

景顺长城中债1-3年国开行债券指数证 券投资基金清算报告

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二四年四月十五日

清算报告公告日：二〇二四年四月十八日

目录

重要提示	3
一、基金概况	3
二、基金运作情况	4
三、财务会计报告	4
四、清算情况	5
五、备查文件	9

重要提示

景顺长城中债1-3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”）2019年12月17日证监许可【2019】2879号文准予募集注册，本基金基金合同于2020年6月18日正式生效。本基金基金管理人为景顺长城基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《景顺长城中债1-3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》”或“基金合同”）等有关规定，本基金出现了基金合同终止事由，基金管理人根据法律法规、《基金合同》的约定履行了基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2024年3月29日，并于2024年3月30日起进入清算程序。

本基金的基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2024年3月30日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（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	景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数
基金主代码	008822
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 18 日
基金管理人名称	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
公告依据	《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》等相关法律法规以及《景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金合同》、《景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金招募说明书》

二、基金运作情况

本基金经中国证监会2019年12月17日证监许可【2019】2879号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自2020年5月19日至2020年6月16日期间向社会公开募集。《基金合同》于2020年6月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为2,775,104,639.35份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合70,908.81份基金份额）。

根据《基金合同》约定：“……基金合同存续期内，如果连续50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，基金管理人应当终止本基金合同，无需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至2024年3月29日日终，本基金已出现连续50个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，基金管理人在上述事由出现后依法履行了基金财产清算程序。本基金的最后运作日为2024年3月29日，并于2024年3月30日起进入清算程序。

自《基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

三、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：景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 3 月 29 日

单位：人民币元

资产	本期末 2024 年 3 月 29 日(基金最后运作日)
资产：	
银行存款	166,904.62
资产总计	166,904.62
负债：	

应付管理人报酬	18.81
应付托管费	6.34
应付销售服务费	0.58
其他负债	9,956.47
负债合计	9,982.20
所有者权益：	
实收基金	149,164.34
未分配利润	7,758.08
所有者权益合计	156,922.42
负债和所有者权益总计	166,904.62

注：1. 报告截止日 2024 年 3 月 29 日(基金最后运作日)，A 类基金份额净值 1.0429 元，C 类基金份额净值 1.0616 元。基金份额总额 149,164.34 份，其中 A 类基金份额 76,873.57 份，C 类基金份额 72,290.77 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 29 日(基金最后运作日)。

四、清算情况

自 2024 年 3 月 30 日至 2024 年 4 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，具体清算情况如下：

(一) 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。

(二) 资产处置情况

本基金最后运作日的银行存款余额为人民币 166,904.62 元，其中包含应计银行活期存款利息人民币 8.10 元。银行存款本金部分由基金托管人负责保管，应计银行活期存款利息由基金管理人景顺长城基金管理有限公司先行垫付，待结息日返还给基金管理人。

（三）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18.81元，该款项已于2024年4月3日支付。

（2）本基金最后运作日应付托管费为人民币6.34元，该款项已于2024年4月3日支付。

（3）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币0.58元，该款项已于2024年4月3日支付。

（4）本基金最后运作日其他负债为人民币9,956.47元，由预提审计费用人民币2,622.88元、其他应付款人民币6,607.17元、应付交易费用人民币726.42元构成。

预提审计费用按照付款通知书已于2024年4月9日支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）；

其他应付款为本基金2024年第一季度的应付指数使用费，截止2024年3月29日（最后运作日）本基金计提的应付指数使用费为6,607.17元，本基金应支付指数使用费为人民币6,607.19元，基金计提不足的部分计入其他应收款并由基金管理人景顺长城基金管理有限公司承担，基金管理人将在剩余财产划付日前将基金先行垫付的资金归还基金资产；该款项按照付款通知书已于2024年4月8日完成支付；

应付交易费用待收到付款通知书后将在约定时间内支付。

（四）本次清算报告期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期金额
一、营业总收入	22.35
1. 利息收入	22.35
其中：存款利息收入	22.35
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-

证券出借利息收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资基金收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
其他投资收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-
减：二、营业总支出	-
1. 管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 投资顾问费	-
5. 利息支出	-
6. 信用减值损失	-
7. 税金及附加	-
8. 其他费用	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	22.35
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	22.35
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	22.35

(五) 清算期间的剩余资产情况

单位：人民币元

项 目	金 额
一、2024年3月29日(基金最后运作日)基金净资产	156,922.42
加：清算报告期间净收益	22.35
二、2024年4月12日(清算截止日)基金净资产	156,944.77

(六) 截至2024年4月12日本基金的净资产情况如截止当日的资产负债表所示：

会计主体：景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 4 月 12 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 4 月 12 日 (基金清算截止日)
资 产：	
银行存款	157,671.17
其他应收款	0.02
资产合计	157,671.19
负 债 和 所 有 者 权 益	本期末 2024 年 4 月 12 日 (基金清算截止日)
负 债：	
其他负债	726.42
负债合计	726.42
所有者权益：	
实收基金	149,164.34
未分配利润	7,780.43
所有者权益合计	156,944.77

负债与持有人权益总计：	157,671.19
-------------	------------

资产处置及负债清偿后，于 2024 年 4 月 12 日本基金剩余财产为人民币 156,944.77 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。

2024年4月12日至清算款划出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。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人景顺长城基金管理有限公司将先行垫付该笔款项（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，待结息日回款后再返还给基金管理人。

（七）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。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、景顺长城中债1-3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《景顺长城中债1-3年国开行债券指数证券投资基金清算报告》的法律意见

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

景顺长城中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金财产清算小组

二〇二四年四月十五日