

天弘中证全指医疗保健设备与服务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：天弘基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

清算报告出具日：二〇二四年七月二十五日

清算报告公告日：二〇二四年八月五日

一、重要提示

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》、《天弘中证全指医疗保健设备与服务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》”）的有关规定，《基金合同》生效满3年之日（指自然日），若基金资产净值低于2亿元，无需召开基金份额持有人大会审议，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。

截至2024年6月29日日终，天弘中证全指医疗保健设备与服务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”）的基金资产净值低于2亿元。本基金已触发上述《基金合同》约定的自动终止情形，天弘基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）自2024年6月30日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

本基金从2024年6月30日起进入清算期，由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人华泰证券股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海源泰律师事务所于2024年7月1日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

| | | |
|--------------------|--------------------------------------|--------------------------|
| 基金名称 | 天弘中证全指医疗保健设备与服务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 | 天弘中证全指医疗保健设备与服务ETF发起式联接 | |
| 基金主代码 | 012326 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式、发起式 | |
| 基金合同生效日 | 2021年06月29日 | |
| 基金管理人 | 天弘基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 华泰证券股份有限公司 | |
| 基金最后运作日基金份额总额 | 111,390,957.59份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 天弘中证全指医疗保健设备与服务ETF发起式联接A | 天弘中证全指医疗保健设备与服务ETF发起式联接C |
| 下属分级基金的交易代码 | 012326 | 012327 |
| 基金最后运作日下属分级基金的份额总额 | 37,452,744.27份 | 73,938,213.32份 |

2、基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 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。 |
| 投资策略 | 本基金的主要投资策略包括：目标ETF投资策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略、其他金融工具投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证全指医疗保健设备与服务指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为ETF联接基金，且目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的预期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。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，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。 |

三、基金运作情况概述

天弘中证全指医疗保健设备与服务指数型发起式证券投资基金(以下简称“原基金”)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]1456号《关于准予天弘中证全指医疗保健设备与服务指数型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘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《天弘中证全指医疗保健设备与服务指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币55,363,133.56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(2021)第0598号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证全指医疗保健设备与服务指数型发起式证券投资基金基金合同》于2021年6月29日正式生效,原基金合同生效日的基金份额总额为55,376,160.75份基金份额,其中认购资金利息折合13,027.19份基金份额。

根据基金管理人天弘基金管理有限公司于2021年10月13日发布《关于天弘中证全指医疗保健设备与服务指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订基金合同的公告》,原基金变更为本基金,《天弘中证全指医疗保健设备与服务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》及其他法律文件自2021年10月13日起生效,原《天弘中证全指医疗保健设备与服务指数型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金为契约型开放式、发起式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为华泰证券股份有限公司。

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》、《基金合同》的有关规定,本基金出现了基金合同约定的终止事由,本基金管理人经与基金托管人协商一致后,决定终止基金合同并依法履行基金财产清算程序。本基金最后运作日为2024年6月29日。本基金从2024年6月30日起进入基金财产清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：天弘中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

单位：人民币元

| 资产 | 最后运作日 2024 年 6 月 29 日 |
|---------------|------------------------------|
| 资产： | |
| 货币资金 | 4,686,327.36 |
| 结算备付金 | 16,032.47 |
| 存出保证金 | 40,170.97 |
| 交易性金融资产 | 52,957,839.04 |
| 其中：股票投资 | 2,392,739.24 |
| 基金投资 | 50,565,099.80 |
| 债券投资 | — |
| 资产支持证券投资 | — |
| 贵金属投资 | — |
| 其他投资 | — |
| 衍生金融资产 | — |
| 买入返售金融资产 | — |
| 应收清算款 | 5,180,290.79 |
| 应收股利 | — |
| 应收申购款 | — |
| 递延所得税资产 | — |
| 其他资产 | — |
| 资产总计 | 62,880,660.63 |
| 负债和净资产 | 最后运作日 2024 年 6 月 29 日 |
| 负债： | |
| 短期借款 | — |
| 交易性金融负债 | — |
| 衍生金融负债 | — |

| | |
|-----------------|----------------------|
| 卖出回购金融资产款 | — |
| 应付清算款 | — |
| 应付赎回款 | 7,186,983.38 |
| 应付管理人报酬 | 2,955.89 |
| 应付托管费 | 591.16 |
| 应付销售服务费 | 7,930.65 |
| 应付投资顾问费 | — |
| 应交税费 | — |
| 应付利润 | — |
| 递延所得税负债 | — |
| 其他负债 | 36,027.18 |
| 负债合计 | 7,234,488.26 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 111,390,957.59 |
| 未分配利润 | -55,744,785.22 |
| 净资产合计 | 55,646,172.37 |
| 负债和净资产总计 | 62,880,660.63 |

注：1、报告截止日 2024 年 6 月 29 日（基金最后运作日），天弘中证全指医疗保健设备与服务 ETF 发起式联接 A 份额净值 0.5016 元，天弘中证全指医疗保健设备与服务 ETF 发起式联接 C 份额净值 0.4985 元。

2、本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师周祎、林佳璐签字出具了普华永道中天特审字（2024）第 5480 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

1、清算费用

按照《基金合同》的规定，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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、最后运作日资产处置情况

本基金最后运作日为 2024 年 6 月 29 日（周六），非基金开放日，基金份额持有人无资产处置情况。

3、停止运作后的清算损益情况说明

截至最后运作日（2024年6月29日）止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款4,686,327.36元，结算备付金16,032.47元，存出保证金40,170.97元，交易性金融资产52,957,839.04元，应收清算款5,180,290.79元，应付赎回款、赎回费、管理费、托管费、销售服务费、预提费用、应付交易费用等负债7,234,488.26元，资产净值55,646,172.37元。其中现金资产类中包含的应计利息将于每季度结息日结算入账，此后新产生的利息将在销户结息时一次性结清。

考虑到本基金清算的实际情况，在清算期间产生的银行间账户维护费、律师事务所律师费、信息披露费等其他清算费用，均由基金管理人承担，具体金额以缴费通知为准。

本基金的银行存款应计利息均为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由管理人承担。

4、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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

（1）天弘中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金2024年6月29日清算审计报告

（2）上海源泰律师事务所关于天弘中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金清算事宜之法律意见

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。

天弘中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

财产清算小组

2024年7月25日