

长江双盈6个月持有期债券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：上海银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年08月29日

清算报告公告日：2024年09月10日

一、重要提示

长江双盈6个月持有期债券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【2021】2139号文《关于准予长江双盈6个月持有期债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册，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《长江双盈6个月持有期债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的约定公开募集。经向中国证监会备案，《基金合同》于2021年8月11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，本基金的基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元的，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2021年8月11日，基金合同生效之日起三年后的对应日为2024年8月11日。截至2024年8月11日日终，本基金资产净值低于2亿元，已触发《基金合同》约定的自动终止的情形，本基金已根据《基金合同》约定履行基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会，具体情况详见基金管理人于2024年8月12日刊登的《关于长江双盈6个月持有期债券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》。

自2024年8月12日起，本基金进入基金财产清算程序，由基金管理人长江证券（上海）资产管理有限公司、基金托管人上海银行股份有限公司、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的基金财产清算小组履行基金财产清算程序，基金财产清算报告由中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计并由上海市通力律师事务所出具法律意见书。

二、基金概况

基金简称	长江双盈6个月持有债券发起式	
基金主代码	013017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年08月11日	
基金最后运作日（2024年8月11日）基金份额总额	17,234,272.28 份	
投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，适度参与权益类资产，在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金的主要投资策略包括： 1、资产配置策略； 2、债券投资策略； 3、股票投资策略； 4、资产支持证券投资策略； 5、国债期货投资策略。	
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长江双盈6个月持有债券发起式A	长江双盈6个月持有债券发起式C
下属分级基金的交易代码	013017	013018
基金最后运作日（2024年8月11日）下属分级基金的份额总额	15,410,531.84 份	1,823,740.44 份

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2021】2139号文准予募集注册。由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2021年7月19日至2021年8月6日期间向社会公开募集。基金合同于2021年8月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为147,134,433.50份，其中募集期间净认购资金折合基金份额147,072,583.71份，认购资金在募集期间产生的利息结转的份额61,849.79份。自2021年8月11日至2024年8月11日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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》、《基金合同》等有关规定，本基金最后运作日为2024年8月11日。自2024年8月12日起，本基金进入基金财产清算程序。基金管理人已就该事项于2024年8月12日刊登了《关于长江双盈6个月持有期债券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》。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长江双盈6个月持有期债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年08月11日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日（2024年08月11日）
资 产：	
货币资金	9,156,161.53
结算备付金	185,245.07
存出保证金	27,908.63
交易性金融资产	3,071,896.44
其中：债券投资	3,071,896.44
应收清算款	4,114,130.05
资产总计	16,555,341.72

负债和净资产	最后运作日（2024年08月11日）
负 债：	
应付赎回款	1,058,311.87
应付管理人报酬	3,963.08
应付托管费	849.21
应付销售服务费	222.72
应交税费	73.12
其他负债	9,467.28
负债合计	1,072,887.28
净资产：	
实收资金	17,234,272.28
未分配利润	-1,751,817.84
净资产合计	15,482,454.44
负债和净资产总计	16,555,341.72

注：报告截止日2024年8月11日（基金最后运作日），本基金份额总额17,234,272.28份。其中，A类基金份额净值0.8995元，基金份额总额15,410,531.84份；C类基金份额净值0.8888元，基金份额总额1,823,740.44份。

五、清算情况

自2024年8月12日至2024年8月20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《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财产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。

考虑到本基金的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本

基金清算期间的审计费、律师费将由基金管理人承担，其他清算费用从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日货币资金为人民币9,156,161.53元，其中存放于基金托管户的银行活期存款为人民币9,154,730.56元，应计银行存款利息为人民币1,430.97元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币185,245.07元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金为人民币184,926.44元，应计结算备付金利息为人民币318.63元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币27,908.63元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金为人民币27,858.76元，应计存出保证金利息为人民币49.87元。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产-债券投资为人民币3,071,896.44元，上述债券投资已于2024年8月19日全部变现完毕，相关证券清算款已于2024年8月20日划回基金托管户。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币4,114,130.05元，已于2024年8月12日划回基金托管户。

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1,058,311.87元，已于2024年8月12日支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币3,963.08元，已于2024年8月12日支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币849.21元，已于2024年8月12日支付完毕。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币222.72元，已于2024年8月12日支付完毕。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币73.12元，已于2024年8月20日支付完毕。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币9,467.28元,其中应付交易费用为人民币9,338.50元,已于2024年8月12日支付完毕;应付赎回费为人民币78.78元,已于2024年8月12日支付完毕;其他应付款人民币50.00元为预提银行汇划手续费,用于支付基金清算相关划款手续费,最终以银行实际扣款金额为准。

4、清算期间损益情况

单位:人民币元

项目	自2024年8月12日至2024年8月20日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	2,255.46
2、投资收益(损失以“-”填列)(注2)	-18,004.74
3、公允价值变动收益(损失以“-”号填列)(注3)	33,473.27
清算收益小计	17,723.99
二、清算费用	
税金及附加	5.67
清算费用小计	5.67
三、清算期间净收益	17,718.32

注1:利息收入为自2024年8月12日至2024年8月20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存出保证金利息收入。

注2:投资收益为清算期间债券利息收入、处置债券产生的差价收入和股票红利收入。

注3:公允价值变动收益为清算期间债券的公允价值变动收益。

5、资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位:人民币元

项目	金额
一、最后运作日2024年8月11日基金净资产	15,482,454.44
加:清算报告期间净收益	17,718.32
减:2024年8月12日确认的赎回及转出金额(含费用)	546,370.54

二、清算结束日2024年8月20日基金净资产	14,953,802.22
------------------------	---------------

资产处置及负债清偿后，截至2024年8月20日本基金剩余财产为人民币14,953,802.22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、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。

2024年8月21日至清算款划出日前一日产生的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金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。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人长江证券（上海）资产管理有限公司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各项利息以及存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金、存出保证金等款项，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基金管理人。

6、基金财产清算的公告

本清算报告已经基金托管人复核，经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，将报中国证监会备案并公告。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。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1)《长江双盈6个月持有期债券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〈长江双盈6个月持有期债券型发起式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。

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。

长江双盈6个月持有期债券型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二四年九月十日