

易方达中证浙江新动能交易型开放式 指数证券投资基金 清算报告

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：二零二一年十一月二日

报告公告日期：二零二一年十一月四日

目录

1、重要提示	1
2、基金概况	2
3、基金运作情况说明	3
4、财务报告	4
5、清算事项说明	5
6、备查文件目录	8

1、重要提示

易方达中证浙江新动能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证监许可【2019】1358号文准予注册，《易方达中证浙江新动能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》”）于2020年4月27日生效。本基金基金管理人为易方达基金管理有限公司（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《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定：“《基金合同》生效后，若连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权直接终止本基金合同，该事项无须召开基金份额持有人大会进行表决。”因本基金连续超过60个工作日基金资产净值低于5000万元，触发《基金合同》约定的终止情形，为维护基金份额持有人利益，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》的相关规定和《基金合同》的相关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定依法对本基金财产进行清算并终止《基金合同》，该事项无须召开基金份额持有人大会进行表决，详见基金管理人分别于2021年8月20日、9月3日、9月10日、9月13日、9月14日、9月15日、9月16日在《证券时报》、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）、深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn>）及基金管理人官方网站（<http://www.efunds.com.cn>）发布的《关于易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金拟清算基金财产及终止基金合同的提示性公告》，以及于2021年9月17日发布的《关于易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金进入清算期及终止基金合同的公告》。

本基金最后运作日为2021年9月16日。本基金从2021年9月17日（最后运作日的次日）起进入清算期，清算期间为自2021年9月17日至2021年10月11日止。由基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2021年9月17日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，上海源泰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	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证浙江新动能ETF（QDII）
场内简称	浙江新动能ETF
基金主代码	159803
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年4月27日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
境外资产托管人	香港上海汇丰银行有限公司
基金登记结算机构	中国证券登记结算有限责任公司
基金最后运作日（2021年9月16日）基金份额总额	2,851,158.00份
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市交易日	2020年5月26日

2.2 基金产品说明

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。
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（含境内发行的存托凭证、美国存托凭证等）组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动进行相应调整，力争将年化跟踪误差控制在3%以内，主要投资策略包括股票及存托凭证投资策略、债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资融券业务策略等。
业绩比较基准	中证浙江新动能指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。

3、基金运作情况说明

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可【2019】1358号）准予注册，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》的规定公开募集。本基金《基金合同》于2020年4月27日生效，《基金合同》生效日基金份额总额为266,851,158.00份。

本基金连续超过60个工作日基金资产净值低于5000万元，触发《基金合同》约定的终止情形，为维护基金份额持有人利益，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》的相关规定和《基金合同》的相关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定依法对本基金财产进行清算并终止《基金合同》，该事项无须召开基金份额持有人大会进行表决，详见基金管理人分别于2021年8月20日、9月3日、9月10日、9月13日、9月14日、9月15日、9月16日发布的《关于易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金拟清算基金财产及终止基金合同的提示性公告》，以及于2021年9月17日发布的《关于易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金进入清算期及终止基金合同的公告》。本基金最后运作日为2021年9月16日，自2021年9月17日（最后运作日的次日）起进入清算程序。本基金于2021年9月28日终止上市。

4、财务报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021年9月16日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2021年9月16日
资产：	
银行存款	1,694,071.46
结算备付金	2,189.29
存出保证金	1,299.86
交易性金融资产	4,282,935.45
应收证券清算款	291,822.49
应收利息	658.22
应收股利	2,751.11
其他资产	12,500.00
资产总计	6,288,227.88
负债：	
应付管理人报酬	1,536.57
应付托管费	460.97
应付交易费用	3,137.06
其他负债	2,633,910.84
负债合计	2,639,045.44
所有者权益：	
实收基金	2,851,158.00
未分配利润	798,024.44
所有者权益合计	3,649,182.44
负债和所有者权益总计	6,288,227.88

注1：报告截止日2021年9月16日（基金最后运作日），易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值人民币1.2799元，基金份额2,851,158.00份，资产净值人民币3,649,182.44元。

注2：本基金的清算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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5、清算事项说明

自2021年9月17日至2021年10月11日止的清算期间，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 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。按照《基金合同》的规定清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算审计费、清算律师费将由基金管理人代为支付。

5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币2,189.29元，为上海证券交易所和深圳证券交易所备付金，该款项已于2021年10月11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1,299.86元，为上海证券交易所和深圳证券交易所结算保证金，该款项将于清算结束后收回。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币4,282,935.45元，全部为股票投资。以上全部交易性金融资产于2021年10月11日前完成变现，变现金额扣除变现时已支付的交易费用后产生的金额为人民币4,271,042.45元，该款项已于2021年10月11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291,822.49元，该款项已于2021年10月11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658.22元，为应收银行存款利息、应收结算备付金利息和应收存出保证金利息，该款项已于2021年10月11日前划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收股利为人民币2,751.11元，该款项已于2021年10月11日前划入托管账户。

(7) 本基金最后运作日其他资产为人民币12,500.00元，为待退回的注册登记费，该款项

将于清算结束后收回。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,536.57元，该款项已于2021年10月11日前支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币460.97元，该款项已于2021年10月11日前支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币3,137.06元，该款项已于2021年10月11日前支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币2,633,910.84元，其中：应付赎回替代款为人民币2,618,921.38元，该款项已于2021年10月11日前支付；应付指数使用费为人民币797.68元，应付基金份额参考净值费为人民币14,191.78元，均将于清算结束后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2021 年 9 月 17 日 至 2021 年 10 月 11 日 止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
1、存款利息收入（注1）	609.28
2、投资收益（注2）	687,659.79
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）（注2）	-694,864.37
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	-2,764.27
收入小计（损失以“-”填列）	-9,359.57
二、费用	
1、交易费用	6,355.94
2、股息红利税（注3）	555.50
费用小计	6,911.44
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-16,271.01

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：本基金于2021年9月17日卖出其持有的股票，同时将原计入该金融资产的公允价值变动转出至投资收益。

注3：股息红利税系根据《股息红利差别化纳税会计核算细则》（中基协发[2012]21号），于2021年9月17日转让交割股票后的次一交易日，根据中国证券登记结算有限公司按投资

者实际持股期限计算的应缴税额计提应缴税款。

5.5 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 2021 年 9 月 16 日基金净资产	3,649,182.44
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-16,271.01
二、2021 年 10 月 11 日基金净资产	3,632,911.43

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由基金财产承担的费用、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。

清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时进行分配。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金清算审计报告

6.1.2 关于易方达中证浙江新动能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

基金管理人处

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅

易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金基金财产清算小组

二零二一年十一月四日