

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

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：2022年11月4日

报告公告日期：2022年12月21日

目录

1. 重要提示	3
2. 基金概况	4
3. 基金运作情况说明	6
4. 财务报告	7
5. 清算事项说明	8
6. 备查文件目录	10

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（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可（2017）2171号文准予注册，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《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基金合同》约定，于2022年10月18日，本基金基金份额持有人大会表决通过了《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终止基金合同并终止上市相关事项的议案》。根据基金管理人于2022年10月19日公布的《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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金从2022年10月20日起进入清算期。基金管理人将按照本基金基金合同的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

2022年11月4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
基金简称	广发中证京津冀 ETF
场内简称	京津冀基
扩位简称	京津冀 ETF
基金主代码	512780
基金运作方式	交易型开放式
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（2022 年 10 月 19 日）基金份额总额	5,086,513.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市交易日	2018 年 5 月 24 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最小化。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的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小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保</p>

	<p>值为目的，力争提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。</p> <p>本基金可投资资产支持证券，如资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>
业绩比较基准	同期中证京津冀协同发展主题指数收益率。
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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）2171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注册的批复》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基金合同》（以下简称“基金合同”）发起，于2018年4月19日成立。首次设立募集规模为287,586,513.00份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定期。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《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基金合同》约定，于2022年10月18日，本基金基金份额持有人大会表决通过了《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终止基金合同并终止上市相关事项的议案》。根据基金管理人于2022年10月19日公布的《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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金从2022年10月20日起进入清算期。基金管理人将按照本基金基金合同的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

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

报告截止日：2022年10月19日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2022年10月19日
资产：	
银行存款	829,898.03
结算备付金	77,830.07
存出保证金	3,714.18
交易性金融资产	3,672,856.50
资产总计	4,584,298.78
负债：	
应付管理人报酬	1,756.87
应付托管费	351.37
其他负债	505,743.12
负债合计	507,851.36
净资产：	
实收基金	5,086,513.00
未分配利润	-1,010,065.58
净资产合计	4,076,447.42
负债和净资产总计	4,584,298.78

注1：报告截止日2022年10月19日（基金最后运作日），本基金基金份额单位净值为0.8014，基金份额总额为5,086,513.00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财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。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。2022年10月19日为本基金的最后运作日。本基金的清算期间为自2022年10月20日至2022年11月4日止（以下简称“清算期间”），2022年11月4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77,830.07元，为上海证券交易所、深圳证券交易所的最低备付金本金及其应计利息，其中人民币75,780.68元已于2022年11月4日前划入托管账户，剩余部分将于清算结束后划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币3,714.18元，为上海证券交易所、深圳证券交易所的结算保证金本金及其应计利息，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3,672,856.50元，全部为股票投资，成本总额为人民币4,128,291.93元，最后运作日估值总额为人民币3,672,856.50元。以上全部交易性金融资产于2022年11月4日前完成变现，变现扣除交易费用及相关税费后产生的金额为人民币3,614,533.92元，已于2022年11月4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管理人报酬为人民币1,756.87元，该款项已于2022年11月4日前支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币351.37元，该款项已于2022年11月4日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币505,743.12元，包括深圳证券交易所应退退补款人民币409,852.98元、应付交易费用人民币18,867.93元、应付指数使用费人民币1,023.53元及应付IOPV计算服务费人民币75,998.68元，均已于2022年11月4日前支付完毕。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2022年10月20日 至2022年11月4日
----	-----------------------------

	止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	610.46
公允价值变动损益（注2）	455,435.43
投资收益（注3）（损失以“-”填列）	-513,758.01
汇兑收益	-
其他收入	-
二、费用	
其他费用（注4）	10,065.00
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-67,777.12

注1：利息收入系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处置持有的股票投资同时将原计入该股票投资的公允价值变动转出至投资收益的金额。

注3：投资收益系清算期间的股票投资差价收入、交易费用及相关税费。

注4：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	4,076,447.42
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-67,777.12
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）	-
二、清算结束日基金净资产	4,008,670.30

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基金财产清算小组

二〇二二年十二月二十一日