

# **东吴中债 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：东吴基金管理有限公司**

**基金托管人：兴业银行股份有限公司**

**清算报告出具日：2023 年 8 月 21 日**

**清算报告公告日：2023 年 9 月 7 日**

## 一、重要提示

东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2021]2393 号文《关于准予东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人东吴基金管理有限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于 2022 年 4 月 15 日正式生效，首次设立募集规模为 3,000,041,141.22 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注册登记机构为东吴基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”），基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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》等法律法规的规定以及《东吴中债 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》”）的有关规定，“《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，基金管理人在履行适当程序后，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会，但应依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。”

截至 2023 年 7 月 27 日日终，本基金基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元。根据《基金合同》的上述约定，基金管理人应当终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。本基金于 2023 年 7 月 28 日起进入基金财产清算程序。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见 2023 年 7 月 28 日发布在本基金管理人网站（[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn>）的《关于东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公

告》。

本基金清算期为 2023 年 7 月 28 日至 2023 年 8 月 18 日，由基金管理人东吴基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、天衡会计师事务所（特殊普通合伙）及上海源泰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，并由天衡会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## 二、基金概况

基金名称	东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金
基金简称	东吴中债 1-3 年政金债指数
基金代码	014894
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 4 月 15 日
最后运作日基金份额总额 (2023 年 7 月 27 日)	91,839.34 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、政策性金融债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不参与股票等权益类资产的投资。如法律法规或监管机构以后允许基金投

	资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。	
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。	
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，但低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	东吴基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东吴中债 1-3 年政金债指数 A	东吴中债 1-3 年政金债指数 C
下属分级基金的交易代码	014894	014895
最后运作日下属分级基金的份额总额(2023年7月27日)	45,176.24 份	46,663.10 份

### 三、基金运作情况

东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2021]2393 号文《关于准予东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金注册的批复》核准，由基金管理人东吴基金管理有

限公司向社会公众公开发行募集，基金合同于 2022 年 4 月 15 日正式生效，首次设立募集规模为 3,000,041,141.22 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注册登记机构为东吴基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《关于东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自 2023 年 7 月 28 日起，本基金进入清算程序，停止办理申购、赎回、定期定额投资及基金转换等业务，并停止收取基金管理费、基金托管费、销售服务费。基金管理人将按照基金合同的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并将清算结果及时予以公告。

#### 四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 7 月 27 日（最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日：2023 年 7 月 27 日
<b>资产：</b>	
银行存款	119,002.93
结算备付金	5,032.14
<b>资产总计</b>	<b>124,035.07</b>
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	15.16
应付托管费	5.04
应付销售服务费	3.86
其他负债	29,000.00

负债合计	<b>29,024.06</b>
净资产:	
实收基金	91,839.34
未分配利润	3,171.67
净资产合计	<b>95,011.01</b>
负债和净资产总计	<b>124,035.07</b>

注：报告截止日 2023 年 7 月 27 日（基金最后运作日），东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金 A 基金份额净值 1.0341 元，份额总额 45,176.24 份；东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金 C 基金份额净值 1.0349 元，份额总额 46,663.10 份。

## 五、清算情况

自 2023 年 7 月 28 日至 2023 年 8 月 18 日止的清算期间，本基金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。基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

### 1、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剩余财产中支付。考虑到本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，本基金的律师费将由基金管理人承担。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 119,002.93 元，其中托管户存款为人民币 118,955.67 元，银行存款应计利息为人民币 47.26 元。截至本次清算结束日 2023 年 8 月 18 日，银行存款为人民币 93,134.76 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 5,032.14 元，其中结算备付金本金为人民币

5,025.00 元，结算备付金应计利息为人民币 7.14 元。截至本次清算结束日 2023 年 8 月 18 日，结算备付金为人民币 705.44 元。

### 3、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 15.16 元，该款项已于 2023 年 8 月 2 日支付。

(2)本基金最后运作日应付托管费为人民币 5.04 元，该款项已于 2023 年 8 月 2 日支付。

(3)本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 3.86 元，该款项已于 2023 年 8 月 2 日支付。

(4)本基金最后运作日其他负债为人民币 29,000.00 元，应付中国证券报信息披露费为人民币 29,000.00 元，已于 2023 年 8 月 7 日支付。

### 4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

	自 2023 年 7 月 28 日至 2023 年 8 月 18 日的 清算期间
一、收入	25.66
1.利息收入	25.66
其中：存款利息收入	22.60
结算备付金利息收入	3.06
二、清算期间费用	150.00
1、其他费用	150.00
三、清算期间净收益(亏损总额以“-”填列)	-124.34

注：1、利息收入系自 2023 年 7 月 28 日至 2023 年 8 月 18 日止清算期间计提的银行存款

利息收入、结算备付金利息收入。

2、其他费用系自 2023 年 7 月 28 日至 2023 年 8 月 18 日止清算期间支付的手续费。

#### 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（2023 年 7 月 27 日）基金净资产	95,011.01
加：清算期间净利润	-124.34
减：清算期间确认的基金赎回款（含费用）	1,046.47
二、2023 年 8 月 18 日基金净资产	93,840.20

本基金于 2023 年 8 月 18 日剩余财产为人民币 93,840.20 元，根据本基金的《基金合同》的约定，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。

清算起始日 2023 年 7 月 28 日至清算款划出日前一日的银行存款利息、结算备付金利息亦属基金份额持有人所有，由基金管理人以自有资金垫付。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。托管账户销户结息时，基金管理人将收回垫付资金，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

#### 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后，报中国证监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)《东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金清算审计报告》

(2)《上海源泰律师事务所关于东吴中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金清算事宜之法律意见》

## 2、存放地点

基金管理人的办公场所：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9 层

## 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。

网站：<http://www.scfund.com.cn>

东吴中债 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 8 月 21 日