

农银汇理医疗精选股票型
证券投资基金
清算报告

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：恒丰银行股份有限公司

清算报告出具日：二零二四年十一月十五日

清算报告公告日：二零二四年十一月三十日

§1 重要提示

农银汇理医疗精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会 2022 年 11 月 3 日证监许可【2022】2728 号文注册，由农银汇理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《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 207,096,642.30 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(2023)第 0243 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》于 2023 年 5 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 207,211,174.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 114,532.47 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准、注册发行的股票）、国债、金融债、地方政府债、公司债、企业债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于本基金界定的医疗主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×90%+中证全债指数收益率×10%。

根据《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、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 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止《基金合同》，并按照《基金合同》的约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会审议。”截至 2024 年 9 月 30 日日终，本基金基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元。该情形已触发《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》中约定的基金合同终止条款。基金管理人将根据相关法律法规、《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》等约定履行基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会审议。

根据《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》以及基金管理人农

银汇理基金管理有限公司于 2024 年 10 月 8 日发布的《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金发生基金合同终止情形及基金财产清算的公告》，本基金的最后运作日为 2024 年 9 月 30 日。

由基金管理人农银汇理基金管理有限公司、基金托管人恒丰银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2024 年 10 月 8 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（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律师对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金简称	农银医疗精选股票
基金主代码	017312
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年5月16日
最后运作日（2024年9月30日）基金份额总额	6,358,379.07份
投资目标	本基金精选医药领域优质企业，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，依据市场不同表现，在大类资产中进行配置，把握医疗主题相关行业的投资机会，保证整体投资业绩的持续性。</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金首先界定医疗主题及相关上市公司，再将定性分析和定量分析相结合，对反映公司质量和增长潜力的指标进行综合评估，寻找基本面扎实、估值有优势、行业地位和竞争优势突出的标的进行投资。</p> <p>（1）医疗主题的界定</p> <p>（2）股票组合构建策略</p> <p>1）行业配置策略</p> <p>2）个股投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金债券投资管理将主要采取以下策略：</p> <p>（1）合理预计利率水平</p> <p>（2）灵活调整组合久期</p>

	<p>(3) 科学配置投资品种</p> <p>(4) 谨慎选择个券</p> <p>(5) 可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。本基金在股指期货的投资中将通过对证券市场和股指期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，主要遵循避险和有效管理两项策略和原则：</p> <p>(1) 避险</p> <p>(2) 有效管理</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过分析宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p>
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×90%+中证全债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金。

§3 基金运作情况概述

农银汇理医疗精选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会 2022 年 11 月 3 日证监许可【2022】2728 号文注册，由农银汇理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《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 207,096,642.30 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(2023)第 0243 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》于 2023 年 5 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 207,211,174.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 114,532.47 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准、注册发行的股票）、国债、金融债、地方政府债、公司债、企业债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于本基金界定的医疗主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×90%+中证全债指数收益率×10%。

根据《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》以及基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2024 年 10 月 8 日发布的《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金发生基金合同终止情形及基金财产清算的公告》，本基金的最后运作日为 2024 年 9 月 30 日。

§4 财务报告

4.1 资产负债表 (已审计)

会计主体：农银汇理医疗精选股票型证券投资基金

报告截止日：2024年09月30日(最后运作日)及2024年10月28日(清算结束日)

单位：人民币元

资产	2024年9月30日 (最后运作日)	2024年10月28日 (清算结束日)
资产：		
货币资金	3,481,813.17	5,817,801.43
结算备付金	281,395.27	191,730.50
存出保证金	59,818.99	75,586.77
交易性金融资产	5,421,332.45	-
买入返售金融资产	-	-
应收清算款	1,920,938.51	-
资产总计：	11,165,298.39	6,085,118.70
负债：		
应付赎回款	5,012,578.77	-
应付管理人报酬	31,796.49	-
应付托管费	5,299.41	-
应付销售服务费	1,959.62	-
应交税费	0.86	-
其他负债	155,279.39	-
负债合计	5,206,914.54	-
净资产：		
实收资金	6,358,379.07	5,908,559.21
其他综合收益	-	-
未分配利润	-399,995.22	176,559.49
净资产合计	5,958,383.85	6,085,118.70
负债和净资产总计	11,165,298.39	6,085,118.70

注：报告截止日2024年9月30日(基金最后运作日)，基金份额总额6,358,379.07份；其中下属A类基金份额净值0.9379元，基金份额总额5,507,055.00份；下属C类基金份额净值0.9321元，基金份额总额851,324.07份。

4.2 利润表(已审计)

会计主体：农银汇理医疗精选股票型证券投资基金

报告期间：2024年10月1日(最后运作日次日)至2024年10月28日(清算结束日)

单位：人民币元

项目	2024年10月1日(最后运作日次日)至 2024年10月28日(清算结束日)止期间
一、营业总收入	558,245.19
1、利息收入	3,281.57
其中：存款利息收入	3,281.57
买入返售金融资产收入	-
2、投资收益(损失以“-”填列)	1,368,441.66
其中：股票投资收益	1,369,955.83
股利收益	-1,514.17
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-813,722.37
4、其他业务收入	244.33
二、营业总支出	10,178.38
1、其他费用	10,178.38
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	548,066.81
减：所得税费用	-
四、净利润	548,066.81

