

广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数  
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：招商银行股份有限公司

报告出具日期：2026年4月22日

报告公告日期：2026年5月15日

# 目录

|                   |   |
|-------------------|---|
| 1. 重要提示 .....     | 2 |
| 2. 基金概况 .....     | 3 |
| 3. 基金运作情况说明 ..... | 4 |
| 4. 财务报告 .....     | 5 |
| 5. 清算事项说明 .....   | 7 |
| 6. 备查文件目录 .....   | 9 |

## 1. 重要提示

广发中证上海环交所碳中和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〔2022〕2274号文准予注册，于2023年3月28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”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《广发中证上海环交所碳中和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，无需再召开基金份额持有人大会审议决定”。本基金《基金合同》生效日为2023年3月28日，基金合同生效满三年之日为2026年3月28日，截至2026年3月28日日终，本基金基金资产净值低于2亿元人民币，触发《基金合同》终止的上述情形，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。2026年3月28日为本基金的最后运作日，清算期间为自2026年3月29日至2026年4月22日。

由基金管理人广发基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、容诚会计师事务所（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，并由容诚会计师事务所（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                             | 广发中证上海环交所碳中和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                             | 广发中证上海环交所碳中和 ETF 发起式联接            |                          |
| 基金主代码                            | 016897                            |                          |
| 基金运作方式                           | 契约型开放式                            |                          |
| 基金合同生效日                          | 2023 年 3 月 28 日                   |                          |
| 基金管理人                            | 广发基金管理有限公司                        |                          |
| 基金托管人                            | 招商银行股份有限公司                        |                          |
| 最后运作日（2026 年 3 月 28 日）<br>基金份额总额 | 12,303,783.94 份                   |                          |
| 基金合同存续期                          | 不定期                               |                          |
| 下属分级基金的基金简称                      | 广发中证上海环交所碳中和 ETF 发起式联接 A          | 广发中证上海环交所碳中和 ETF 发起式联接 C |
| 下属分级基金的交易代码                      | 016897                            | 016898                   |

### 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。   |
| 主要投资策略 | 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. 存托凭证投资策略；5. 债券投资策略；6. 金融衍生品投资策略；7. 资产支持证券投资策略；8. 参与转融通证券出借业务策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证上海环交所碳中和指数收益率×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，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

广发中证上海环交所碳中和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（2022）2274号《关于准予广发中证上海环交所碳中和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《广发中证上海环交所碳中和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，募集时间为2023年3月20日至2023年3月24日，并于2023年3月28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53,789,348.31元。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《广发中证上海环交所碳中和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，无需再召开基金份额持有人大会审议决定。”本基金《基金合同》生效日为2023年3月28日，基金合同生效满三年之日为2026年3月28日，截至2026年3月28日日终，本基金基金资产净值低于2亿元人民币，触发《基金合同》终止的上述情形，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。详见基金管理人发布的《关于广发中证上海环交所碳中和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2026年3月28日，自2026年3月29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（2026年3月28日）资产负债表（已经审计）

单位：人民币元

| 项目              | 2026年3月28日<br>(基金最后运作日) |
|-----------------|-------------------------|
| <b>资产：</b>      |                         |
| 货币资金            | 1,485,712.21            |
| 存出保证金           | 1,905.11                |
| 交易性金融资产         | 14,882,984.10           |
| 其中：基金投资         | 14,882,984.10           |
| 应收清算款           | 232,806.08              |
| <b>资产总计</b>     | <b>16,603,407.50</b>    |
| <b>负债和净资产</b>   |                         |
| <b>负债：</b>      |                         |
| 应付赎回款           | 851,733.66              |
| 应付管理人报酬         | 414.16                  |
| 应付托管费           | 82.82                   |
| 应付销售服务费         | 1,011.25                |
| 应交税费            | 19,784.92               |
| 其他负债            | 15,114.46               |
| <b>负债合计</b>     | <b>888,141.27</b>       |
| <b>净资产：</b>     |                         |
| 实收基金            | 12,303,783.94           |
| 未分配利润           | 3,411,482.29            |
| <b>净资产合计</b>    | <b>15,715,266.23</b>    |
| <b>负债和净资产总计</b> | <b>16,603,407.50</b>    |

