

长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金 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

报告出具日：2021年5月13日

报告送出日：2021年5月21日

目录

重要提示.....	1
一、基金概况.....	2
二、基金运作情况.....	2
三、财务会计报告.....	3
四、清算情况.....	5
五、备查文件目录.....	7

重要提示

长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2017]1915号文《关于准予长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》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》等法律法规的规定和《长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定公开募集。本基金为契约型开放式,基金存续期限为不定期,首次设立募集资金为371,090,674.23元,认购资金在募集期间产生的利息23,877.10元,合计为371,114,551.33元,按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,折合基金份额为371,114,551.33份,业经中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)众环验字(2018)010033号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)于2018年4月26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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中的约定:“《基金合同》生效日起三年后的对应日,若基金资产净值低于二亿元的,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。……”

本基金的基金合同生效日为2018年4月26日,基金合同生效日起三年后的对应日为2021年4月26日。截至2021年4月26日日终,本基金的基金资产净值低于二亿元,已触发《基金合同》终止事由,基金管理人将组织对基金财产进行清算,上述事项不需召开基金份额持有人大会审议,具体情况详见2021年4月27日刊登在规定媒介上的《关于长江汇聚量化多因子灵活配置混合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2021年4月27日起进入基金财产清算期,基金管理人、基金托管人、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基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

一、基金概况

基金名称	长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	长江汇聚量化多因子
基金主代码	005757
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年04月26日
最后运作日基金份额总额	15,398,207.18份
投资目标	本基金通过数量化投资模型，合理配置资产权重，精选行业与个股，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥公司资源优势、构建高质量的基础数据库，自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态管理，进一步优化各类资产的比例以确保风险收益最大化。在股票投资过程中，本基金将坚持量化模型驱动的投资决策流程，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，追求基金资产的长期稳定增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中证500指数收益率*60%+中国债券综合财富指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
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

二、基金运作情况

长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金(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[2017]1915号文《关于准予长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》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》等法规法规的规定和《长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定公开募集。本基金为契约型开放式,基金存续期限为不定期,首次设立募集资金为371,090,674.23元,认购资金在募集期间产生的利息23,877.10元,合计为371,114,551.33元,按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,折合基金份额为371,114,551.33份,业经中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)众环验字(2018)010033号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2018年4月26日正式生效。自2018年4月26日至2021年4月26日期间,本基金按《基金合同》约定正常运作。

本基金的基金合同生效日为2018年4月26日,基金合同生效日起三年后的对应日为2021年4月26日。截至2021年4月26日日终,本基金的基金资产净值低于二亿元,已触发《基金合同》终止事由,基金管理人将组织并对基金财产进行清算,上述事项不需召开基金份额持有人大会审议,具体情况详见2021年4月27日刊登在规定媒介上的《关于长江汇聚量化多因子灵活配置混合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2021年4月27日起进入基金财产清算期,基金管理人、基金托管人、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基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

三、财务会计报告

(一) 最后运作日及清算期间

本基金最后运作日为2021年4月26日,清算期间为2021年4月27日至2021年4月28日。

(二) 清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计

核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

（三）财务会计报告

资产负债表

会计主体：长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年4月26日（本基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2021年4月26日
资 产：	
银行存款	20,662,767.98
结算备付金	328,377.28
存出保证金	12,048.13
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
债券投资	-
基金投资	-
权证投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融工具	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	11,803.53
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产合计	21,014,996.92
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-

应付赎回款	11,319.40
应付管理人报酬	22,805.84
应付托管费	3,040.75
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,293.02
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	266.25
负债合计	38,725.26
所有者权益：	
实收基金	15,398,207.18
未分配利润	5,578,064.48
所有者权益合计	20,976,271.66
负债和所有者权益总计	21,014,996.92

注：报告截止日 2021 年 4 月 26 日(本基金最后运作日)，基金份额净值 1.3623 元，基金份额总额 15,398,207.18 份。

四、清算情况

自 2021 年 4 月 27 日至 2021 年 4 月 28 日止为本基金清算期间，基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

（一）清算费用

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。根据本基金《基金合同》的约定，本基金的清算费用由基金财产承担。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，清算律师费和审计费由基金管理人承担。

（二）最后运作日资产处置情况

1、本基金最后运作日，结算备付金为人民币 328,377.28 元，结算保证金为人民币 12,048.13 元，该款项将按照结算规则，逐步划回基金托管户。

2、本基金最后运作日应收活期存款利息为人民币 11,043.61 元，应收结算备付金利息为人民币 738.02 元，应收结算保证金利息为人民币 21.90 元，上述款项预计于 2021 年 6 月 21 日

季度结息日划至基金托管户。

（三）最后运作日负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 11,319.40 元，该款项已于 2021 年 4 月 27 日支付完毕。

2、本基金最后运作日应付管理费为人民币 22,805.84 元，应付托管费为人民币 3,040.75 元，该款项已于 2021 年 4 月 27 日支付完毕。

3、本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,293.02 元，该款项已于 2021 年 4 月 27 日支付。

4、本基金最后运作日其他负债为人民币 266.25 元，其中预提费用人民币 250.00 元为预提银行汇划手续费，用于支付本基金清算相关划款手续费，最终以银行实际扣款金额为准；其中应付赎回费为人民币 16.25 元，该款项已于 2021 年 4 月 27 日支付完毕。

（四）清算期间损益情况

单位：人民币元

项目	自 2021 年 4 月 27 日至 2021 年 4 月 28 日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	854.81
2、其他收入（注 2）	17.91
清算收益小计	872.72
二、清算费用	-
三、清算期间净收益	872.72

注1：利息收入为自2021年4月27日至2021年4月28日止清算期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入和结算保证金利息收入。

注2：其他收入为自2021年4月27日至2021年4月28日止清算期间的赎回费收入。

（五）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 2021 年 4 月 26 日基金净资产	20,976,271.66
加：清算报告期间净收益	872.72
减：2021 年 4 月 27 日确认的赎回金额（含费用）	40,153.20

二、2021年4月28日基金净资产	20,936,991.18
-------------------	---------------

资产处置及负债清偿后，截至2021年4月28日本基金剩余财产为人民币20,936,991.18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（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，清算律师费和审计费由基金管理人承担）、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2021年4月27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基金托管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。

（六）基金清算结果的告知及剩余资产的分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时进行分配。

五、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、《长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式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〈长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金清算报告〉的法律意见》。

（二）存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人网站
<https://www.cjzcg1.com>，中国证监会基金电子披露网站 <http://eid.csrc.gov.cn/fund>。

（三）查阅方式

投资者可登录基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2021年5月21日