

广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数  
证券投资基金发起式联接基金  
清算报告

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：2021年5月20日

报告公告日期：2021年6月29日

## 目录

1. 重要提示 .....	3
2. 基金概况 .....	4
3. 基金运作情况说明 .....	5
4. 财务报告 .....	6
5. 清算事项说明 .....	7
6. 备查文件目录 .....	9

## 1. 重要提示

广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可[2017] 2172号《关于准予广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》准予募集注册，于2018年4月19日成立并正式运作。本基金基金管理人为广发基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（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》、《广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，本基金基金合同生效满三年之日，若基金资产净值低于2亿元人民币，基金合同自动终止。本基金基金合同生效日为2018年4月19日，基金合同生效满三年之日为2021年4月19日。截至2021年4月19日日终，本基金出现触发基金合同终止的上述情形（即本基金基金资产净值低于2亿元），基金管理人将终止基金合同，并按照基金合同的约定履行基金财产清算程序，本基金自2021年4月20日起进入基金财产清算程序。

2021年5月20日为本基金清算的最后一日，由基金管理人广发基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和广东广信君达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，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，广东广信君达律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 2. 基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证京津冀协同发展主题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	广发中证京津冀 ETF 联接	
基金主代码	005803	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年4月19日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
最后运作日（2021年4月19日）基金份额总额	14,851,675.81份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发中证京津冀 ETF 联接 A	广发中证京津冀 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	005803	005804
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	12,908,440.90份	1,943,234.91份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。具体投资策略包括：1、资产配置策略；2、目标 ETF 投资策略；3、股票投资策略；4、债券投资策略；5、股指期货的投资策略；6、权证投资策略；7、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证京津冀协同发展主题指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%

风险收益特征	本基金为ETF联接基金，风险与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，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。
--------	--

### 3. 基金运作情况说明

广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“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[2017]2172号《关于准予广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》的核准，由广发基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》发起，于2018年4月2日向社会公开发行募集并于2018年4月19日正式成立。首次设立募集规模为24,989,792.28份基金份额。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》、《广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，本基金基金合同生效满三年之日，若基金资产净值低于2亿元人民币，基金合同自动终止。本基金基金合同生效日为2018年4月19日，基金合同生效满三年之日为2021年4月19日。截至2021年4月19日日终，本基金出现触发基金合同终止的上述情形（即本基金基金资产净值低于2亿元），基金合同自动终止。详见基金管理人发布的《关于广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接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2021年4月19日，自2021年4月20日起进入基金财产清算程序。

## 4. 财务报告

### 4.1 基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：广发中证京津冀协同发展主题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：2021年4月19日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2021年4月19日
资产：	
银行存款	967,246.32
结算备付金	7,676.08
存出保证金	880.35
交易性金融资产	12,915,952.10
应收证券清算款	387,548.15
应收利息	343.33
其他资产	105,903.20
资产总计	14,385,549.53
负债：	
应付赎回款	724,314.55
应付管理人报酬	282.09
应付托管费	56.44
应付销售服务费	258.51
应付交易费用	1,143.06
应付税费	4.26
其他负债	9,590.79
负债合计	735,649.70
所有者权益：	
实收基金	14,851,675.81
未分配利润	-1,201,775.98
所有者权益合计	13,649,899.83
负债和所有者权益总计	14,385,549.53

注1：报告截止日2021年4月19日（基金最后运作日），本基金A类基金份额单位净值为0.9198，基金份额总额为12,908,440.90份；C类基金份额单位净值为0.9142，基金份额总额为1,943,234.91份。

注2：本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。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。

## 5. 清算事项说明

根据《广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》约定，自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。2021 年 4 月 19 日为本基金的最后运作日。本基金的清算期间为自 2021 年 4 月 20 日至 2021 年 5 月 20 日止（以下简称“清算期间”），2021 年 5 月 20 日为本基金的清算期间结束日。

于清算期间，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

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 7,676.08 元，为上海证券交易所最低备付金和深圳证券交易所最低备付金，均已于 2021 年 5 月 20 日前划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 880.35 元，为上海证券交易所结算保证金和深圳证券交易所结算保证金，将于清算结束后划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 12,915,952.10 元，其中股票投资成本总额为人民币 186,099.25 元，最后运作日估值总额为人民币 186,889.00 元；基金投资成本总额为人民币 12,590,295.52 元，最后运作日估值总额为人民币 12,729,063.10 元。以上全部交易性金融资产于 2021 年 5 月 20 日前完成变现，变现扣除已支付交易费用后产生的金额为人民币 12,784,962.69 元，已于 2021 年 5 月 20 日前划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 387,548.15 元，该款项已于 2021 年 5 月 20 日前划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收利息为人民币 343.33 元，为应收银行存款利息、应收结算备付金利息和应收保证金利息，该款项将于结息时按实际金额划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日其他资产为人民币 105,903.20 元，为上海证券交易所可收退补款，该款项已于 2021 年 5 月 20 日前划入托管账户。

### 5.2 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 724,314.55 元，该款项已于 2021 年 5 月 20 日前支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 282.09 元，该款项已于 2021 年 5 月 20 日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 56.44 元，该款项已于 2021 年 5 月 20 日前支付完毕。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 258.51 元，该款项已于 2021 年 5 月 20 日前支付完毕。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,143.06 元，待清算结束后支付。

(6) 本基金最后运作日应付税费为人民币 4.26 元，该款项已于 2021 年 5 月 20 日前支付完毕。

(7) 本基金最后运作日其他负债为人民币 9,590.79 元，主要为审计费、应付赎回费及应付转出费，其中应付赎回费及应付转出费人民币 840.79 元已于 2021 年 5 月 20 日前支付完毕，审计费人民币 8,750.00 元待清算结束后支付。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年4月20日 至2021年5月20日 止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
存款利息收入（注1）	3,293.47
公允价值变动损益（注2）（损失以“-”填列）	-139,557.33
投资收益（注3）	14,358.12
其他收入（注4）	22.23
二、费用	
交易费用	11,013.89
其他费用（注5）	10,082.00
税金及附加	32.17
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-143,011.57

注1：存款利息收入系计提的清算期间的银行存款利息、备付金利息和保证金利息。

注2：公允价值变动损益系清算期间的股票投资、基金投资产生的公允价值变动。

注3：投资收益系清算期间的股票差价收入及基金差价收入。

注4：其他收入系投资者在最后运作日申请赎回所产生的基金赎回费收入。

注5：其他费用系清算期间所产生的银行汇划费、律师费及审计费。

### 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、最后运作日基金净资产	13,649,899.83
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-143,011.57
减：基金净赎回金额（于清算期间确认的最后运作日赎回申请）	-96,487.23
二、清算结束日基金净资产	13,410,401.03

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后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 6. 备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

6.1.1 《广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金清算审计报告》

6.1.2 《关于广发基金管理有限公司广发中证京津冀协同发展主题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之法律意见书》

### 6.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

### 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。

广发中证京津冀协同发展主题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小组

二〇二一年六月二十九日