

长城中证医药卫生指数增强型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：交通银行股份有限公司

一、重要提示

长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金（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]3446号文注册募集，于2022年6月1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》、《长城中证医药卫生指数增强型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2024年7月16日日终，本基金的基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元，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》，不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2024年7月18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《关于长城中证医药卫生指数增强型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2024年7月17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、本基金基金托管人交通银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市中盛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，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，北京市中盛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	长城中证医药卫生指数增强
基金主代码	014205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年6月1日
最后运作日基金份额总额	17,580,351.01份
投资目标	以增强指数化投资方法跟踪标的指数，在严格控制与标的指数偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过8%。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为增强型指数基金，以跟踪标的指数为主，在一般情况下保持相对稳定的股票投资比例，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金基于基金管理人量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子股票模型进行投资。多因子模型基于A股上市公司的</p>

	<p>历史数据，借助数量化的技术手段，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子，通过回测研究各个因子的历史表现，寻找收益稳定、互补性强的因子对股票进行综合评分，根据评分结果精选各个行业的优质股票构成组合。多因子模型的因子来源主要包括基本面因子、市场交易型因子、预期性因子等。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将根据“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，重点参考基金的流动性管理需要，运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略等多种积极管理策略，选取收益稳定、流动性较好的债券进行配置。</p> <p>4、可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入分析与研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前提下进行投资。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。</p> <p>5、股指期货、国债期货、股票期权投资策略</p> <p>本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的参与股指期货、国债期货、股票期权的投资。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。</p> <p>7、融资业务策略</p> <p>在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。</p> <p>8、转融通证券出借业务策略</p> <p>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。</p>	
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长城中证医药卫生指数增强 A	长城中证医药卫生指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014205	014206
最后运作日下属分级基金的份额总额	6,071,738.13 份	11,508,612.88 份

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2021]3446号文注册募集，由基金管理人长城基金管理有限公司于2022年4月18日至2022年5月30日向社会公开募集，《基金合同》于2022年6月1日正式生效，募集规模为302,464,240.09份基金份额。

自2022年6月1日至2024年7月16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2024年7月16日日终，本基金的基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元，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》，不需召开基金份额持有人大会。本基金自2024年7月17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：长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024年07月16日

单位：人民币元

最后运作日：2024年07月16日	
资产：	
银行存款	24,287,524.07
结算备付金	22.52
应收申购款	23,681.56
资产总计	24,311,228.15
负债：	
应付赎回款	11,211,140.85
应付管理人报酬	14,012.22
应付托管费	2,802.45
应付销售服务费	3,213.45
其他负债	16,283.95
负债合计	11,247,452.92
净资产：	
实收基金	17,580,351.01
未分配利润	-4,516,575.78
净资产合计	13,063,775.23
负债和净资产总计	24,311,228.15

注：于最后运作日 2024 年 07 月 16 日，基金份额总额 17,580,351.01 份，其中长城中证医药卫生指数增强 A 基金份额总额 6,071,738.13 份，基金份额净值 0.7462 元；长城中证医药卫生指数增强 C 基金份额总额 11,508,612.88 份，基金份额净值 0.7415 元。

五、 清算情况

自 2024 年 07 月 17 日至 2024 年 07 月 24 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《长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金合同》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。考虑投资者利益，本基金清算事宜产生的律师费 8000 元由本基金基金管理人长城基金管理有限公司承担。

2、 资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日银行存款人民币 24,287,524.07 元，分别是储存于基金托管人交通银行的活期银行存款人民币 3,670,652.87 元和应计活期银行存款利息人民币 179.65 元，储存于证券公司资金账户的资金 20,615,891.66 元和应计证券公司资金账户利息 799.89 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。证券公司资金账户利息由证券公司于每季度 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活期银行存款利息和证券公司资金账户利息款项。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金人民币 22.52 元，是上海中期期货备付金的利息，由于存放天数不足，已于 2024 年 7 月 18 日做反冲处理。
- (3) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 23,681.56 元，该款项已于 2024 年 07 月 17 日收回。

3、 负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 11,211,140.85 元，该款项已于 2024 年 07 月 17-19 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 14,012.22 元，该款项已于 2024 年

07月18日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,802.45 元, 该款项已于 2024 年 07 月 18 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 3,213.45 元, 该款项已于 2024 年 07 月 18 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 16,283.95 元, 包含应付赎回费和预提审计费用。其中, 应付赎回费为人民币 283.95 元, 已于 2024 年 07 月 17-19 日支付; 预提审计费人民币 16,000.00 元, 已于 2024 年 07 月 22 日支付。

4、清算期的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	2024年07月17日至2024年07月24日
一、营业总收入	-14,525.69
利息收入(注1)	592.19
投资收益(损失以“-”填列)(注2)	-15,135.19
其他业务收入(注3)	17.31
二、营业总支出	303.41
银行手续费	303.41
三、利润总额	-14,829.10
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-14,829.10

注1: 利息收入系计提的自 2024 年 07 月 17 日至 2024 年 07 月 24 日止清算期间的银行存款利息人民币 520.54 元、证券公司资金账户利息 94.17 元, 以及期货备付金账户利息反冲人民币-22.52 元。

注2: 投资收益系股利收益(红利税补缴)-15,135.19 元。

注3: 其他业务收入为赎回费归资产 17.31 元。

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(2024年07月16日)基金净资产	13,063,775.23
加: 清算期间(2024年07月17日至2024年07月24日)净收益	-14,829.10
减: 基金净赎回金额(2024年07月16日申购并于2024年07月17日确认的申请, 2024年07月16日赎回并于2024年07月17日确认的申请)	2,232,212.95
二、2024年07月24日基金净资产	10,816,733.18

2024年07月24日本基金剩余财产为人民币10,816,733.18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。

2024年07月25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) 长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金清算审计报告

(2) 北京市中盛律师事务所关于《长城中证医药卫生指数增强型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

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。

长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金财产清算小组

2024年7月29日