

# 广发中证全指工业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：中国银行股份有限公司

报告出具日期：2020年7月16日

报告公告日期：2020年8月21日

## 1. 重要提示

广发中证全指工业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[2015]1447号《关于准予广发中证全指工业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》和机构部函[2016]2982号《关于广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金延期募集备案的回函》准予募集注册，于2017年6月13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》、《广发中证全指工业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2017年6月13日，基金合同生效满三年之日为2020年6月13日。由于该日为非交易日不进行基金估值，为保证估值公允以准确计算基金规模，并充分维护基金份额持有人利益，故顺延至2020年6月15日。截至2020年6月15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2020年6月16日起进入基金财产清算程序。

2020年7月16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 广发中证全指工业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 广发全指工业 ETF 联接

基金主代码 004593

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2017年6月13日

基金管理人 广发基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

最后运作日（2020年6月15日）基金份额

总额 11,491,773.52 份

基金合同存续期 不定期

下属分级基金的基金简称 广发全指工业 ETF 联接 A 广发全指工业 ETF 联接 C

下属分级基金的交易代码 004593 005692

基金最后运作日下属分级基金的份额总额 11,490,362.74 份 1,410.78 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。投资策略包括：（一）资产配置策略；（二）目标 ETF 投资策略；（三）股票投资策略；（四）债券投资策略；（五）股指期货的投资策略；（六）权证投资策略。

业绩比较基准  $95\% \times$  中证全指工业指数收益率  $+5\% \times$  银行活期存款利率（税后）

#### 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

广发中证全指工业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[2015]1447号《关于准予广发中证全指工业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》和机构部函[2016]2982号《关于广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金延期募集备案的回函》准予募集注册，于2017年6月13日成立并正式运作。基金合同生效日基金份额总额为20,990,275.48份。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》、《广发中证全指工业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2017年6月13日，基金合同生效满三年之日为2020年6月13日。由于该日为非交易日不进行基金估值，为保证估值公允以准确计算基金规模，并充分维护基金份额持有人利益，故顺延至2020年6月15日，截至2020年6月15日日终，截至2020年6月15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《关于广发中证全指工业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2020年6月15日，自2020年6月16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：广发中证全指工业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：2020年6月15日（基金最后运作日）

单位：人民币元

#### 最后运作日

2020年6月15日

#### 资产：

银行存款 624,852.25

存出保证金 259.83

交易性金融资产 8,735,290.22

应收证券清算款 153,092.55

应收利息 654.66

资产总计 9,514,149.51

#### 负债：

应付赎回款 235,477.05

应付管理人报酬 118.39

应付托管费 23.65

应付销售服务费 1.35

应付交易费用 259.59

其他负债 18,155.59

负债合计 254,035.62

所有者权益：

实收基金 11,491,773.52

未分配利润 -2,231,659.63

所有者权益合计 9,260,113.89

负债和所有者权益总计 9,514,149.51

注 1：报告截止日 2020 年 6 月 15 日（基金最后运作日），本基金 A 类基金份额单位净值为 0.8058，基金份额总额为 11,490,362.74 份；C 类基金份额单位净值为 0.8023，基金份额总额为 1,410.78 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《广发中证全指工业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。2020 年 6 月 15 日为本基金的终止日。本基金的清算期间为自 2020 年 6 月 16 日至 2020 年 7 月 16 日止（以下简称“清算期间”），2020 年 7 月 16 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）本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 8,735,290.22 元，全部为基金投资，明细如下：

基金名称 基金代码 最后运作日估值

单价 数量（单位：份） 最后运作日

成本总额

最后运作日

估值总额

广发中证全指工

业 ETF 159953 0.7679 11,375,557.00 11,506,335.91 8,735,290.22

单位：人民币元

以上全部交易性金融资产于 2020 年 7 月 14 日（含）前完成变现，交易费用为人民币 8,744.97 元，变现过程产生的应收证券清算款净额为人民币 8,879,004.12 元（含应付未付的席位佣金人民币 3,599.75 元），变现过程产生的股利收入为人民币 269.84 元，截止 2020 年 7 月 14 日已全部划入托管账户。

（2）本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 153,092.55 元，款项已于 2020 年 6 月 16 日划入托管账户。

（3）本基金最后运作日应收利息为人民币 654.66 元，为应收银行存款利息、应收清算备付金利息和应收保证金利息，款项将于结息时按实际金额划入托管账户。

#### 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 235,477.05 元，该款项已于 2020 年 7 月 16 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 118.39 元，该款项已于 2020 年 7 月 16 日前支付完毕。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币 23.65 元，该款项已于 2020 年 7 月 16 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 1.35 元，该款项已于 2020 年 7 月 16 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 259.59 元，该款项已于 2020 年 7 月 16 日前支付完毕。

(6)本基金最后运作日其他负债为人民币 18,155.59 元，主要为审计费、应付赎回费及应付转出费，该款项已于 2020 年 7 月 16 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 2020 年 6 月 16 日

至 2020 年 7 月 16 日

止清算期间

一、收益（损失以“-”填列）

存款利息收入（注 1） 2,435.34

公允价值变动损益（注 2） 2,771,045.69

投资收益（注 3）（损失以“-”填列） -2,621,916.73

其他收入（注 4） 8.91

二、费用

交易费用 8,744.97

其他费用（注 5） 10,100.00

三、清算期间净收益 132,728.24

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、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、基金差价收入及股票股利收入。

注 4：其他收入系投资者在最后运作日申请赎回、转换所产生的基金赎回费收入、基金转换费收入。

注 5：其他费用系清算期间所产生的银行手续费、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 9,260,113.89

加：清算期间净收益 132,728.24

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） 16,857.40

二、清算结束日基金净资产 9,375,984.73

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 《广发中证全指工业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全指工业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。

广发中证全指工业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 二 年八月二十一日

广发基金管理有限公司