

# 长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金 清算报告

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

## 一、重要提示

长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金（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]471 号文核准募集，于 2021 年 11 月 8 日成立并正式运作。

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》、《长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，截至 2022 年 12 月 2 日日终，本基金的基金份额持有人数量已连续 50 个工作日不满 200 人，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止事由，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。本基金进入清算期的公告详见 2022 年 12 月 3 日刊登在长城基金管理有限公司网站(www.ccfund.com.cn)和中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 上的《关于长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同终止与基金财产清算的公告》。

本基金自 2022 年 12 月 3 日起进入财产清算期，由本基金基金管理人长城基金管理有限公司、本基金基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所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，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

|             |  |
|-------------|--|
| 基金简称        | 长城中债 1-5 年国开债指数  |
| 基金主代码       | 011675   |
| 基金运作方式      | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日     | 2021 年 11 月 8 日  |
| 最后运作日基金份额总额 | 301,842.32 份   |
| 投资目标        | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争使日均偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 投资策略        | 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成   |

|        |  |
|--------|--|
|        | 份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。   |
| 业绩比较基准 | 中债-1-5 年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，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  | 长城基金管理有限公司   |
| 基金托管人  | 中国邮政储蓄银行股份有限公司   |

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2021]471 号文核准募集，由基金管理人长城基金管理有限公司于 2021 年 8 月 6 日至 2021 年 11 月 5 日向社会公开募集，《基金合同》于 2021 年 11 月 8 日正式生效，募集规模为 3,000,033,490.12 份基金份额。

自 2021 年 11 月 8 日至 2022 年 12 月 2 日期间，本基金按《基金合同》正常运作。《基金合同》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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。”截至 2022 年 12 月 2 日日终，本基金的基金份额持有人数量已连续 50 个工作日不满 200 人，触发了《基金合同》约定的基金合同终止事由，基金管理人将按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。本基金自 2022 年 12 月 3 日起进入财产清算期。

### 四、 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金

报告截止日：2022 年 12 月 2 日

单位：人民币元

|                       |
|-----------------------|
| 最后运作日：2022 年 12 月 2 日 |
|-----------------------|

|             |            |
|-------------|------------|
| <b>资产：</b>  |            |
| 银行存款        | 193,565.59 |
| 交易性金融资产     | 260,890.75 |
| 其中：债券投资     | 260,890.75 |
| 应收申购款       | 30.00      |
| 资产总计        | 454,486.34 |
| <b>负债：</b>  |            |
| 应付管理人报酬     | 1,467.64   |
| 应付托管费       | 489.24     |
| 应付销售服务费     | 0.32       |
| 其他负债        | 149,284.88 |
| 负债合计        | 151,242.08 |
| <b>净资产：</b> |            |
| 实收基金        | 301,842.32 |
| 未分配利润       | 1,401.94   |
| 净资产合计       | 303,244.26 |
| 负债和净资产总计    | 454,486.34 |

注：于最后运作日 2022 年 12 月 2 日，基金份额总额 301,842.32 份，其中长城中债 1-5 年国开债指数 A 基金份额总额 299,127.50 份，基金份额净值 1.0045 元；长城中债 1-5 年国开债指数 C 基金份额总额 2,714.82 份，基金份额净值 1.0184 元。

## 五、 清算情况

自 2022 年 12 月 3 日至 2022 年 12 月 15 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《长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》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。

### 2、 资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日银行存款人民币 193,565.59 元，是储存于基金托管人中国邮政储蓄银行的活期银行存款 187,302.07 元和应计银行存款利息 6,263.52 元。活期银行存款利息由托管银行于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。
- (2) 本基金最后运作日交易性金融资产人民币 260,890.75 元，为政策性金融债，于 12 月 5 日已卖出，交收金额为人民币 260,807.21 元。

- (3) 本基金最后运作日应收申购款人民币 30.00 元，该款项已于 2022 年 12 月 5 日收回。

### 3、 负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,467.64 元，该款项已于 2022 年 12 月 5 日和 7 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 489.24 元，该款项已于 2022 年 12 月 5 日和 7 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0.32 元，该款项已于 2022 年 12 月 5 日和 7 日支付。
- (4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 149,284.88 元，包含应付交易费用和预提费用。其中，银行间交易手续费为人民币 134.88 元，中债登结算服务费为人民币 1,650.00 元，预提中债登账户维护费 4,500 元，将于账户注销时一次性结清。预提审计费 63,000.00 元，已于 2022 年 12 月 12 日支付；预提信息披露费 80,000.00 元，已于 2022 年 12 月 14 日支付。

### 4、 清算期的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目                      | 2022 年 12 月 3 日至 2022 年 12 月 15 日 |
|-------------------------|-----------------------------------|
| 一、营业总收入                 | -136.79                           |
| 利息收入（注 1）               | 97.38                             |
| 投资收益（损失以“-”填列）（注 2）     | -751.17                           |
| 公允价值变动收益（损失以“-”填列）（注 2） | 517.00                            |
| 二、营业总支出                 | 0.00                              |
| 三、利润总额                  | -136.79                           |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）       | -136.79                           |

注 1：利息收入系计提的自 2022 年 12 月 3 日至 2022 年 12 月 15 日止清算期间的银行存款利息。

注 2：投资收益及公允价值变动收益系由清算期间处置交易性金融资产产生。

### 5、 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         |
|--|------------|
| 一、最后运作日（2022 年 12 月 2 日）基金净资产                | 303,244.26 |
| 加：清算期间（2022 年 12 月 3 日至 2022 年 12 月 15 日）净收益 | -136.79    |

|   |            |
|---|------------|
| 减：基金净赎回金额(2022 年 12 月 2 日赎回并于 2022 年 12 月 3 日确认的申请) | 1.02       |
| 二、2022 年 12 月 15 日基金净资产                             | 303,106.45 |

2022 年 12 月 15 日本基金剩余财产为人民币 303,106.45 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。

2022 年 12 月 16 日至清算款划出日前一日的银行存款等孳生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将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），供清盘分配使用。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将于清算期后返还给基金管理人。

#### 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) 长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金清算审计报告
- (2) 上海市通力律师事务所关于《长城中债 1-5 年国开行债券指数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：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元，38 层、39 层

存放网址：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)

### 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。

长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金基金财产清算小组

2022 年 12 月 30 日