

融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）

清算报告

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021年5月27日

公告日期：2021年5月31日

一、重要提示

融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）是由“融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金”转型而来。融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）（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”）下发的《关于准予融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2018]2135号文）准予变更，本基金的基金合同生效日为2020年11月20日。基金管理人为融通基金管理有限公司（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《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《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，截至2021年5月19日日终，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，触发了《基金合同》中约定的终止基金合同的情形。为保护投资者利益，基金管理人应当终止《基金合同》并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，且无须召开基金份额持有人大会。

本基金管理人于2021年5月20日在《中国证券报》和基金管理人网站上刊登了《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）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2021年5月19日，自2021年5月20日（最后运作日的次日）起，本基金进入清算程序，由基金管理人融通基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力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	融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）
基金简称	融通中证精准医疗主题指数（LOF）
基金主代码	161629
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2020年11月20日
基金管理人名称	融通基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
最后运作日（2021-05-19）	15,975,536.13份

基金份额总额	
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证精准医疗主题指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。
投资策略	本基金采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为导致成份股的构成及权重发生变化时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×中证精准医疗主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

三、基金运作情况

本基金基金合同自 2020 年 11 月 20 日起正式生效。2020 年 11 月 20 日至 2021 年 5 月 19 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）出现了基金合同终止事由：

根据基金合同“第五部分基金的存续”之“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，且不需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

截至 2021 年 5 月 19 日日终，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，触发了《基金合同》中约定的终止基金合同的情形。为保护投资者利益，基金管理人应当终止《基金合同》并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，且无须召开基金份额持

有人大会。根据《基金合同》约定，本基金管理人于 2021 年 5 月 20 日发布了《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）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 2021 年 5 月 19 日，从 2021 年 5 月 20 日起进入清算程序。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 5 月 19 日

单位：人民币元

资产	2021 年 5 月 19 日(基金最后运作日)
银行存款	3,663,734.28
存出保证金	20,735.50
应收利息	1,346.42
应收证券清算款	22,782,993.20
资产合计	26,468,809.40
负债	
应付管理人报酬	14,921.71
应付托管费	3,282.79
应付赎回款	2,670,109.13
应付交易费用	31,737.71
其他负债	116,516.29
负债合计	2,836,567.63
所有者权益	
实收基金	22,259,123.45
未分配利润	1,373,118.32
所有者权益合计	23,632,241.77
负债与持有人权益总计	26,468,809.40

注：报告截止日 2021 年 5 月 19 日（基金最后运作日），基金份额总额为 15,975,536.13 份，基金份额净值为 1.4793 元。

五、清算情况

自 2021 年 5 月 20 日至 2021 年 5 月 27 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，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》第二十部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”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、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 3,663,734.28 元，该款项由基金托管人负责保管；

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 20,735.50 元，该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管；

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币 1,346.42 元；

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 22,782,993.20 元，于 2021 年 5 月 20 日划入基金资产。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 14,921.71 元，该款项将于费用缴付日划出；

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,282.79 元，该款项将于费用缴付日划出；

(3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,670,109.13 元，该款项将于费用缴付日划出；

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 31,737.71 元，为应付券商佣金，该款项将于费用缴付日划出。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 116,516.29 元，其中：

应付赎回费为人民币 9,593.21 元，该款项于实际支付时扣除；

应付指数使用费为人民币 76,923.08 元，该款项于实际支付时扣除；

应付审计费为人民币 20,000.00 元，该款项于实际支付时扣除；

应付律师费为人民币 10,000.00 元，该款项于实际支付时扣除。

4、清算期间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 2021 年 5 月 19 日基金净资产	23,632,241.77

加：清算期间（2021年5月20日至2021年5月27日）收入	2,360.15
利息收入-银行存款利息收入	1,835.89
利息收入-保证金利息收入	7.52
其他收入	516.74
减：清算期间（2021年5月20日至2021年5月27日）费用	414,599.53
汇划费	359.80
股利投资（红利税扣收）	839.80
基金份额赎回产生的基金净值变动	413,399.93
二、2021年5月27日基金净资产	23,220,002.39

注：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并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，截至2021年5月27日本基金剩余财产为人民币23,220,002.39元，若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整。

2021年5月20日至清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算。2021年5月27日（含）后支付费用和划付剩余财产将发生的汇划费由基金份额持有人承担。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，清算款实际划付日由基金管理人以自有资金先行垫付上述应收款项，供清盘分配使用，待回款后再返还基金管理人。

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，并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)《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）2021年1月1日至2021年5月19日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

(2)关于《融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）清算报告》的法律意见

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。

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

2021年5月27日