

长信中证一带一路主题指数分级证券投资 基金清算报告

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

清算报告出具日：2018年5月18日

清算报告公告日：2018年6月21日

§ 1 重要提示

长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金（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[2015]1212号文《关于准予长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于2015年8月17日生效，首次设立募集规模为215,668,187.59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为长信基金管理有限责任公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）第二十五部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，并在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、《基金合同》约定的其他情形；4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

根据管理人2018年4月23日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金基金份额持有人大会于2018年4月19日表决通过了《关于终止长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，大会决议自该日起生效。本基金最后运作日为2018年4月23日，自2018年4月24日起进入清算期。

由基金管理人长信基金管理有限责任公司、基金托管人广发证券股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2018年4月24日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------------------|--|
| 基金简称 | 长信中证一带一路指数 |
| 场内简称 | 带路分级 |
| 基金主代码 | 502016 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年8月17日 |
| 报告期末(2018年4月23日)基金份额总额 | 14,436,348.70份 |
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟 |

| | | | |
|-----------------|---|--------------|-----------------|
| | 踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现对标的指数的有效跟踪。 | | |
| 投资策略 | <p>本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证一带一路主题指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> | | |
| 业绩比较基准 | 95%×中证一带一路主题指数收益率+5%×银行人民币活期存款利率（税后） | | |
| 风险收益特征 | <p>本基金虽为股票型指数基金，但由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。长信一带一路份额为常规指数基金份额，具有预期风险较高、预期收益较高的特征，其预期风险和预期收益水平均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；长信一带一路 A 份额，则具有预期风险低，预期收益低的特征；长信一带一路 B 份额由于利用杠杆投资，则具有预期风险高、预期收益高的特征。</p> | | |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 | | |
| 基金托管人 | 广发证券股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信一带一路 A | 长信一带一路 B | 长信一带一路 |
| 下属分级基金场内简称 | 带路 A | 带路 B | 带路分级 |
| 下属分级基金的交易代码 | 502017 | 502018 | 502016 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 948,859.00 份 | 948,859.00 份 | 12,538,630.70 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 预期风险低，预期收益低 | 预期风险高、预期收益高 | 预期风险较高、预期收益较高 |

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2015]1212号文《关于准予长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于2015年8月17日生效，首次设立募集规模为215,668,187.59份基金份额。

因市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金合同》等有关规定，提议终止基金合同。本基金于2018年3月23日0:00起至2018年4月18日17:00止以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，会议期间审议了《关于终

止长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

本次基金份额持有人大会于2018年4月19日表决通过了《关于终止长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。根据基金管理人2018年4月23日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金最后运作日为2018年4月23日，自2018年4月24日起进入清算期。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金

报告截止日：2018年4月23日

单位：人民币元

| 资产 | 最后运作日 2018年4月23日 |
|---------------|---------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 989,537.07 |
| 结算备付金 | 193,830.55 |
| 存出保证金 | 6,263.43 |
| 交易性金融资产 | 12,235,449.44 |
| 其中：股票投资 | 12,235,449.44 |
| 应收利息 | 2,215.66 |
| 资产总计 | 13,427,296.15 |
| 负债和所有者权益 | 最后运作日 2018年4月23日 |
| 负债： | |
| 应付管理人报酬 | 9,225.14 |
| 应付托管费 | 2,029.52 |
| 应付交易费用 | 2,205.47 |
| 其他负债 | 115,000.00 |
| 负债合计 | 128,460.13 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 13,721,278.30 |
| 未分配利润 | -422,442.28 |
| 所有者权益合计 | 13,298,836.02 |
| 负债和所有者权益总计 | 13,427,296.15 |

注：1、截至最后运作日，长信一带一路 A 资产净值为 964,040.74 元，长信一带一路 B 资产净值为 783,757.53 元，长信一带一路资产净值为 11,551,037.75 元。

2、本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师蒋燕华、蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)专字第 61399737_B01 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

自2018年4月24日至2018年5月18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，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 本基金最后运作日结算备付金人民币193,830.55元，为存放于上海证券交易所和深圳证券交易所的结算备付金。该款项由已于2018年5月3日划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金人民币6,263.43元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的结算保证金，该结算保证金于清算期间（2018年5月3日）调整为12,864.61元，调整后款项由基金管理人长信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于2018年5月18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。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产人民币12,235,449.44元，其中人民币11,785,840.18元已于清算期间处置，剩余交易性金融资产人民币449,609.26元，系因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票，明细列示如下：

