

汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资  
基金联接基金清算报告

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二二年十一月十五日

报告公告日期：二〇二二年十二月一日

# 目 录

一、重要提示 .....	1
二、基金概况 .....	2
三、基金运作情况概述 .....	4
四、财务会计报告 .....	5
五、清算情况 .....	6
六、备查文件 .....	10

## 一、重要提示

汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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【2021】1842号文注册募集,于2022年2月28日成立并正式运作,基金托管人为招商银行股份有限公司。

为更好地保护基金份额持有人的利益,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》和《汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)的有关规定,汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金管理人汇添富基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,由基金管理人召集,决定以通讯方式召开汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金份额持有人大会,审议终止本基金《基金合同》相关事宜。

本次基金份额持有人大会的表决投票时间自2022年10月15日起,至2022年10月30日17:00止(投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准),并于2022年10月31日表决通过了《关于终止汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。

根据基金管理人于2022年11月1日发布的《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接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11月1日起进入清算程序,由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司、基金托管人招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)和上海市通力律师事务所于2022年11月1日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,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

基金名称	汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	汇添富国证生物医药 ETF 联接	
各份额类别基金简称及代码	汇添富国证生物医药ETF联接 A	汇添富国证生物医药ETF联接 C
	012694	012695
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年2月28日	
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人名称	招商银行股份有限公司	
最后运作日(2022年10月31日)基金份额总额	12,986,179.21 份	
投资目标	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的最小化。	
主要投资策略	<p>本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。在正常市场情况下，本基金力争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不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；目标 ETF 的投资策略；成份股、备选成份股投资策略；</p>	

	债券投资策略；资产支持证券投资策略；股指期货投资策略；国债期货投资策略；期权投资策略；融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	国证生物医药指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为汇添富国证生物医药ETF的联接基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金通过投资目标ETF，紧密跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会《关于准予汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》（证监许可【2021】1842号文）准予注册募集，由基金管理人汇添富基金管理股份有限公司于2021年11月25日至2022年2月24日向社会公开发行募集，基金合同于2022年2月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为223,710,061.74份（含募集期间利息结转的份额）。自2022年2月28日至2022年10月31日期间，本基金按基金合同正常运作。

为更好地保护基金份额持有人的利益，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》和《基金合同》的有关规定，基金管理人经与本基金的基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，由基金管理人召集，决定以通讯方式召开汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金份额持有人大会，审议终止本基金《基金合同》相关事宜。

本次基金份额持有人大会的表决投票时间自2022年10月15日起，至2022年10月30日17:00止（投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准），并于2022年10月31日表决通过了《关于终止汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》。根据基金管理人于2022年11月1日公布的《汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接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11月1日起进入清算程序。

## 四、财务会计报告

### 1. 基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2022年10月31日（本基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2022年10月31日
<b>资 产：</b>	
银行存款	519,299.25
结算备付金	134,991.60
存出保证金	4,938.84
交易性金融资产	9,188,944.89
其中：股票投资	3,303.00
基金投资	9,185,641.89
应收证券清算款	104,395.82
资产总计	9,952,570.40
负债和净资产	最后运作日 2022年10月31日
<b>负 债：</b>	
应付赎回款	71,563.51
应付管理人报酬	1,281.12
应付托管费	256.18
应付销售服务费	1,181.20
其他负债	405.00
负债合计	74,687.01
<b>净资产：</b>	
实收基金	12,986,179.21
未分配利润	-3,108,295.82
净资产合计	9,877,883.39
负债和净资产总计	9,952,570.40

注：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《资产管理产品相关会计处理规定》等有关规定编制的。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，本清算报表并无可比期间的相关数据列示。

## 五、清算情况

本基金的清算期间为自 2022 年 11 月 01 日至 2022 年 11 月 15 日。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：

### 1、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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的清算审计费、清算律师费由基金管理人承担。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 519,299.25 元，其中托管户存款为人民币 517,747.36 元，应计银行存款利息为人民币 1,551.89 元，应计银行存款利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 134,991.60 元，其中存放于中国证券登记结算有限公司的结算备付金为人民币 9,878.54 元，已于 2022 年 11 月 2 日划入托管账户，应计结算备付金利息为人民币 29.46 元，将由基金管理人以自有资金先行垫付；存放于中信建投期货有限公司的期货结算备付金为人民币 124,813.56 元，应计期货结算备付金利息为人民币 270.04 元，该部分款项已于 2022 年 11 月 1 日划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 4,938.84 元，其中存放于中国证券登记结算有限公司的存出保证金为人民币 4,928.22 元，应计存出保证金利息为人民币 10.62 元，上述款项将由基金管理人以自有资金先行垫付。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 9,188,944.89 元，其中股票投资为人民币 3,303.00 元，于清算期间进行处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 3,513.20 元，已于清算期间划入托管账户；基金投资为人民币 9,185,641.89 元，于清算期间进行处置变现，变现产生的证券清算款为人民币



10,091,721.71 元,已于清算期间划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 104,395.82 元,该款项已于 2022 年 11 月 1 日划入托管账户。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 71,563.51 元,该款项已于 2022 年 11 月 1 日和 2022 年 11 月 2 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,281.12 元,该款项已于 2022 年 11 月 2 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 256.18 元,该款项已于 2022 年 11 月 2 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,181.20 元,该款项已于 2022 年 11 月 2 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 405.00 元,系计提的 2022 年 10 月产生的待支付银行存款汇划手续费,该款项已于 2022 年 11 月 7 日支付。

### 4、清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	自 2022 年 11 月 1 日至 2022 年 11 月 15 日止清算期间
一、清算收益	
1. 利息收入（注 1）	359.54
2. 投资收益	-1,115,479.74
3. 公允价值变动损益	2,021,767.23
清算收益小计	906,647.03
二、清算支出（注 2）	
1. 其他费用（注 3）	55.00
清算支出小计	55.00

三、清算净收益	906,592.03
---------	------------

注 1：利息收入系预提的自 2022 年 11 月 1 日起至 2022 年 11 月 15 日止清算期间的银行存款、结算备付金、存出保证金利息收入。

注 2：考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的清算审计费、清算律师费由基金管理人承担。

注 3：其他费用系自 2022 年 11 月 1 日起至 2022 年 11 月 15 日止清算期间的银行存款汇划手续费。

## 5、剩余资产分配情况说明

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 10 月 31 日基金净资产	9,877,883.39
加：清算期间净收益	906,592.03
减：基金净赎回金额（于 2022 年 11 月 1 日确认的投资者赎回申请）	11,312.62
二、清算结束日 2022 年 11 月 15 日基金净资产	10,773,162.80

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日 2022 年 11 月 15 日，本基金剩余财产为人民币 10,773,162.80 元，根据本基金的基金合同，本基金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，按基金份额持有人的基金份额比例进行分配。

自本次清算期起始日 2022 年 11 月 1 日至清算款划出前一日产生的银行存款、结算备付金、存出保证金利息归基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，该部分利息以将由基金管理人以自有资金垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

## 6、基金财产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、律师事务所出具法律意见书后，报上海证监局备案并向基金份额持有人公告。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配。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

(1) 汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算审计报告

(2) 关于《汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算报告》的法律意见书

### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

### 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。

汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金财产清算小组

二〇二二年十一月十五日