

华泰柏瑞基金管理有限公司
华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开
放式指数证券投资基金
清算报告

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年6月13日

清算报告公告日：2024年6月19日

华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资 基金 清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2023 年 2 月 28 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞中证有色金属矿业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[2023]431 号）注册募集。《华泰柏瑞中证有色金属矿业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”）自 2023 年 11 月 30 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“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，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。”截至 2024 年 5 月 30 日，本基金已连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，本基金管理人将终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于 2024 年 5 月 31 日刊登了《华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后运作日为 2024 年 6 月 6 日，自 2024 年 6 月 7 日（最后运作日的次日）起进入清算程序。

基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2024 年 6 月 7 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道

中天会计师事务所（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事宜出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	有色矿业 ETF
基金代码	159693
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 30 日
最后运作日 (2024 年 6 月 6 日) 基金份额总额	5,895,798.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	1、股票的投资策略；2、存托凭证的投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货的投资策略；5、资产支持证券的投资策略；6、融资及转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证有色金属矿业主题指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持一致。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

三、基金运作情况

华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金根据 2023 年 2 月 28 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞中证有色金属矿业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[2023]431 号）注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2023 年 8 月 25 日至 2023 年 11 月 24 日期间向社会公开募集，基金合同于 2023 年 11 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 247,895,798.00 份。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“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，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。”截至 2024 年 5 月 30 日，本基金已连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，本基金管理人将终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于 2024 年 5 月 31 日刊登了《华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后运作日为 2024 年 6 月 6 日，自 2024 年 6 月 7 日（最后运作日的次日）起进入清算程序。

四、财务会计报告

1、资产负债表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024年6月6日

单位：人民币元

资产	本期末 2024年6月6日 (基金最后运作日)	上年度末 2023年12月31日
资产：		
货币资金	556,751.00	5,828,694.78
结算备付金	48,860.14	43,857.08
存出保证金	77,966.43	-
交易性金融资产	6,096,821.80	42,113,633.46
其中：股票投资	6,096,821.80	42,113,633.46
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	-	142,367.00
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,780,399.37	48,128,552.32

负债和净资产	本期末 2024年6月6日 (基金最后运作日)	上年度末 2023年12月31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	-	807,489.29
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	785.94	67,238.35
应付托管费	157.19	13,447.66
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	118,017.97	2,912,274.56
负债合计	118,961.10	3,800,449.86
净资产:		
实收基金	5,895,798.00	42,895,798.00
未分配利润	765,640.27	1,432,304.46
净资产合计	6,661,438.27	44,328,102.46
负债和净资产总计	6,780,399.37	48,128,552.32

注:

1.报告截止日 2024 年 6 月 6 日(基金最后运作日), 基金份额净值 1.1299 元, 基金份额总额 5,895,798.00 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 6 日(基金最后运作日) 止期间。

财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师单峰、胡莲莲签字出具了普华永道中天特审字(2024)第 4682 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

自 2024 年 6 月 7 日至 2024 年 6 月 13 日为止为本基金清算报告期，本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

1.1 本基金最后运作日托管户活期存款 556,171.46 元，应收活期银行存款利息为 579.54 元，上述利息按照季度结息日划至基金托管户。

1.2 本基金最后运作日结算备付金金额 48,860.14 元，其中结算备付金 48,216.11 元，应收结算备付金利息金额为 644.03 元，结算备付金按照结算规则，逐步划回托管户，上述利息按照季度结息日划至基金托管户。

1.3 本基金最后运作日存出保证金金额 77,966.43 元，其中结算保证金 77,705.45 元，应收保证金利息金额为 260.98 元，结算保证金按照结算规则，逐步划回托管户，上述利息按照季度结息日划至基金托管户。

1.4 本基金最后运作日交易性股票投资市值 6,096,821.80 元，该资产已于 2024 年 6 月 13 日全部卖出，清算金额将于次日全部划入基金托管户。

2、负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬 785.94 元，该款项于 2024 年 6 月 11 日支付。

2.2 本基金最后运作日应付托管费 157.19 元，该款项于 2024 年 6 月 11 日支付。

2.3 其他负债 118,017.97 元，其中应付交易费用 13,137.57 元，该款项将于清算资金发放日之前支付；预提费用 104,880.40 元，其中 400.00 元为预提的收盘期间可能产生的划款手续费，未使用部分将于清算资金发放日之前冲回；24,425.57 元为应付审计费，该款项待收到会计师事务所审计费发票后支付；10,000.00 元为清盘律师费，于 2024 年 6 月 11 日支付；61,803.46 元为应付信息披露费，其中 10,000.00 元已于 2024 年 6 月 7 日支付，剩余 51,803.46 元待收到报社信息披露费发票后支付；8,251.37 元为应付 IOPV 计算发布费，该款项待收到指数公司发票后支付。

3、清算费用

按照《华泰柏瑞中证有色金属矿业主题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。考虑到本基金清算的实际情况，清算过程中发生的费用主要为交易佣金、划款手续费等。

4、停止运作后的清算损益情况说明

项 目	最后运作日后一日至清算结束日： 2024年6月7日至2024年6月13日
一、营业总收入	-220,652.53
1.利息收入	76.01
其中：存款利息收入	76.01
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
证券出借利息收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	92,686.08
其中：股票投资收益	69,007.72
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	23,678.36
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-
其他投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-313,414.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、营业总支出	-
1. 管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 投资顾问费	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 信用减值损失	-

7. 税金及附加	-
8. 其他费用	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-220,652.53
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-220,652.53
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	-220,652.53

注 1：利息收入系计提的自 2024 年 6 月 7 日至 2024 年 6 月 13 日止的银行存款利息及结算备付金利息和存出保证金利息。

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 2024 年 6 月 6 日基金净资产	6,661,438.27
加：清算期间净收益	-220,652.53
减：确认赎回对净值的影响	-
二、2024 年 6 月 13 日基金资产净值	6,440,785.74

截至本次清算期结束日2024年6月13日，本基金剩余财产为6,440,785.74元。本基金剩余财产将在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。

本基金最后运作日后一日2024年6月7日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金利息亦属基金份额持有人所有，该部分利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担，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。

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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具法律意见书一并报上海证监局备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将根据法律法规及本基金的基金合同约定及时进行基金剩余财产的分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 6 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告

(2)《华泰柏瑞中证有色金属矿业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

2、存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 www.huatai-pb.com。

3、查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华泰柏瑞中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金
基金财产清算小组

清算报告出具日：2024 年 6 月 13 日