

# 平安中债-0-5年广东省地方政府债交易型开 放式指数证券投资基金 清算报告

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二二年八月三日

清算报告公告日：二〇二二年八月四日

目 录

一、基金概况.....3

二、基金运作情况.....4

三、财务会计报告.....5

四、清算情况.....6

五、备查文件.....8

## 重要提示

平安中债-0-5年广东省地方政府债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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1601号《关于准予平安中债-0-5年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中债-0-5年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币661,375,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0335号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]433号审核同意,本基金661,493,776.00份基金份额于2020年5月29日在深交所挂牌交易。

根据《平安中债-0-5年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及基金管理人平安基金管理有限公司于2022年6月23日发布的《平安中债-0-5年广东省地方政府债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》,本基金自2022年6月24日起进入基金财产清算程序。根据以上公告内容,本基金于决议生效并公告后的下一个工作日(即2022年6月24日起)进入清算程序,基金管理人自进入清算程序之日起不再接受投资人提出的赎回等业务的申请,基金申购业务已于2022年6月22日暂停,并不再恢复。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

### 一、基金概况

|      |                               |
|------|-------------------------------|
| 基金名称 | 平安中债-0-5年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资 |
|------|-------------------------------|

|         |                      |
|---------|----------------------|
|         | 基金                   |
| 基金简称    | 平安 0-5 年广东省地方政府债 ETF |
| 基金主代码   | 159988               |
| 基金运作方式  | 交易型开放式               |
| 基金合同生效日 | 2020 年 4 月 29 日      |
| 基金管理人   | 平安基金管理有限公司           |
| 基金托管人   | 中国银行股份有限公司           |

## 二、基金运作情况

平安中债-0-5 年广东省地方政府债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(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1601 号《关于准予平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。基金基金合同于 2020 年 4 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 661,493,776.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 118,776.00 份基金份额。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]433 号审核同意,本基金 661,493,776.00 份基金份额于 2020 年 5 月 29 日在深交所挂牌交易。

自 2020 年 4 月 29 日至 2022 年 6 月 23 日期间,本基金按《基金合同》正常运作。

根据《平安中债-0-5年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及基金管理人平安基金管理有限公司于2022年6月23日发布的《平安中债-0-5年广东省地方政府债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》,本基金自2022年6月24日起进入基金财产清算程序,并根据《关于平安中债-0-5年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金终止上市交易的公告》,自2022年6月30日起终止上市。

### 三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 23 日

|               | 最后运作日<br>2022 年 6 月 23 日 |
|---------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b>   |                          |
| 银行存款          | 1,307,045.71             |
| 结算备付金         | 18,036.83                |
| 存出保证金         |                          |
| 交易类金融资产       | 10,140,498.63            |
| 其中：债券投资       | 10,140,498.63            |
| 买入返售金融资产      | 1,000,000.00             |
| 应收清算款         | -                        |
| 应收利息          | -                        |
| 应收股利          | -                        |
| 其他资产          | 50,000.00                |
| 资产合计          | <b>12,515,581.17</b>     |
| <b>负 债：</b>   |                          |
| 应付清算款         | 1,000,000.00             |
| 应付赎回款         |                          |
| 应付管理人报酬       | 1,075.28                 |
| 应付托管费         | 358.41                   |
| 应付销售服务费       |                          |
| 其他负债          | 160,282.60               |
| 负债合计          | <b>1,161,716.29</b>      |
| <b>所有者权益：</b> |                          |
| 实收基金          | 10,953,776.00            |
| 未分配利润         | 400,088.88               |
| 所有者权益合计       | <b>11,353,864.88</b>     |
| 负债与持有人权益总计：   | <b>12,515,581.17</b>     |

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 23 日(基金最后运作日)，基金份额总额 10,953,776.00 份，基金份额净值 1.0365 元。

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，所有

资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。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。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

#### 四、清算情况

本基金的本次清算期间为 2022 年 6 月 24 日至 2022 年 7 月 18 日止。基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

