

天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金 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：二〇二四年十二月二十日

清算报告公告日：二〇二四年十二月二十七日

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》、《天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于2亿元的，本基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定即可按照本基金合同约定的程序进行清算，并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金《基金合同》生效日为2021年12月01日，《基金合同》生效之日起三年后的对应自然日为2024年12月01日。经本基金的基金注册登记机构确认，截至2024年12月01日，本基金规模低于2亿元，触发《基金合同》终止情形，基金管理人按照《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止《基金合同》，无须召开基金份额持有人大会。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”）2024年12月02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12月02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、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）、上海源泰律师事务所于2024年12月02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	天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证新材料指数	
基金主代码	012561	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2021年12月01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	50,912,574.84份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证新材料指数A	天弘中证新材料指数C
下属分级基金的交易代码	012561	012562
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	24,324,197.09份	26,588,377.75份

2、基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）的原因，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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。主要产品投资策略包括：大类资产配置、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、其他金融工具投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证新材料主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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

天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金(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]1747号《关于准予天弘中证新材料主题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《天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购

资金利息共募集人民币 76,836,791.58 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 1126 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 76,844,382.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 7,591.12 份基金份额。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》、《天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金出现了基金合同约定的终止事由，天弘基金管理有限公司（以下简称“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 12 月 01 日。本基金从 2024 年 12 月 02 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：天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024 年 12 月 01 日
资产：	
货币资金	2,430,857.67
结算备付金	563.82
存出保证金	19,316.07
交易性金融资产	24,998,346.94
其中：股票投资	24,694,342.91
基金投资	—
债券投资	304,004.03
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	1,061,060.10
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	28,510,144.60
负债和所有者权益	最后运作日2024年12月01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	1,014,851.82
应付管理人报酬	16,438.14
应付托管费	3,287.62
应付销售服务费	3,987.25
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	69,409.41
负债合计	1,107,974.24
净资产：	
实收基金	50,912,574.84
未分配利润	-23,510,404.48
净资产合计	27,402,170.36
负债和净资产总计	28,510,144.60

注：

1、报告截止日 2024 年 12 月 01 日(基金最后运作日)，天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金 A 类基金份额净值 0.5399 元，天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金 C 类基金份额净值 0.5366 元。

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,注册会计师管祎铭、贾君宇签字出具了毕马威华振审字第 2414802 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《天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金基金合同》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、资产处置情况

截至最后运作日(2024年12月01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 2,430,857.67 元,结算备付金 563.82 元,存出保证金 19,316.07 元,应付赎回款、赎回费、管理费、托管费、预提费用等负债 1,107,974.24 元,资产净值 27,402,170.36 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。

截至 2024 年 12 月 04 日,本基金于最后运作日持有的交易性金融资产均已变现,变现金额为 25,024,463.81 元。

考虑到本基金清算的实际情况,在清算期间产生的律师事务所律师费等其他清算费用,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。

3、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(2024年12月01日)基金净资产	27,402,170.36
减:清算期间(2024年12月02日至2024年12月04日)基金净赎回金额	1,047,085.74
加:清算期间(2024年12月02日至2024年12月04日)收入	15,461.40
利息收入	2,541.45
投资收益	-10,802,466.66

公允价值变动收益	10,815,305.00
其他收入	81.61
减：清算期间（2024年12月02日至2024年12月04日）费用	—
二、2024年12月04日基金净资产	26,370,546.02

注：

- 1、资产处置后，根据《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。
- 2、投资收益为清算期间持有的交易性金融资产的处置损益，同时将原计入该金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。
- 3、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) 天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 01 日清算审计报告
- (2) 上海源泰律师事务所关于《天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金清算报告》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。

天弘中证新材料主题指数型发起式证券投资基金财产清算小组
2024 年 12 月 20 日