

国联安中债 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：国联安基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日：二零二三年三月二十八日

§ 1 重要提示

国联安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国联安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2850 号文）注册，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安中债 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》”或“基金合同”）发售，基金合同于 2020 年 5 月 20 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。首次设立募集规模为 275,130,105.83 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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》等法律法规的规定及《基金合同》的约定，并经基金份额持有人大会于 2023 年 2 月 20 日表决通过了《关于终止国联安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自本次基金份额持有人大会决议生效并公告之日即 2023 年 2 月 21 日起，本基金进入基金财产清算程序。

根据上述法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金基金财产清算小组于 2023 年 2 月 21 日成立。本基金基金财产清算小组由基金管理人国联安基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成。其中，基金管理人的授权代表为仲晓峰、丁瑶希；基金托管人的授权代表为林晓东、钱璐；安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）会计师为蒋燕华、孔令曼；上海市通力律师事务所律师为安冬、陆奇。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国联安中债 1-3 年政金债指数
基金主代码	008879
交易代码	008879
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 20 日
基金最后运作日（2023 年 2	2,633,152.22 份

月 20 日) 基金份额总额	
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>本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份债券在中债 1-3 年政策性金融债指数中的基准权重构建指数化投资组合。</p> <p>当成份债券市场流动性不足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>基金管理人将定期评估投资组合整体以及各层级债券与标的指数的偏离情况，定期对投资组合进行调整，以确保组合总体特征与标的指数相似，并控制跟踪误差。</p> <p>当发生较大的申购赎回、组合中债券派息、债券到期以及市场波动剧烈等情况，导致投资组合与标的指数出现偏离，本基金将综合考虑市场流动性、交易成本、偏离程度等因素，对投资组合进行不定期的动态调整以控制跟踪误差。</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	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

国联安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金经中国证监会《关于准予国联安中债

1-3 年政策性金融债指数证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2850 号文）注册，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《基金合同》发售，基金合同于 2020 年 5 月 20 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。首次设立募集规模为 275,130,105.83 份基金份额。2020 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 20 日期间，本基金按基金合同正常运作。

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》等法律法规的规定及《基金合同》的约定，并经基金份额持有人大会于 2023 年 2 月 20 日表决通过了《关于终止国联安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同有关事项的议案》，自本次基金份额持有人大会决议生效并公告之日即 2023 年 2 月 21 日起，本基金进入基金财产清算程序。

§ 4 财务报表

4.1 资产负债表

会计主体：国联安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 2 月 20 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产：		负 债：	
银行存款	277,415.08	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金	13.47	衍生金融负债	
交易性金融资产	2,515,270.55	卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付清算款	
债券投资	2,515,270.55	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	238.00
基金投资		应付托管费	79.38
贵金属投资		应付销售服务费	
其他投资		应付投资顾问费	
衍生金融资产		应交税费	
买入返售金融资产		应付利润	
应收清算款		递延所得税负债	
应收股利		其他负债	33,000.00
应收申购款		负债合计	33,317.38
递延所得税资产		净资产：	
其他资产		实收基金	2,633,152.22
		其他综合收益	
		未分配利润	126,229.50
		净资产合计	2,759,381.72

资产合计：	2,792,699.10	负债与净资产总计：	2,792,699.10
-------	--------------	-----------	--------------

注：本报告期的基金财务会计报告经审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

根据本基金基金合同的约定，本基金于 2023 年 2 月 21 日进入清算期。

本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。

自 2023 年 2 月 21 日至 2023 年 3 月 10 日止的清算期间，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 本基金最后运作日银行存款余额为人民币 277,244.95 元，清算期间银行存款净流入人民币 2,516,271.21 元，清算期间银行存款净流出人民币 33,498.63 元，于清算结束日银行存款余额为人民币 2,760,017.53 元。

最后运作日应计银行存款利息余额为人民币 170.13 元，清算期间计提银行存款利息人民币 462.63 元，于清算结束日应计银行存款利息余额为人民币 632.76 元。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 13.47 元，清算期间存出保证金账户净流出人民币 0.03 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 13.44 元。

最后运作日应计存出保证金利息余额为人民币 0.00 元，清算期间计提存出保证金利息人民币 0.00 元，于清算结束日应计存出保证金利息余额为人民币 0.00 元。

5.1.3 本基金最后运作日债券投资余额为 2,486,250.00 元，应计债券投资利息余额为 29,020.55 元，所有债券投资于清算期间处置变现，于清算结束日债券投资科目余额为 0.00 元，应计债券投资利息余额为 0.00 元。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 238.00 元，清算期间已支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为 0.00 元。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 79.38 元，清算期间已支付，于清算结束日应付托管费余额为 0.00 元。

5.2.3 本基金最后运作日应付审计费为人民币 30,000.00 元，清算期间已支付，于清算结束日应付审计费余额为 0.00 元。

5.2.4 本基金最后运作日应付中债账户维护费余额为人民币 3,000.00 元，清算期间已支付，于清算结束日应付中债账户维护费余额为人民币 0.00 元。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2023年02月21日(基金清算起始日)至2023年03月10日(基金清算结束日)止期间
一、资产处置损益	-270.88
1.利息收入	462.63
其中：存款利息收入	462.63
2.投资收益（损失以“-”填列）	-13,511.01
其中：债券投资收益	-13,511.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	12,777.50
4.其他收入（损失以“-”号填列）	0.00
二、清算费用	25.00
1. 其他费用	25.00
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-295.88

注：此处的其他费用为银行汇划费。

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2023年02月20日基金净资产	2,759,381.72
加：清算期间净收益	-295.88
加：因清算期间确认的交易份额产生的净值变动	99.96
二、2023年03月10日基金净资产	2,759,185.80

注：本基金最后运作日基金份额总额为 2,633,152.22 份，于清算期间确认的赎回申请份额为 0.00 份，转出申请份额为 0.00 份，申购申请份额为 95.39 份，转入申请份额为 0.00 份。截至清算结束日基金份额总额为 2,633,247.61 份。

资产处置及负债清偿后，截止至清算结束日本基金剩余财产为人民币 2,759,185.80 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。本基金清算费用包括基金份额持有人大会费用、律师费等由国联安基金管理有限公司承担。

清算结束日 2023 年 3 月 10 日至预估清算款划出日(2023 年 4 月 10 日)前一日的银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有。截至清算结束日 2023 年 3 月 10 日前一日的应收利息共计人民币 605.93 元，保证金余额人民币 13.44 元，基金管理人预估的自 2023 年 3 月 10 日起至 2023 年 4 月 10 日止期间的应收利息人民币 858.56 元，合计 1,477.93 元，已由基金管理人以自有资金垫付并已于 2023 年 3 月 10 日划入托管账户,基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

截至 2023 年 3 月 10 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计人民币 2,760,017.53 元，其中人民币 1,477.93 元系基金管理人代垫的存出保证金以及以当前适用的利率预估的银行存款利息。

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，报中国证监会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、国联安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金清算审计报告
- 2、关于《国联安中债 1-3 年政策性金融债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

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

国联安中债 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

2023 年 3 月 10 日