

# 华夏中证四川国企改革交易型 开放式指数证券投资基金发起式 联接基金清算报告

基金管理人:华夏基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
清算报告出具日:二〇二二年十一月二十五日  
清算报告公告日:二〇二二年十一月三十日

## 重要提示

华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“本基金”)由华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型而来,并经中国证监会2019年10月9日证监许可[2019]1881号文准予变更注册。本基金基金合同自2020年4月7日起生效,本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《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》及基金管理人于2022年9月28日发布的《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金份额持有人大会的公告》,本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议《关于华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金终止基金合同相关事项的议案》,上述议案于2022年11月1日获得通过,持有人大会决议自同日起生效。根据基金管理人于2022年11月2日发布的《华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》,本基金以2022年11月2日为最后运作日,自2022年11月3日起,本基金进入基金财产清算程序。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所和北京市天元律师事务所成立基金财产清算组履行基金财产清算程序,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,由北京市天元律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## 一、基金概况

基金名称	华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	华夏中证四川国改ETF联接	
基金主代码	006560	
各份额类别简称及基金交易代码	华夏中证四川国改ETF联接A 006560	华夏中证四川国改ETF联接C 006561
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年4月7日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	

## 二、基金运作情况

华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“本基金”)由华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型而来,并经中国证监会2019年10月9日证监许可[2019]1881号文准予变更注册。本基金基金合同自2020年4月7日起生效。

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》及基金管理人于2022年9月28日发布的《华夏基金管理有限公司关于以通讯方式召开华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金份额持有人大会的公告》,本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,审议《关于华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金终止基金合同相关事项的议案》,上述议案于2022年11月1日获得通过,持有人大会决议自同日起生效。根据基金管理人于2022年11月2日发布的《华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》,本基金以2022年11月2日为最后运作日,自2022年11月3日起,本基金进入基金财产清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间,本基金按基金合同约定正常运作。

## 三、财务会计报告

### (一)基金最后运作日资产负债表(已经审计)

会计主体:华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

报告截止日:2022年11月2日

单位:人民币元

	最后运作日 2022年11月2日
资产:	
银行存款	1,337,369.81
结算备付金	10,634.37
存出保证金	3,059.38
交易性金融资产	20,204,138.98
其中:股票投资	491,843.00
基金投资	19,712,295.98
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收清算款	2,708,742.33
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	1,921,410.00
资产总计	26,185,354.87
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	127,857.30
应付管理人报酬	34.43
应付托管费	3.44
应付销售服务费	80.53
应付投资顾问费	-
应交税费	6,380.20
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	104,041.28
负债合计	238,397.18
净资产:	
实收基金	17,201,792.38
未分配利润	8,745,165.31
净资产合计	25,946,957.69
负债和净资产总计	26,185,354.87

注:①报告截止日2022年11月2日(本基金最后运作日),本基金A类基金份额净值为1.5117元,C类基金份额净值为1.4945元,本基金基金份额总额为17,201,792.38份(其中A类基金份额13,895,543.09份,C类基金份额3,306,249.29份)。

②本基金截至最后运作日的财务报表以清算基础编制。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

#### 四、清算情况

自2022年11月3日起至2022年11月25日止为本基金清算报告期,基金财产清算组按照法律法规及《基金合同》等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。具体清算情况如下:

##### (一)清算费用

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财产中支付。

##### (二)最后运作日资产清算情况

截至清算报告期结束日(2022年11月25日),本基金最后运作日部分资产尚未收回。为了提高清算效率,及时向基金份额持有人分配剩余财产,本基金管理人以自有资金对尚未收回的结算备付金、存出保证金、银行存款应计利息进行垫付,该垫付资金将于收回款项、结息后返还给基金管理人。各项资产清算情况如下:

