

长江优享货币市场基金

清算报告

基金管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2020年7月31日

清算报告公告日：2020年8月19日

一、重要提示

长江优享货币市场基金（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【2017】901号文《关于准予长江优享货币市场基金注册的批复》准予注册，由长江证券（上海）资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长江优享货币市场基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）及其他法律法规公开募集。经向中国证监会备案，《长江优享货币市场基金基金合同》于2017年8月11日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券（上海）资产管理有限公司，本基金的基金托管人为交通银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条的规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。根据《长江优享货币市场基金基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的“二、《基金合同》的终止事由”中约定，“有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止长江优享货币市场基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人已于2020年6月17日刊登了《长江证券（上海）资产管理有限公司关于以通讯方式召开长江优享货币市场基金基金份额持有人大会的公告》，并分别于2020年6月18日、2020年6月19日刊登了《长江证券（上海）资产管理有限公司关于以通讯方式召开长江优享货币市场基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》和《长江证券（上海）资产管理有限公司关于以通讯方式召开长江优享货币市场基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》。本次基金份额持有人大会于2020年7月21日计票，表决通过了《关于终止长江优享货币市场基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效，基金管理人于2020年7月22日刊登了《长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江优享货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金最后运作日为2020年7月22日，从2020年7月23日起进入清算期。由基金管理

人长江证券（上海）资产管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所成立的基金财产清算小组履行基金财产清算程序，基金财产清算报告由中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计并由上海市通力律师事务所出具法律意见书。

二、基金概况

基金简称	长江优享货币	
基金主代码	005016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年08月11日	
基金最后运作日（2020年7月22日）基金份额总额	23,962,909.58份	
投资目标	本基金将结合国内外环境，综合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现超越业绩比较基准的收益率。	
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金资产净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。	
业绩比较基准	中国人民银行最新公布的七天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和长期平均风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长江优享货币A	长江优享货币B
下属分级基金的交易代码	005016	005017
基金最后运作日（2020年7月22日）下属分级基金的份额总额	4,361,755.51份	19,601,154.07份

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2017】901号文注册募集。由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2017年8月7日至2017年8月9日期间向社会公开募集。基金合同于2017年8月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为999,328,027.54份，其中募集期间净认购金额999,319,683.48份，认购资金在募集期间产生的利息结转的份额8,344.06份。自2017年8月11日至2020年7月22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》、《基金合同》等有关规定，经本基金份额持有人大会2020年7月21日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于2020年7月22日刊登了《长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江优享货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金自2020年7月23日起进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长江优享货币市场基金

报告截止日：2020年7月22日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2020年7月22日	负债与持有人权益	最后运作日 2020年7月22日
资产：		负债：	
银行存款	12,927,971.93	短期借款	-
结算备付金	770,000.00	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	10,018,641.09	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	-
债券投资	10,018,641.09	应付赎回款	-
基金投资	-	应付管理人报酬	2,186.54
权证投资	-	应付托管费	728.85
资产支持证券投资	-	应付销售服务费	817.09

衍生金融工具	-	应付交易费用	-
买入返售金融资产	-	应交税费	-
应收证券清算款	-	应付利息	-
应收利息	363,384.04	应付利润	-
应收股利	-	其他负债	113,355.00
应收申购款	-	负债合计	117,087.48
其他资产	-		
		所有者权益：	
		实收基金	23,962,909.58
		未分配利润	-
		所有者权益合计	23,962,909.58
资产合计	24,079,997.06	负债和所有者权益总计	24,079,997.06

五、清算情况

自2020年7月23日至2020年7月31日止为清算期间，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：

1、清算费用

按照《长江优享货币市场基金基金合同》“第十九部分 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。”考虑到基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，清算律师费由基金管理人承担。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币770,000.00元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的最低备付金。

(2) 本基金最后运作日交易性金融资产-债券投资为人民币10,018,641.09元，该资产已于2020年7月23日全部卖出后划入托管户。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币363,384.04元，其中应收银行存款利息人民币4,949.77元，应收结算备付金利息人民币991.65元；应收债券利息人民币357,442.62元，已于2020年7月23日债券卖出后划入托管户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬人民币2,186.54元，已于2020年7月23日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费人民币728.85元，已于2020年7月23日支付。

(3) 本基金最后运作日销售服务费人民币817.09元，已于2020年7月23日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币113,355.00元，其中预提审计费人民币40,000.00元，已于2020年7月29日支付；预提信息披露费人民币70,000.00元，已于2020年7月23日支付；预提上清账户维护费及查询服务费人民币1,600.00元，已于2020年7月23日支付；预提中债账户维护费人民币1,500.00元，已于2020年7月24日支付；其他应付款人民币255.00元为预提银行汇划手续费，用于支付基金清算相关划款手续费，最终以银行实际扣款金额为准。

4、清算期间损益情况

单位：人民币元

项目	自2020年7月23日至2020年7月31日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	4,487.74
2、债券投资收益（注2）	12,193.91
清算收益小计	16,681.65
二、清算费用	
1、交易费用（注3）	25.00
2、其他费用（注4）	10.00
清算费用小计	35.00
三、清算期间净收益	16,646.65

注1：利息收入为自2020年7月23日至2020年7月31日止清算期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入。

注2：债券投资收益为清算期间卖出债券产生的价差收入。

注3：交易费用为清算期间卖出债券产生的外汇交易中心手续费，已于2020年7月31日支付。

注4：其他费用为清算期间托管户划款产生的银行汇划费。

5、资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项 目	金 额
一、最后运作日 2020 年 7 月 22 日基金净资产	23,962,909.58
加：清算期间净收益	16,646.65
减：2020 年 7 月 23 日确认的净赎回款	26,670.40
二、清算结束日 2020 年 7 月 31 日基金净资产	23,952,885.83

注：资产处置及负债清偿后，截至2020年7月31日本基金剩余财产为人民币23,952,885.83元。根据基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、缴纳所欠税款并清偿基金债务后，将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日2020年7月23日至清算款划出日前一日产生的存款利息亦属于基金份额持有人所有，以上利息均按当前适用的利率预估。基金管理人将于清算款划出日前以自有资金划入托管账户用以垫付结算备付金、应收银行存款利息及应收结算备付金利息等，基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

6、基金财产清算的公告

本清算报告已经基金托管人复核，经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，将报中国证监会备案并公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

(1) 长江优享货币市场基金清算审计报告；

(2) 《上海市通力律师事务所关于〈长江优享货币市场基金清算报告〉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。

长江优享货币市场基金基金财产清算小组

二〇二〇年八月十九日