

# 易方达中证浙江新动能交易型开放式指 数证券投资基金联接基金 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：二零二一年十一月二十五日

报告公告日期：二零二一年十一月二十七日

## 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.....	6
6、备查文件目录.....	9

## 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联接基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2019】1359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联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于2020年4月24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。”因本基金已连续超过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18日、9月1日、9月8日、9月9日、9月10日、9月13日、9月14日在《中国证券报》、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）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联接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15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联接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14日。本基金从2021年9月15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15日至2021年11月12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15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联接基金	
基金简称	易方达中证浙江新动能ETF联接（QDII）	
基金主代码	007813	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年4月24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	
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	
基金最后运作日（2021年9月14日）基金份额总额	1,032,659.15份	
下属分级基金的基金简称	易方达中证浙江新动能ETF联接（QDII）A	易方达中证浙江新动能ETF联接（QDII）C
下属分级基金的交易代码	007813	007814
基金最后运作日（2021年9月14日）下属分级基金的份额总额	717,601.52份	315,057.63份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达中证浙江新动能ETF的联接基金，主要通过投资于易方达中证浙江新动能ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将年化跟踪误差控制在4%以内，主要投资策略包括资产配置策略、目标ETF投资策略、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×95%+活期存款利率(税后) ×5%
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，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。本基金主要通过投资于易方达中证浙江新动能ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证浙江新动能指数的表现密切相关。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联接基金注册的批复》（证监许可【2019】1359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24日生效，《基金合同》生效日基金份额总额为210,443,900.33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18日、9月1日、9月8日、9月9日、9月10日、9月13日、9月14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联接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15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联接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14日，自2021年9月15日（最后运作日的次日）起进入清算程序。

## 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联接基金

报告截止日：2021年9月14日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2021年9月14日
<b>资产：</b>	
银行存款	376,921.17
存出保证金	546.67
交易性金融资产	654,643.19
应收证券清算款	1,322,443.55
应收利息	769.13
资产总计	2,355,323.71
<b>负债：</b>	
应付赎回款	1,184,283.71
应付管理人报酬	63.30
应付托管费	18.98
应付销售服务费	55.91
应交税费	506.08
应付证券清算款	567.06
其他负债	1,633.92
负债合计	1,187,128.96
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	1,032,659.15
未分配利润	135,535.60
所有者权益合计	1,168,194.75
负债和所有者权益总计	2,355,323.71

注1：报告截止日2021年9月14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联接基金A类基金份额的基金份额净值人民币1.1322元，基金份额717,601.52份，资产净值人民币812,468.20元，C类基金份额的基金份额净值1.1291元，基金份额315,057.63份，资产净值人民币355,726.55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15日至2021年11月12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) 本基金最后运作日存出保证金为人民币546.67元，为深圳证券交易所结算保证金，该款项已于2021年11月12日前划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币654,643.19元，全部为基金投资。以上全部交易性金融资产于2021年11月12日完成变现，变现金额为人民币637,955.81元，该款项已于2021年11月12日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币1,322,443.55元，已于2021年11月12日前实际收到人民币1,310,466.78元并划入托管账户，两者差异为赎回基金投资现金替代款差额。

(4) 本基金最后运作日应收利息为人民币769.13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11月12日前划入托管账户。

### 5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币1,184,283.71元，该款项已于2021年11月12日前支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币63.30元，该款项已于2021年11月12日前支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币18.98元，该款项已于2021年11月12日前支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币55.91元，该款项已于2021年11月12日前支付。



(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币506.08元，该款项已于2021年11月12日前支付。

(6) 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币567.06元，该款项已于2021年11月12日前支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债为人民币1,633.92元，为应付赎回费，该款项已于2021年11月12日前支付。

#### 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 15 日 至 2021 年 11 月 12 日 止清算期间
一、收益	
1、存款利息收入（注 1）	495.88
2、公允价值变动收益（损失以“-”填列）（注 2）	-94,170.26
3、投资收益（注 2）	65,506.11
4、其他收入（注 3）	130.55
收入小计（损失以“-”填列）	-28,037.72
二、费用	
费用小计	-
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-28,037.72

注1：存款利息收入系计提的清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

注2：投资收益为赎回基金投资现金替代款差额，以及于清算期间处置其持有的交易性金融资产，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的金额。

注3：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。

#### 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14日基金净资产	1,168,194.75
加：自2021年9月15日至2021年11月12日止 清算期间净收益（损失以“-”填列）	-28,037.72
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）	160,356.36

二、清算结束日2021年11月12日基金净资产	979,800.67
-------------------------	------------

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，报监管机构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联接基金清算审计报告

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联接基金清算事宜之法律意见

### 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联接基金基金财产清算小组

二零二一年十一月二十七日