注：报告截止日2026年3月28日（基金最后运作日），基金份额总额为12,303,783.94份，其中A类基金份额10,683,612.90份，基金份额净值1.2788元；C类基金份额1,620,171.04份，基金份额净值1.2672元。

#### 4.2 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目                   | 金额                 |
|----------------------|--------------------|
| <b>一、收入</b>          | <b>-797,305.57</b> |
| 1.利息收入               | 2,351.49           |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）     | 1,873,892.24       |
| 3.公允价值变动损益（损失以“-”填列） | -2,673,608.86      |
| 4.其他收入（损失以“-”填列）     | 59.56              |
| <b>减：二、费用</b>        | <b>7,138.05</b>    |
| 1.税金及附加              | 6,748.05           |
| 2.其他费用               | 390.00             |
| <b>三、利润总额</b>        | <b>-804,443.62</b> |
| 减：所得税费用              | -                  |
| <b>四、净收益</b>         | <b>-804,443.62</b> |

注 1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2026 年 3 月 29 日（清算开始日）至 2026 年 4 月 22 日（清算结束日）止清算期间的利息收入，包括银行存款、结算备付金、存出保证金、申购款产生的利息收入。

注 2：投资收益系清算期间卖出基金产生的差价收入及交易费用。

注 3：公允价值变动收益系清算期间处置交易性金融资产产生的，为原计入交易性金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

## 5. 清算事项说明

根据《广发中证上海环交所碳中和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，无需再召开基金份额持有人大会审议决定。”本基金基金合同生效日为2023年3月28日，基金合同生效满三年之日为2026年3月28日，截至2026年3月28日日终，本基金基金资产净值低于2亿元人民币，触发《基金合同》终止的上述情形，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。

2026年3月28日为本基金的最后运作日。本基金的清算期间为自2026年3月29日至2026年4月22日止（以下简称“清算期间”）。

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 资产负债清算情况

1. 清算期间，本基金由银行存款、存出保证金产生的利息收入归基金份额持有人所有，由基金管理人先行垫付，垫付资金孳生的利息归基金管理人所有，结息后将由托管人退还基金管理人，结息金额与截至本财务报表批准报出日止期间预估的垫付利息产生的差额也由基金管理人享有或承担。

2. 本基金于基金最后运作日持有的交易性金融资产14,882,984.10元，已全部变现。

3. 本基金于基金最后运作日已确认的应收清算款余额为232,806.08元，该款项已收到。

4. 本基金于基金最后运作日已确认的应付赎回款余额为851,733.66元，该款项已支付。

5. 本基金于基金最后运作日的应付管理人报酬为414.16元，该款项已支付。

6. 本基金于基金最后运作日的应付托管费为82.82元，该款项已支付。

7. 本基金于基金最后运作日的应付销售服务费为1,011.25元，该款项已支付。

8. 本基金于基金最后运作日的应交税费为19,784.92元，该款项已支付。

9. 本基金于基金最后运作日的其他负债为15,114.46元，包括预提审计费10,000.00元、预提律师费5,000.00元和应付赎回费114.46元，上述款项均已支付。

## 5.2 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、2026年3月28日（基金最后运作日）基金净资产        | 15,715,266.23 |
| 加：清算期间净收益                         | -804,443.62   |
| 减：清算期间确认的最后运作日赎回（含转出）申请导致的基金净资产变动 | 761,339.37    |
| 二、2026年4月22日（清算结束日）基金净资产          | 14,149,483.24 |

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进行分析。

## 6. 备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

6.1.1 《广发中证上海环交所碳中和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上海环交所碳中和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的法律意见书》

### 6.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 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。

广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数  
证券投资基金发起式联接基金基金财产清算小组

二〇二六年五月十五日