注：财务报告已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师史曼、冯适出具了德师报(审)字(24)第S00683号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

本基金的最后运作日为 2024 年 9 月 30 日,自 2024 年 10 月 1 日至 2024 年 10 月 28 日止的清算期间,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 本基金最后运作日活期存款为人民币 3,481,813.17 元,含应计利息人民币 1,410.92 元。应计活期存款利息预计将于 2024 年 12 月 23 日结息并于当日划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金金额为人民币 281,395.27 元(含应计利息,下同),为存放于中国证券登记结算有限责任公司的最低备付金及应计利息。结算备付金款项于 2024 年 10 月 15 日调整为人民币 191,618.57 元,结算备付金款项已于 2024 年 11 月 8 日划入托管账户,应计利息预计将于 2024 年 12 月 23 日划入托管账户。结算备付金应计利息款项于清算结束后以基金管理人自有资金垫付。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金金额为人民币 59,818.99 元(含应计利息,下同),为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金及应计利息。存出保证金款项于 2024 年 10 月 9 日调整为人民币 75,522.17 元;于 2024 年 11 月 4 日调整为人民币 44,993.43 元,存出保证金款项预计将于 2025 年 5 月第二个工作日划入托管账户,应计利息预计将于 2025 年 6 月 23 日划入托管账户。存出保证金应计利息款项于清算结束后以基金管理人自有资金垫付。

5.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 5,421,332.45 元,为了保护基金份

额持有人利益，截至 2024 年 10 月 09 日，本基金于基金最后运作日持有的交易性金融资产已全部卖出，扣除交易费用后的成交金额为人民币 5,977,565.91 元。

5.1.5 本基金最后运作日应收清算款人民币 1,920,938.51 元，该款项于 2024 年 10 月 08 日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款人民币 5,012,578.77 元，于 2024 年 10 月 10 日前全部支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 31,796.49 元，于 2024 年 10 月 09 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费人民币 5,299.41 元，于 2024 年 10 月 09 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费人民币 1,959.62 元，于 2024 年 10 月 09 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付税费人民币 0.86 元，于 2024 年 10 月 18 日支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债人民币 155,279.39 元。其中应付交易费用人民币 49,511.59 元，于 2024 年 10 月 18 日前全部支付；预提的审计费人民币 37,000.00 元，于 2024 年 10 月 25 日支付；预提的信息披露费人民币 59,000.00 元，于 2024 年 10 月 25 日支付；应付赎回费人民币 9,767.80 元，于 2024 年 10 月 10 日前支付。

5.2.7 本基金最后运作日无应付证券清算款。

5.2.8 本基金最后运作日无应付利息。

5.3 清算期间（2024年10月1日至2024年10月28日）的清算损益情况

5.3.1 截止至2024年10月28日的利息收入金额人民币3,281.57元，系计提的自2024年10月1日至2024年10月28日的活期存款利息收入、结算备付金利息收入和存出保证金利息收入，由基金管理人以自有资金先行垫付，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算终止日后返还给基金管理人。

5.3.2 清算期间的股票的投资收益金额人民币1,368,441.66元，其中包括本基金最后运作日持有的股票投资卖出成交总额人民币5,983,633.58元，卖出成本总额人民币4,607,610.08元，交易费用人民币6,067.67元，股利收入补税支出人民币1,514.17元。清算期间的股票公允价值变动损益金额人民币-813,722.37元，系本基金清算期间股票投资估值增值结转累计金额。

5.3.3 清算期间产生的其他收入金额人民币244.33元，其中包括归入基金资产的赎回费人民币183.44元以及归入基金资产的补差费人民币60.89元。

5.3.4 清算期间产生的其他费用金额人民币10,178.38元，其中包括律师费人民币10,000.00元，汇划费人民币178.38元。

5.3.5 按照《农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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剩余财产中支付。

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	备注
----	----	----

一、最后运作日基金净资产	5,958,383.85	2024-09-30
二、清算期间基金份额交易产生的基金净值变动数	-421,331.96	
加:申购款	0	
减:赎回款	421,331.96	
三、加:清算期间净收益(净亏损用负号表示)	548,066.81	
四、清算结束日基金净资产	6,085,118.70	2024-10-28

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、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。

资产处置及负债清偿后,本基金截至2024年10月28日(清算结束日)止的基金剩余财产为人民币6,085,118.70元。

截至2024年10月28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活期存款余额共人民币5,813,496.24元,应计活期存款利息人民币4,305.19元。结算备付金余额人民币191,306.12元,应计利息人民币424.38元,存出保证金余额人民币75,470.35元,应计利息人民币116.42元。2024年10月29日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益,加快清算速度,基金管理人将于清算款划出日以自有资金先行垫付该笔款项(该金额可能与实际结息金额存在略微差异),清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。基金管理人垫付的资金以及垫付资金产生的利息将于清算结束后返还给基金管理人。

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。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、审计报告
- 2、法律意见书

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网站：www.abc-ca.com，及中国证监会基金电子披露网站<http://eid.csrc.gov.cn/fund>。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站查阅，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。

农银汇理医疗精选股票型证券投资基金基金财产清算小组

清算报告出具日:2024年11月15日

清算报告公告日:2024年11月30日