 9.24 元。

4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 15,473,824.00 元，已于清算期全部变现，相关证券清算款已最晚于 2024 年 9 月 5 日划入托管账户。

5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 5,450,913.76 元，该款项已于清算期间划入托管账户。

## 二、 负债清偿情况

1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 7,084,623.43 元，该款项已于 2024 年 9 月 2 日支付人民币 1,413,933.81 元，于 2024 年 9 月 3 日支付人民币 5,670,689.62 元。清算期间增加 8 月 30 日发起，9 月 2 日确认的赎回和转出申请，合计应付赎回款人民币 1,490,510.23 元，已于 2024 年 9 月 4 日支付。截至 2024 年 9 月 9 日应付赎回款余额为人民币 0.00 元。

2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 4,551.99 元，清算期间未有变动。

3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,276.00 元，清算期间未有变动。

4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,173.99 元，清算期间未有变动。

5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 29,083.56 元，其中应付交易费用人民币 3,807.44 元，应付赎回费人民币 276.12 元，预提上海证券报信息披露费人民币 25,000.00 元，上述款项中应付赎回费人民币 276.12 元已于 2024 年 9 月 2 日支付人民币 118.20 元，于 2024 年 9 月 3 日支付人民币 157.92 元。清算期间计提应付赎回费人民币 587.24 元，计提应付交易费用人民币 2,841.65 元，预提银行汇划费人民币 470.63 元，其中应付赎回费人民币 587.24 元已于 2024 年 9 月 4 日支付。截至 2024 年 9 月 9 日其他负债余额为 32,119.72 元，包括应付交易费用人民币 6,649.09 元，预提上海证券报信息披露费人民币 25,000.00 元，预提汇划费人民币 470.63 元。

## 三、 清算期清算损益情况

报告期间：2024 年 9 月 2 日-2024 年 9 月 9 日

单位：人民币元

| 项目                       | 金额                 |
|--------------------------|--------------------|
| <b>一、清算期间收入</b>          | <b>-222,628.76</b> |
| 利息收入（注 1）                | 1,794.36           |
| 投资收益（损失以“-”号填列）（注 2）     | -4,329,414.10      |
| 公允价值变动损益（损失以“-”号填列）（注 3） | 4,103,921.35       |
| 其他收入（注 4）                | 1,069.63           |
| <b>二、清算期间费用</b>          | <b>470.63</b>      |
| 其他费用（注 5）                | 470.63             |
| <b>三、清算期间净损益</b>         | <b>-223,099.39</b> |

注 1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2024 年 9 月 2 日至 2024 年 9 月 9 日止清算期间的利息收入，其中银行存款利息人民币 1,779.38 元、结算备付金利息人民币 12.48 元和存出保证金利息人民币 2.50 元。

注 2：投资收益系清算期间卖出股票事项所致。其中，卖出股票差价收入（卖出股票成交金额减去所卖出股票的初始投资成本）为人民币-4,300,264.20 元，因卖出股票而支付的红利补税款人民币 17,690.00 元以及卖出股票产生的交易费用人民币 11,459.90 元作为投资收益的扣减项。

注 3：公允价值变动收益系清算期间处置交易性金融资产事项所致，为原计入交易性金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

注 4：其他收入系清算期间的基金赎回费收入人民币 1,069.63 元。

注 5：其他费用系清算期间的预提银行汇划费人民币 470.63 元。

#### 四、清算结束后所有者权益情况说明

| 项目                                  | 金额            |
|-------------------------------------|---------------|
| <b>一、最后运作日（2024 年 9 月 1 日）基金净资产</b> | 17,032,534.85 |
| 加：清算报告期间净收益                         | -223,099.39   |
| 减：赎回金额（含费用）                         | 1,492,167.10  |
| <b>二、2024 年 9 月 9 日基金净资产</b>        | 15,317,268.36 |

赎回金额为 8 月 30 日发起的赎回、转出申请，在清算期间进行支付。

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日 2024 年 9 月 9 日，本基金剩余财产为 15,317,268.36 元。根据《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（其中，清算费用中的律师费用、审计费用由基金管理人承担）、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。2024 年 9 月 9 日后至清算款划出日前的银行存款应计利息、结算备付金应计利息及存出保证金应计利息归基金份额持有人所有。清算分配结束后，与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

#### 五、基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并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分配。

### § 6 备查文件

#### 备查文件目录

- 1、财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金清算审计报告；
- 2、关于《财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层  
浙江省杭州市上城区新业路300号中国人寿大厦2幢22层

### 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：400-116-7888

公司网址：[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)

财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金  
基金财产清算小组  
二〇二四年九月九日