- 1、本基金最后运作日银行存款应计利息为人民币746.22元,已由基金管理人于2022年11月21日以自有资金垫付至托管账户。
- 2、本基金最后运作日结算备付金为人民币10,634.37元,其中期货备付金1,806.14元已于清算期间划至托管账户,剩余结算备付金8,828.23元已由基金管理人于2022年11月21日以自有资金垫付至托管账户。
- 3、本基金最后运作日存出保证金为人民币3,059.38元,已由基金管理人于2022年11月21日以自有资金垫付至托管账户。
- 4、本基金最后运作日股票投资为人民币491,843.00元,另于2022年11月3日收到最后运作日赎回目标ETF对应的股票,截至2022年11月4日均已处置变现,处置产生的清算款为人民币21,931,180.05元,已于2022年11月7日划至托管账户。
- 5、本基金最后运作日基金投资为人民币19,712,295.98元,其中最后运作日赎回的目标ETF基金份额于2022年11月3日确认,剩余部分待华夏中证四川国改ETF清算完成后注销。
- 6、本基金最后运作日应收清算款为人民币2,708,742.33元,已分别于2022年11月3日、2022年11月4日划至托管账户。
- 7、本基金最后运作日其他资产(可收退补款)为人民币1,921,410.00元,已于2022年11月7日划至托管账户。

##### (三)最后运作日负债清偿情况

- 1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币127,857.30元,该款项已分别于2022年11月3日、2022年11月4日支付。
- 2、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币34.43元,该款项已于2022年11月4日支付。
- 3、本基金最后运作日应付托管费为人民币3.44元,该款项已于2022年11月4日支付。
- 4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币80.53元,该款项已于2022年11月4日支付。
- 5、本基金最后运作日应交税费为人民币6,380.20元,该款项已于2022年11月

7日支付。

6.本基金其他负债为人民币104,041.28元,其中:应付赎回费人民币85.68元已于2022年11月3日、2022年11月4日支付,应付交易费用人民币1,955.60元已于2022年11月10日支付,预提持有人大会费人民币10,000.00元已于2022年11月11日支付,预提律师费人民币36,000.00元已于2022年11月11日支付,预提审计费人民币15,000.00元、预提信息披露费人民币41,000.00元待获取相关发票或合同后支付。

(四)本次清算报告期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	自2022年11月3日起 至2022年11月25日 止清算报告期间
一、清算收益	
1.利息收入(注1)	4,809.29
2.投资收益(注2)	1,248,440.57
3.公允价值变动损益(注3)	-1,100,768.25
4.其他收入(注4)	666.83
清算收入小计	153,148.44
二、清算费用	
1.交易费用(注5)	35,287.98
清算费用小计(注6)	35,287.98
三、清算净收益	117,860.46

表中相关项目具体说明如下:

注1:利息收入系以当前适用的利率计提的自2022年11月3日起至2022年11月25日止清算报告期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2:投资收益系基金最后运作日持有的股票资产和基金资产变现产生的收益。

注3:公允价值变动损益系基金最后运作日持有的股票资产和基金资产产生的公允价值变动损益。

注4:其他收入系最后运作日有效赎回、转换转出申请对应的赎回费归基金资产金额。

注5:交易费用系基金最后运作日持有的股票资产和基金资产变现产生的费用。

注6:本基金的清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五)截至本次清算报告期末日的剩余财产情况

单位:人民币元

项目	金额
一、最后运作日2022年11月2日基金净资产	25,946,957.69
减:最后运作日有效赎回、转换转出申请对应赎回款	507,711.15
加:清算报告期间净收益	117,860.46
二、2022年11月25日基金净资产	25,557,107.00

截至本基金清算报告期末日2022年11月25日,本基金剩余财产为人民币25,557,107.00元。自清算报告期末日次日(2022年11月26日)至本次清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。

(六)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进行剩余财产分配。

五、备查文件

(一)备查文件目录

1、《华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2022年1月1日至2022年11月2日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》

2、《华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金清算的法律意见》

(二)存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

(三)查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金财产清算组

二〇二二年十一月三十日