

长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券 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：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：2022 年 3 月 22 日

清算报告公告日：2022 年 4 月 11 日

§ 1 重要提示

长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2019]2353 号《关于准予长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金注册的批复》的注册，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 2020 年 1 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 297,014,100.57 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和登记机构为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《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”中“二、基金合同的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的。”

根据管理人于 2022 年 3 月 2 日发布的《关于长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，基金份额持有人大会于 2022 年 2 月 28 日表决通过了《关于终止长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资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。本基金最后运作日为 2022 年 3 月 2 日，自 2022 年 3 月 3 日起进入清算期。

由基金管理人长信基金管理有限责任公司、基金托管人平安银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2022 年 3 月 3 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。

§ 2 基金产品概况

| | |
|----------------------------|--|
| 基金简称 | 长信中证转债及可交换债 50 指数 |
| 基金主代码 | 008435 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 1 月 16 日 |
| 报告期末（2022 年 3 月 2 日）基金份额总额 | 3,635,015.25 份 |
| 投资目标 | 本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标指数的有效跟踪。 |
| 投资策略 | 本基金为被动式指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数，即主要按照标的指数的 |

| | | |
|-----------------|---|-------------------------|
| | 成份券组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，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。 | |
| 业绩比较基准 | 中证可转债及可交换债券 50 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。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 | 平安银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 长信中证转债及可交换 债 50 指数 A | 长信中证转债及可交换 债 50 指数 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 008435 | 008436 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1, 222, 269. 81 份 | 2, 412, 745. 44 份 |

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2019]2353 号《关于准予长信中证可转债及可交换债券 50 指数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人募集。基金合同于 2020 年 1 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 297,014,100.57 份基金份额。

因市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，本基金管理人根据《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，经与基金托管人平安股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。基金管理人于 2022 年 1 月 28 日 0:00 起至 2022 年 2 月 27 日 17:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议了《关于终止长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

本次基金份额持有人大会于 2022 年 2 月 28 日表决通过了《关于终止长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资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。根据基金管理人 2022 年 3 月 2 日发布的《关于长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金基金份额持有人大

会决议生效公告》，本基金最后运作日为2022年3月2日，自2022年3月3日起进入清算期。

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 资产负债表（经审计）

会计主体：长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 3 月 2 日

单位：人民币元

| 资产 | 最后运作日 2022 年 3 月 2 日 |
|---------------|-------------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 94,003.16 |
| 结算备付金 | 26,782.85 |
| 存出保证金 | 335.10 |
| 交易性金融资产 | 3,770,111.56 |
| 资产总计 | 3,891,232.67 |
| 负债和所有者权益 | 最后运作日 2022 年 3 月 2 日 |
| 负债： | |
| 应付证券清算款 | 55,176.44 |
| 应付赎回款 | 49.40 |
| 应付管理人报酬 | 93.83 |
| 应付托管费 | 15.63 |
| 应付销售服务费 | 20.74 |
| 应交税费 | 32.53 |
| 其他负债 | 31,500.01 |
| 负债合计 | 86,888.58 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 3,635,015.25 |
| 未分配利润 | 169,328.84 |
| 所有者权益合计 | 3,804,344.09 |
| 负债和所有者权益总计 | 3,891,232.67 |

注：截至最后运作日，长信中证转债及可交换债 50 指数 A 资产净值为 1,281,916.85 元，长信中证转债及可交换债 50 指数 C 资产净值为 2,522,427.24 元。

§ 5 基金财产分配

自2022年3月3日至2022年3月22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 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金为人民币26,782.85元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币26,509.68元，应计备付金利息人民币31.67元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金人民币238.14元，应计备付金利息人民币3.36元。上述应计备付金利息已于2022年3月21日划入托管账户，其余款项将于2022年3月22日之后划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金为人民币335.10元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金人民币293.56元，应计存出保证金利息人民币0.57元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金人民币40.97元。上述应计存出保证金利息已于2022年3月21日划入托管账户，其余款项将于2022年3月22日之后划入托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币3,770,111.56元，已于清算期间全部处置变现。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 55,176.44 元，该款项已于 2022 年 3 月 3 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 49.40 元，该款项已于 2022 年 3 月 4 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 93.83 元，该款项已于 2022 年 3 月 16 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付托管费为人民币 15.63 元，该款项已于 2022 年 3 月 16 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 20.74 元，该款项已于 2022 年 3 月 16 日支付。

5.2.6 本基金最后运作日应交税费为人民币 32.53 元，其中人民币 31.29 元已于 2022 年 3 月 10 日支付，其余款项将于 2022 年 3 月 22 日之后支付。

5.2.7 本基金最后运作日其他负债为人民币 31,500.01 元，其中应付赎回费为人民币 0.01 元，已于 2022 年 3 月 4 日支付；预提年度审计费人民币 30,000.00 元，预提中债账户维护费人民币 1,500.00 元，上述款项将于 2022 年 3 月 22 日之后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 自2022年3月3日至2022年3月22日止清算期间 |
|-----------------------|----------------------------|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入（注1） | 711.69 |
| 2、处置交易性金融资产产生的净收益（注2） | 6,787.99 |
| 清算收益小计 | 7,499.68 |
| 二、清算费用 | |
| 1、交易费用（注3） | 32.31 |
| 2、税金及附加 | 0.07 |
| 清算费用小计（注4） | 32.38 |
| 三、清算净收益 | 7,467.30 |

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2022年3月3日至2022年3月22日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。其中2022年3月21日前产生的利息已于2022年3月21日划入托管账户，其余利息将于2022年3月22日之后或下一个结息日划入托管账户。

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与应收债券利息减去卖出债券最后运作日的债券估值总额后的差额。

3、交易费用系清算期间因处置交易性金融资产产生。

4、本次清算期间产生的其他清算费用由本基金基金管理人承担。

5.4 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3月2日基金净资产 | 3,804,344.09 |
| 加：清算期间净收益 | 7,467.30 |
| 减：基金净赎回转出金额 （于2022年3月3日确认的投资者赎回转出申请） | 75,534.79 |
| 二、2022年3月22日基金净资产 | 3,736,276.60 |

注：根据本基金的基金合同及基金管理人于2022年3月2日发布的《关于长信中证可转债及可交换债券50指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，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。清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金孳生的利息归基金份额持有人所有。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付上述未结息金额，供清盘分配使用，待实际资金到账后再返还基金管理人，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

资产处置及部分负债清偿后，本基金截至 2022 年 3 月 22 日止的净资产为人民币 3,736,276.60 元，其中长信中证转债及可交换债 50 指数 A 资产净值为 1,210,846.18 元，长信中证转债及可交换债 50 指数 C 资产净值为 2,525,430.42 元。

截至 2022 年 3 月 22 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余额共人民币 3,740,620.96 元。

5.5 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，报监管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、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金清算审计报告；
- 2、《长信中证可转债及可交换债券 50 指数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：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金财产清算小组

2022 年 3 月 22 日