

长信上证港股通指数型发起式证券投资基金清算报告

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

清算报告出具日：2020年1月8日

清算报告公告日：2020年1月20日

§ 1 重要提示

长信上证港股通指数型发起式证券投资基金(以下简称本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信上证港股通指数型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]2801号及机构部函[2016]1461号文批准公开募集。本基金为契约型开放式,发起式,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为17,101,684.96份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振字第1600908号的验资报告。基金合同于2016年12月15日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《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:基金合同生效满3年之日(指自然日),若基金资产净值低于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。”

截至2019年12月14日日终,本基金的基金资产净值低于2亿元,本基金触发《基金合同》中约定的基金合同终止条款,根据《基金合同》有关约定,《基金合同》自动终止,同时不得通过召开基金份额持有人大会延续《基金合同》期限。本基金合同终止日2019年12月14日,清算期起始日为2019年12月15日。

由基金管理人长信基金管理有限责任公司、基金托管人国泰君安证券股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2019年12月15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,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长信上证港股通指数型发起式
基金主代码	519931
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月15日
报告期末(2019年12月14日)基金份额总额	18,502,001.37份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化

	风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 5%，以实现对标的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在上证港股通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化进行相应的调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，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，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×上证港股通指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与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、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2015]2801 号文《关于准予长信上证港股通指数型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于 2016 年 12 月 15 日生效，首次设立募集规模为 17,101,684.96 份基金份额。

根据《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：

“基金合同生效满 3 年之日（指自然日），若基金资产净值低于 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。”

截至 2019 年 12 月 14 日日终，本基金的基金资产净值低于 2 亿元，本基金触发《基金合同》中约定的基金合同终止条款，根据《基金合同》有关约定，《基金合同》自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续《基金合同》期限。本基金合同最后运作日 2019 年 12 月 14 日，清算期起始日为 2019 年 12 月 15 日。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

§ 4 财务报告

4.1 清算资产负债表

会计主体：长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

单位：人民币元

资产	清算结束日 2020年1月3日	最后运作日 2019年12月14日
资产：		
银行存款	21,460,055.47	1,867,149.55
交易性金融资产		20,758,851.93
其中：股票投资		20,758,851.93
应收股利		597.10
应收利息	5,257.28	8,469.19
资产总计	21,465,312.75	22,635,067.77
负债和所有者权益	清算结束日 2020年1月3日	最后运作日 2019年12月14日
负债：		
应付证券清算款		4.45
应付赎回款		509,313.68
应付管理人报酬	7,230.62	7,230.62
应付托管费	1,807.66	1,807.66
应付交易费用		4,568.48
其他负债	15,000.00	157,474.36
负债合计	24,038.28	680,399.25
所有者权益：		
实收基金	17,895,171.19	18,502,001.37
未分配利润	3,546,103.28	3,452,667.15
所有者权益合计	21,441,274.47	21,954,668.52
负债和所有者权益总计	21,465,312.75	22,635,067.77

注：1、截至最后运作日 2019 年 12 月 14 日，长信上证港股通指数型发起式资产净值为 21,954,668.52 元，基金份额总额 18,502,001.37 份，基金份额净值人民币 1.187 元。

2、本财务报告已经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师曾浩、吴凌志签字出具了德师报（审）字（20）第 S00004 号标准无保留意见的审计报告。

4.2 清算损益表

会计主体：长信上证港股通指数型发起式证券投资基金

单位：人民币元

项目	2019年12月15日 (清算开始日)至 2020年1月3日 (清算结束日)止期间
一、 收入	239,270.64
1、利息收入	5,600.70
其中：存款利息收入	5,600.70
2、投资收益(损失以“-”填列)	3,044,626.40
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-2,811,664.11
4、其他收入(损失以“-”填列)	707.65
二、 费用	32,357.29
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、交易费用	32,357.29
4、利息支出	-
5、税金及附加	-
6、其他费用	-
三、 利润总额	206,913.35
减：所得税费用	-
四、 净收益	206,913.35

§ 5 基金财产分配

自2019年12月15日至2020年1月3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 资产负债处置情况

5.1.1 本基金最后运作日股票投资人民币20,758,851.93元，于2019年12月27日已全部卖出，证券清算款已于2020年1月3日到账。

5.1.2 本基金最后运作日应付赎回款为人民币509,313.68元，该款项已于2019年12月19日前支付。

5.1.3 本基金最后运作日其他负债为人民币157,474.36元，该款项包含应付赎回费人民币1,713.49元，应付指数使用许可费人民币90,760.87元，预提指数独家使用费人民币50,000.00元及预提审计费人民币15,000.00元。其中，应付赎回费已于2019年12月19日支付，应付指数使用许可费和指数独家使用费已于2019年12月20日支付。

5.1.4 利息收入系以当前适用利率预估计提的自2019年12月15日(清算开始日)至2020年1月3日(清算结束日)期间的银行存款利息收入计人民币5,600.70元。

5.1.5 投资收益系自2019年12月15日(清算开始日)至2020年1月3日(清算结束日)止清算期间买卖股票实现的差价收入和股票投资产生的股利收益。

5.1.6 公允价值变动损益系2019年12月14日(最后运作日)所持股票自2019年12月15日(清算开始日)至2020年1月3日(清算结束日)期间的公允价值变动损益。

5.1.7 根据《长信基金管理有限责任公司关于长信上证港股通指数型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金自2019年12月15日起，停止收取基金管理费、基金托管费、指数使用费。

5.1.8 交易费用系自2019年12月15日(清算开始日)至2020年1月3日(清算结束日)止清算期间发生的交易所市场交易费计人民币32,357.29元。

5.1.9 于2020年1月3日(清算结束日)，本基金剩余资产为人民币21,441,274.47元。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(清算起始日2019年12月15日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有)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。

5.2 剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2019年12月14日基金净资产	21,954,668.52
减：2019年12月13日赎回申请于2019年12月16日确认数[注]	720,307.40
加：清算期间净收益	206,913.35
二、2020年1月3日基金净资产	21,441,274.47

注：该款项已于2019年12月19日支付。

于2020年1月3日(清算结束日)，本基金剩余资产为人民币21,441,274.47元。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(清算起始日2019年12月15日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有)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。

为保护委托人利益，加快清盘速度，管理人将垫付应收利息，管理人垫付资金孳生的利息归管理人所有。

经与基金管理人确认，本次清算的律师费用由本基金管理人承担。

5.3 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。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金2019年12月14日(最后运作日)资产负债表、2020年1月3日(清算结束日)资产负债表及清算审计报告；
- 2、《长信上证港股通指数型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信上证港股通指数型发起式证券投资基金财产清算小组

2020年1月8日