

华安国证生物医药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：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024年9月25日

§1 重要提示

华安国证生物医药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”），由华安基金管理有限公司（以下简称“公司”、“本基金管理人”或“基金管理人”）任基金管理人，由招商银行股份有限公司任基金托管人，由华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金转型而来，系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]1724号《关于准予华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金注册的批复》的注册，本基金自2023年8月14日起正式转型。

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》《华安国证生物医药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》”或“基金合同”）的有关规定，华安国证生物医药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”）触发基金合同终止情形。

华安国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金变更而来。《华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金基金合同》生效日为2021年9月1日。《华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金基金合同》生效日起三年后的对应日为2024年9月1日。截至2024年9月1日日终，本基金的基金规模低于2亿元，触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止。本基金于2024年9月2日起进入清算程序，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。

基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2024年9月2日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（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。

§2 基金产品概况

基金名称	华安国证生物医药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	华安国证生物医药 ETF 发起式联接
基金主代码	012598
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 8 月 14 日
报告期末（2024 年 9 月 1 日）基金份额总额	137,019,638.66 份
投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争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%。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 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、股指期货投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、融资及转融通证券出借业务投资策略 8、存托凭证投资策略 9、未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	国证生物医药指数收益率×95%+商业银行税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型

	基金和混合型基金。本基金主要投资于目标 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。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

本基金是根据《华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金基金合同》以及相关法律法规的相关规定，由华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金转型而来。

根据本基金的基金管理人于 2023 年 8 月 10 日发布的《华安基金管理有限公司关于华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金变更为华安国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金于 2023 年 8 月 14 日正式转型为华安国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。自同日起，《华安国证生物医药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》和《华安国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》生效，原《华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金基金合同》和《华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金托管协议》失效。原基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 124,408,365.61 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。根据《基金合同》“第五部分 基金的存续”及“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”之“二、《基金合同》的终止事由”的约定，《华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金基金合同》生效之日起三年后的年度对应日，若本基金基金资产净值低于 2 亿元的，基金合同自动终止，不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。《华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金基金合同》生效日为 2021 年 9 月 1 日。《华安国证生物医药指数型发起式证券投资基金基金合同》生效日起三年后的对应日为 2024 年 9 月 1 日。截至 2024 年 9 月 1 日日终，本基金的基金规模低于 2 亿元，触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金

合同》自动终止，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。根据《关于华安国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金触发基金合同终止情形的公告》。本基金最后运作日为 2024 年 9 月 1 日，自 2024 年 9 月 2 日进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：华安国证生物医药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 9 月 1 日

单位：人民币元

资 产	本期末（基金最后运作日） 2024 年 9 月 1 日
资 产：	
货币资金	10,076,070.51
结算备付金	3,339.49
存出保证金	7,879.79
交易性金融资产	47,255,617.53
其中：股票投资	-
基金投资	47,255,617.53
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	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	8,799,601.32
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	491,414.88
资产总计	66,633,923.52
负债和净资产	本期末

	本期末（基金最后运作日） 2024年9月1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	134,640.10
应付赎回款	14,641,873.82
应付管理人报酬	2,431.00
应付托管费	486.19
应付销售服务费	11,549.86
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	119,865.57
负债合计	14,910,846.54
净资产：	
实收基金	137,019,638.66
其他综合收益	-
未分配利润	-85,296,561.68
净资产合计	51,723,076.98
负债和净资产总计	66,633,923.52

注 1：本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安国证生物医药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》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于基金最后运作日，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。

注 2：本财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师虞京京、梁潇签字出具了毕马威华振审字第 2413664 号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2024 年 9 月 2 日至 2024 年 9 月 20 日止清算期间，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

5.1.1 本基金最后运作日货币资金金额为 10,076,070.51 元，其中存放在托管账户为人民币 10,071,194.47 元，应收银行存款利息为人民币 4,876.04 元。应收银行存款利息由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人已于 9 月 2 日划入托管户，结息之后产生的尾差归基金管理人所有。

5.1.2 本基金最后运作日应收最低清算备付金金额为 3,339.49，其中存放在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的最低备付金金额为 3,260.74，应收利息金额为 78.75 元，该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人已于 9 月 2 日划入托管户，结息之后产生的尾差归基金管理人所有。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币 7,879.79 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算保证金 7,803.73 元，应计存出保证金利息为人民币 76.06 元。上述款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人已于 9 月 2 日划入托管户，结息之后产生的尾差归基金管理人所有。

5.1.4 本基金最后运作日持有交易性金融资产的基金投资为人民币 47,255,617.53 元。该资产已在清算期间变现完成，变现后的现金已划入基金托管户。

5.1.5 本基金最后运作日持有应收清算款金额为人民币 8,799,601.32 元，该款项为场内资产变现的资金，已在清算期间内划入基金托管户。

5.1.6 本基金最后运作日应收其他资产为人民币 491,414.88 元，该款项为基金赎回持有的交易型证券投资基金清算交收涉及的深圳可收退补款金额，已在清算期间内划入基金托管户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款金额为人民币 14,641,873.82 元，已于清算期间内完成支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 2,431.00 元，已于 9 月 18 日完成支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 486.19 元，已于 9 月 18 日完成支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费 11,549.86 元，已于 9 月 18 日完成支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付其他负债 119,865.57 元，其中应付佣金为人民币 2,513.17 元，已于 9 月 18 日完成支付。应付赎回费金额为人民币 2,040.60 元，已在清算期间内进行支付。预提审计费用 34,983.65 元，将于本基金年度财务报表审计报告出具后支付，若因本基金终止运作未出具年度财务报表审计报告，冲回该预提费用产生的收益按照基金份额持有人持有的基金份额分配给基金份额持有人。预提中国证券报信息披露费用 80,328.15 元，经与证券时报协商一致，按照 7 万元的费用进行支付，冲回该预提费用产生的收益按照基金份额持有人持有的基金份额分配给基金份额持有人。

5.2.6 本基金最后运作日应付清算款金额为人民币 134,640.10 元，为基金赎回持有的交易型证券投资基金清算交收涉及的深圳现金差额，已在清算期间内进行

支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2024年9月2日 至2024年9月20日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	6,212.39
2、其他收入（注2）	229.14
3、投资收益	-1,217,036.67
清算收入小计	-1,210,595.14
二、清算费用	
其他费用小计	-
三、清算净收益	-1,210,595.14

注 1：利息收入系计提的自 2024 年 9 月 2 日至 2024 年 9 月 20 日止清算期间的银行存款利息、最低备付金利息和结算保证金利息。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人已于 9 月 2 日划入托管户，结息之后产生的尾差归基金管理人所有。

注 2：其他收入为基金投资者赎回时产生的基金赎回费收入，已于清算期间内划入托管户。

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2024年9月1日基金净资产	51,723,076.98
加：清算期间净收益	-1,210,595.14
减：清算期间赎回款 （于2024年9月2日确认的投资者赎回申请）	3,573,446.83
二、2024年9月20日基金净资产	46,939,035.01

根据本基金的基金合同及《关于华安国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金触发基金合同终止情形的公告》的约定，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。

5.5 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。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

- 1、华安国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金清算财务报表及审计报告
- 2、关于《华安国证生物医药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》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 (<http://www.huaan.com.cn>)、中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)，清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安国证生物医药交易型开放式指数
证券投资基金发起式联接基金
基金财产清算小组

二〇二四年九月二十日（清算报告出具日）