##### （一）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，清算费用应由基金资产清算组优先从基金财产中支付。

##### （二）最后运作日资产处置情况

- 1、本基金最后运作日银行存款 1,307,045.71 元（含应计活期银行存款利息 24.38 元），该款项由基金托管人负责保管。
- 2、本基金最后运作日结算备付金为 15,790.89 元（含应计备付金利息为 1.42 元），该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司收取并保管。
- 3、基金最后运作日期货备付金为 2,245.94 元（含应计备付金利息为 10.34 元），该款项由中信建投期货保管，该期货账户已于 2022 年 7 月 19 日销户，期货备付金余额为 2,247.75（含利息）已于 7 月 14 日全额调回托管户。
- 3、本基金最后运作日交易性金融资产全部为债券，债券市值为 10,140,498.63 元（含应计利息 64,498.63 元），已于清算期间处置变现，变现资金为 10,139,328.77 元，已于 7 月 8 日划入托管户。
- 4、本基金最后运作日其他资产 50,000.00 元，为预交尚需退回的中登登记结算费，该款项由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管户，垫付资金到账日起孳生的利息归管理人所有。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付尚未返还的结算备付金、应计活期银行存款利息、应计备付金利息、中登

尚未退回的登记结算费。

### （三）最后运作日负债清偿情况

- 1、本基金最后运作日应付清算款 1,000,000.00 元，为上海证券清算款。该款项已于 2022 年 6 月 24 日支付。
- 2、本基金最后运作日应付管理人报酬 1,075.28 元。该款项已于 2022 年 7 月 5 日支付。
- 3、本基金最后运作日应付托管费 358.41 元。该款项已于 2022 年 7 月 5 日支付。
- 4、本基金最后运作日其他负债 160,282.60 元，该款项包括应付指数使用费 5,226.62 元，预提信息披露费 57,205.98 元，预提审计费 35,000.00 元，预提持有人大会律师费 40,000.00 元，预提持有人大会公证费 10,000.00 元，应付交易费 550.00 元，预提账户维护费 12,300.00 元。其中，预提律师费已于 2022 年 7 月 12 日支付，预提持有人大会公证费已于 2022 年 7 月 12 日支付，应付指数使用费已于 2022 年 7 月 14 日支付，应付交易费用已于 2022 年 7 月 14 日支付，预提账户维护费已于 7 月 14 日支付 9,300.00 元，剩余款项截至报告日暂未支付，将在清算期后安排支付。

### （四）本次清算报告期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目                   | 清算报告期间：2022-6-24 至<br>2022-7-18 |
|----------------------|---------------------------------|
| 一、收入                 | 141.10                          |
| 1、利息收入               | 1,485.96                        |
| 其中：存款利息收入            | 1,259.76                        |
| 备付金利息收入              | 16.20                           |
| 买入返售利息收入             | 210.00                          |
| 2、投资收益（损失以“-”填列）     | -209,264.86                     |
| 3、公允价值变动损益（损失以“-”填列） | 207,920.00                      |
| 4、其他收入（损失以“-”填列）     |                                 |
| 二、费用                 | 180.00                          |
| 1、管理人报酬              | -                               |
| 2、托管费                | -                               |

|                    |        |
|--------------------|--------|
| 4、销售服务费            | -      |
| 5、税金及附加            | -      |
| 6、其他费用             | 180.00 |
| 其中：银行汇划费           | 80.00  |
| 上清所查询费             | 100    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”填列） | -38.90 |
| 减：所得税费用            | -      |
| 四、净利润（净亏损以“-”填列）   | -38.90 |

（五）截至本次清算报告期结束日的剩余财产情况

| 项目                           | 金额            |
|------------------------------|---------------|
| 一、最后运作日 2022 年 6 月 23 日基金净资产 | 11,353,864.88 |
| 加：清算报告期间净收益                  | -38.90        |
| 二、2022 年 7 月 18 日基金净资产       | 11,353,825.98 |

本基金于 2022 年 7 月 18 日剩余财产为 11,353,825.98 元，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分配给基金份额持有人。

清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息归基金份额持有人所有，因清偿基金负债产生的银行汇划费亦由基金份额持有人承担。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，于清算划款日的应收利息余额将由基金管理人以自有资金先行垫付（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。（六）基金清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具的法律意见书后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

## 五、备查文件

（一）备查文件目录

1、《平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金清算审计报告》

2、《上海源泰律师事务所关于平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金清算事宜之法律意见》

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人住所。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金财产清  
算小组

二〇二二年八月四日