

广发中证沪港深科技龙头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：中国建设银行股份有限公司

报告出具日期：2024年9月23日

报告公告日期：2024年10月31日

目录

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

1. 重要提示

广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可（2021）2447号文准予注册，于2021年8月25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”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《广发中证沪港深科技龙头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”）约定，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2021年8月25日，基金合同生效满三年之日为2024年8月25日，由于该日为非交易日，故顺延至2024年8月26日。截至2024年8月26日日终，本基金出现了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2024年8月27日起进入基金财产清算程序。

2024年9月23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、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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	广发中证沪港深科技龙头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	广发中证沪港深科技龙头 ETF 联接
基金主代码	013162
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年8月25日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
最后运作日（2024年8月26日）基金份额总额	14,881,192.71份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，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。具体包括：1. 资产配置策略；2. 目标ETF投资策略；3. 股票投资策略；4. 债券投资策略；5. 股指期货的投资策略；6. 资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证沪港深科技龙头指数（人民币）收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为ETF联接基金，风险与预期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。</p> <p>本基金将投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包</p>

	<p>括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。</p>
--	--

3. 基金运作情况说明

广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经中国证券监督管理委员会证监许可（2021）2447号《关于准予广发中证沪港深科技龙头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》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《广发中证沪港深科技龙头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》公开募集，自2021年8月16日至2021年8月23日向社会公开发行人募集并于2021年8月25日正式成立。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定期，募集资金总额为人民币15,428,534.75元。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《广发中证沪港深科技龙头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，本基金基金合同生效日为2021年8月25日，基金合同生效满三年之日为2024年8月25日，由于该日为非交易日，故顺延至2024年8月26日。截至2024年8月26日日终，本基金出现了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》。详见基金管理人发布的《关于广发中证沪港深科技龙头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2024年8月26日，自2024年8月27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：广发中证沪港深科技龙头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：2024年8月26日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2024年8月26日
资产：	
货币资金	2,699,561.42
结算备付金	7.49
存出保证金	455.56
交易性金融资产	8,912,585.44
其中：基金投资	8,912,585.44
应收清算款	309,971.71
资产总计	11,922,581.62
负债：	
应付赎回款	2,533,525.03
应付管理人报酬	275.34
应付托管费	55.09
应付销售服务费	617.01
其他负债	130.14
负债合计	2,534,602.61
净资产：	
实收基金	14,881,192.71
未分配利润	-5,493,213.70
净资产合计	9,387,979.01
负债和净资产总计	11,922,581.62

注1：报告截止日2024年8月26日（基金最后运作日），本基金A类基金份额单位净值为0.6316，C类基金份额单位净值为0.6278，A类基金份额总额为11,872,168.88份，C类基金份额总额为3,009,023.83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《广发中证沪港深科技龙头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，“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，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。”根据《关于广发中证沪港深科技龙头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》，本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 25 日，基金合同生效满三年之日为 2024 年 8 月 25 日，由于该日为非交易日，故顺延至 2024 年 8 月 26 日。截至 2024 年 8 月 26 日日终，本基金出现了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，无须召开基金份额持有人大会。

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) 本基金最后运作日货币资金为人民币 2,699,561.42 元，其中银行存款本金为人民币 2,698,618.78 元，银行存款应计利息为人民币 942.64 元。上述银行存款应计利息已于 2024 年 9 月 23 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 7.49 元，为上海证券交易所的最低备付金应计利息，将于清算结束日后划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 455.56 元，为上海证券交易所的结算保证金本金及其应计利息，将于清算结束日后划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 8,912,585.44 元，全部为基金投资，成本总额为人民币 11,910,938.48 元，已于 2024 年 9 月 23 日前完成变现，已于 2024 年 9 月 23 日前划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 309,971.71 元，已于 2024 年 9 月 23 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赎回款为人民币 2,533,525.03 元，该款项已于 2024 年 9 月 23 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 275.34 元，该款项已于 2024 年 9 月 23 日前支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币55.09元，该款项已于2024年9月23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617.01元，该款项已于2024年9月23日前支付完毕。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币130.14元，为应付赎回费，上述款项已于2024年9月23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2024年8月27日至2024年9月23日止清算期间
一、收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	961.97
公允价值变动损益（注2）	2,998,353.04
投资收益（注3）（损失以“-”填列）	-3,113,930.19
其他收入	2.36
二、费用	
其他费用（注4）	10,621.10
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	-125,233.92

注1：利息收入系清算期间的银行存款利息和保证金利息。

注2：公允价值变动损益系清算期间处置持有的基金投资同时将原计入该基金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处置交易性金融资产形成的损益。

注4：其他费用系清算期间所产生的银行汇划费、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	9,387,979.01
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）	-125,233.92
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）	445,306.72
二、清算结束日基金净资产	8,817,438.37

截至本次清算结束日，本基金剩余财产为人民币8,817,438.37元。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。自本次清算期结束之日次日至清算款划出前一日的收益和费用由基金份额持有人享有和承担。

6. 备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 《广发中证沪港深科技龙头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沪港深科技龙头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。

广发中证沪港深科技龙头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

二〇二四年十月三十一日