（金额单位：人民币元）

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 终止日估值单价 | 数量 (单位： 股) | 终止日成本总额 | 终止日估值总额 |
|--------|------|-----------|--------|---------|------------------|------------|------------|
| 000063 | 中兴通讯 | 2018-4-17 | 重大事项停牌 | 20.54 | 14,392 | 235,160.31 | 295,611.68 |
| 002051 | 中工国际 | 2018-4-4 | 重大事项停牌 | 15.62 | 9,859 | 206,816.55 | 153,997.58 |

根据《长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》第十八部分“基金资产估值”的约定，交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发

生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。流通受限证券中工国际最后运作日的估值单价为停牌前一交易日的收盘价，流通受限证券中兴通讯最后运作日的估值单价的系本基金管理人长信基金管理有限责任公司运用估值技术计算而得。

本基金管理人长信基金管理有限责任公司以自有资金按照本基金所持有证券资产最后运作日的估值价格垫付本基金未能变现的证券资产，具体清算规则按照相关规定办理。待停牌证券复牌后，为保证基金资产流动性，基金管理人将及时变现停牌证券。待全部停牌证券复牌并卖出变现后，若变现金额高于基金管理人垫付的金额，则将差额按基金份额持有人持有的基金份额比例追偿给基金份额持有人；若变现金额小于基金管理人垫付的金额，则由基金管理人承担相应损失。该款项由基金管理人长信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 5 月 18 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。

5.1.4 本基金最后运作日应收利息为人民币 2,215.66 元。其中应收银行存款利息人民币 2,031.33 元，应收结算备付金利息人民币 174.40 元，应收存出保证金利息人民币 9.83 元，应收申购款利息人民币 0.10 元。该款项由基金管理人长信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 5 月 18 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。

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 9,225.14 元，该款项已于 2018 年 5 月 4 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,029.52 元，该款项已于 2018 年 5 月 4 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 2,205.47 元，为应付席位佣金，该款项将于 2018 年 5 月 18 日后支付。

5.2.4 本基金最后运作日其它负债为人民币 115,000.00 元，其中预提 2017 年度审计费用人民币 50,000.00 元，预提清算审计费人民币 15,000.00 元，预提信息披露费人民币 30,000.00 元，预提上市费人民币 20,000.00 元。其中 2017 年度审计费人民币 50,000.00 元已于 2018 年 5 月 4 日支付，剩余的清算审计费、信息披露费及上市费将于 2018 年 5 月 18 日后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

| 项目 | 自2018年4月24日至2018年5月18日止清算期间 |
|----|-----------------------------|
|----|-----------------------------|

| | |
|----------------|---------------|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入（注1） | 5,976.65 |
| 2、投资收益（注2） | -1,243,520.00 |
| 3、公允价值变动损益（注2） | 1,424,378.31 |
| 4、交易费用（注3） | -24,194.91 |
| 清算收益小计 | 162,640.05 |
| 二、清算费用 | |
| 清算费用小计 | - |
| 三、清算净收益 | 162,640.05 |

注：1、利息收入系计提的自2018年4月24日至2018年5月18日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息和结算备付金利息。该款项由基金管理人长信基金管理有限责任公司以自有资金垫付，并已于2018年5月18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。

2、投资收益和公允价值变动损益系自2018年4月24日至2018年5月18日止清算期间卖出股票产生的投资收益和结转的公允价值变动损益。

3、交易费用系自2018年4月24日至2018年5月18日止清算期间卖出股票产生的佣金、印花税、经手费、证管费、过户费等。

4、本次清算的律师费用由本基金管理人承担。

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2018年4月23日基金净资产 | 13,298,836.02 |
| 加：清算期间净收益 | 162,640.05 |
| 二、2018年5月18日基金净资产 | 13,461,476.07 |

根据本基金的基金合同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，分别计算长信一带一路份额、长信一带一路A份额与长信一带一路B份额各自的应计分配比例，并据此由长信一带一路份额、长信一带一路A份额与长信一带一路B份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

资产处置及部分负债清偿后，本基金截至2018年5月18日止的净资产为人民币13,461,476.07元，其中长信一带一路A资产净值为975,830.62元，长信一带一路B资产净值为793,342.61元，长信一带一路分级资产净值为11,692,302.84元。

截至2018年5月18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人民币13,539,836.13元，其中人民币470,666.18元系基金管理人代垫的存出保证金、未能

变现的证券资产于最后运作日的估值价款和以当前适用的利率预估的银行存款、结算备付金、存出保证金和申购款利息。

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、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金 2018 年 4 月 23 日资产负债表及审计报告；
- 2、关于长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金清算事宜之的法律意见。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金财产清算小组

2018 年 5 月 18 日