

长盛中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金 清算报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2021 年 11 月 12 日

清算报告公告日期：2021 年 11 月 17 日

一、重要提示

长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经2019年11月27日中国证券监督管理委员会证监许可〔2019〕2584号文注册募集，于2020年6月19日成立并正式运作，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

根据《长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《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个工作日出现上述情形的，直接终止《基金合同》，且无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10月29日日终，本基金已连续50个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现《基金合同》终止事由后依法履行基金财产清算程序。本基金管理人确定2021年10月29日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2021年10月30日）起本基金进入基金财产清算程序。《基金合同》终止及基金财产清算安排详见2021年10月30日刊登在《中国证券报》和本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《长盛基金管理有限公司关于长盛中债1-3年政策性金融债指数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2021年10月30日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人工商银行、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2021年10月30日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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

基金名称	长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金
基金简称	长盛中债1-3年政金债
基金代码	A类：008679 C类：008680
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年6月19日
基金最后运作日（2021年10月29日）基金份额总额	2,515,445.17份
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。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	<p>1、完全复制策略 本基金主要采取完全复制法构建基金债券投资组合，并根据标的指数成份债券及其权重的变动而进行相应的调整。</p> <p>2、替代性策略 当成份债券市场流动性不足或因法规规定本基金不能投资关联方债券等情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资备选成份债券为主，并辅以非成份债券等金融工具来构建替代组合进行跟踪复制。</p> <p>在正常市场情况下，基金管理人力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	中债1-3年政策性金融债指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经2019年11月27日中国证券监督管理委员会证监许可〔2019〕2584号文注册募集，于2020年6月19日成立并正式运作，首次设立募集规模为1,950,387,131.04份基金份额（含利息结转份额）。

根据《长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《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个工作日出现上述情形的，直接终止《基金合同》，且无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10月29日日终，本基金已连续50个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现《基金合同》终止事由后依法进入基金财产清算程序。本基金管理人确定2021年10月29日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2021年10月30日）起本基金进入基金财产清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金

报告截止日：2021年10月29日（基金最后运作日）

科目名称	基金终止日 (2021年10月29日)
资 产:	
银行存款	636,362.20
交易性金融资产	2,189,360.00

其中：债券投资	2,189,360.00
应收利息	29,983.87
应收申购款	615.05
资产总计	2,856,321.12
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	1,025.30
应付管理人报酬	338.69
应付托管费	112.89
应付销售服务费	4.76
应付交易费用	150.25
其他负债	121,789.25
负债合计	123,421.14
所有者权益：	
实收基金	2,515,445.17
未分配利润	217,454.81
所有者权益合计	2,732,899.98
负债及所有者权益总计	2,856,321.12

注：截至2021年10月29日(基金最后运作日)，长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金份额总额为：2,515,445.17份，其中长盛中债1-3年政金债A类份额净值为1.0873元，基金份额2,461,763.36份，长盛中债1-3年政金债C类份额净值为1.0495元，基金份额53,681.81份。

五、清算情况

自2021年10月30日至2021年11月12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：

1、清算费用

按照《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”的约定，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。

考虑到本基金清算的实际情况，并从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算费用将由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币636,362.20元。

(2) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币2,189,360.00元，全部为债券投资，明细如下：

单位：人民币元

交易平台	债券名称	债券代码	最后运作日 估值单价	数量(单 位：张)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额	最后运作日 应收利息
银行间	20农发02	200402	99.36	21,000	2,087,364.30	2,086,560.00	26,833.97
银行间	18国开04	180204	102.80	1,000	103,092.20	102,800.00	2,839.70
合计					2,190,456.50	2,189,360.00	29,673.67

以上债券资产已于清算期间内处置变现，处置损益人民币190.60元，交易费用人民币305.50元，清算期债券利息收入人民币405.43元，变现产生的银行存款为人民币2,219,629.70元。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币29,983.87元，其中应收银行存款利息人民币196.00元，应收结算备付金利息人民币114.20元，应收债券利息人民币29,673.67元。清算期间银行存款产生应收利息人民币297.86元，交易性金融资产产生应收债券利息人民币405.43元。上述应收利息合计为人民币30,687.16元，其中应收债券利息人民币30,079.10元已于清算期间划入托管账户。截至清算期结束日，应收利息余额为人民币608.06元。该款项将于清算期结束后由管理人以自有资金先行垫付；基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(4) 本基金最后运作日应收申购款为人民币615.05元，于2021年10月29日提出申请并于2021年11月1日确认的基金申购及转入款为1,899.88元，上述款项已划付至本基金托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币1,025.30元，于2021年10月29日提出申请并于2021年11月1日确认的基金赎回、转出金额及赎回费为240.84元，该款项已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币338.69元、应付托管费人民币112.89元、应付销售服务费人民币4.76元已于清算期间内支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用人民币150.25元，清算期间产生应付交易费用人民币305.50元，上述应付交易费用合计人民币455.75元。其中人民币450.00元已于清算期间支付，剩余人民币5.75元将于清算期结束后支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币121,789.25元，其中应付赎回费人民币0.53元，应付指数使用费人民币90.37元，预提审计费人民币39,779.96元，预提信息披露费人民币79,000.00元，预提中债登账户维护费人民币1,418.39元，预提上清所账户维护费人民币1,500.00元。清算期间产生上清所账户维护费人民币100.00元，预提中债登账户维护费人民币1,581.61元，银行划款费人民币262.00元。上述应付赎回费、应付指数使用费，预提信息披露费、账户维护费、银行划汇费已于清算期间支付。预提审计费为预提2021年度审计费用，已于清算期内转入其他收入。

4、清算期间的清算损益情况

项目	自2021年10月30日 至2021年11月12日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	703.29
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	190.60
其他收入（注3）	39,779.96
清算期间收益小计	40,673.85
二、清算期间支出	
银行划款费	262.00
债券交易费用	305.50
账户维护费	1,681.61
清算期间支出小计	2,249.11
三、清算期间净收益	38,424.74

注1:利息收入系计提的2021年10月30日至2021年11月12日止清算期间的银行存款利息和债券利息。

注2:处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出债券成交金额减去卖出债券最后运作日估值总额和截至变现日应收债券利息后的差额。

注3:其他收入系此前基金预提审计费，基金清算期间转入其他收入。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额
一、基金终止日2021年10月29日净资产	2,732,899.98
加：清算期间净收益	38,424.74
加：基金净申购金额（于2021年11月1日确认的投资者申购、赎回申请）	1,659.04
二、清算结束日2021年11月12日净资产	2,772,983.76

资产处置及负债清偿后，于2021年11月12日本基金剩余财产为人民币2,772,983.76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扣除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。

自清算起始日（2021年10月30日）至清算结束日（2021年11月12日）的银行存款等产生的利息已计入清算期间净收益，自清算期结束日次日（2021年11月13日）至清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。为便于及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息及结算备付金等。基金管理人所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，将于清算期后返还给基金管理人，基金财产清算完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

6、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，报中国证券监督管理委员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) 《长盛中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《上海源泰律师事务所关于长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金清算事宜之法律意见》

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。

长盛中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金基金财产清算小组

2021年11月17日