

# 长城淘金一年期理财债券型证券投资基金第一个封闭期到期后的清算报告

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

信息披露日期：二零一五年五月二十六日

## 一、重要提示

长城淘金一年期理财债券型证券投资基金(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[2014]364号文“关于核准长城淘金一年期理财债券型证券投资基金募集的批复”的核准,于2014年5月7日正式运作。本基金为契约型开放式,存续期限不定,以每个封闭期为周期进行投资运作,每个封闭期为1年,第一个封闭期为2014年5月7日至2015年5月7日。

根据本基金基金合同在“基金的暂停运作”部分的规定,结合目前的市场环境,本基金管理人长城基金管理有限公司经与本基金托管人中信银行股份有限公司及相关销售机构协商一致,并向中国证监会备案,决定本基金第一个封闭期到期后暂停进入开放期、不接受申购。在本基金第一个封闭期的最后一日(2015年5月7日),全部基金份额按当日的基金份额净值自动赎回,赎回款项于次日返还给投资人。相关暂停运作及不接受申购的事项详见2015年4月22日《上海证券报》及本基金管理人网站上刊登的《关于长城淘金一年期理财债券型证券投资基金第一个封闭期到期后暂停运作、不接受申购等安排的公告》。

本基金从2015年5月8日起进入暂停运作的基金财产清算期。本基金管理人长城基金管理有限公司、基金托管人中信银行股份有限公司对截至2015年5月7日止的基金财产进行了清算,聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对截止2015年5月7日的财务报表进行了审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金截止2015年5月7日的财务报表出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过本基金管理人网站([www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn))查看审计报告全文(审计报告编号:安永华明(2015)审字第60737541\_H25号)。

## 二、基金概况

基金名称	长城淘金一年期理财债券型证券投资基金
基金简称	长城淘金理财债券
基金主代码	000611
交易代码	000611
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月7日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	230,123,093.86份
报告期末基金总净值	246,525,580.77元
基金合同存续期	不定期
投资目标	本基金严格采用买入持有到期策略，将基金资产配置于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的固定收益资产，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期初，将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境进行封闭期组合构建。在封闭期内，本基金严格采用买入持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例稳定。本基金资产投资于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的债券类资产、债券回购和银行存款，力求基金资产在开放前可完全变现。
业绩比较基准	每个封闭期同期对应的一年期定期存款利率（税后） ×1.1
风险收益特征	本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金。

### 三、 财务会计报表

#### 1、 资产负债表（已经审计）

会计主体：长城淘金一年期理财债券型证券投资基金  
 报告截止日：2015年5月7日（基金第一个封闭运作期到期日）

单位：人民币元

资产	期末 余额	负债和所有者权益	期末 余额
资产：		负债：	
银行存款	246,600,645.66	短期借款	-
结算备付金	657,763.73	交易性金融负债	-
存出保证金	308,175.92	衍生金融负债	-
交易性金融资产	-	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	-
基金投资	-	应付托管费	-
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	1,985.63
应收证券清算款	-	应付税费	-
应收利息	24,899.02	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	1,063,917.93
其他资产	-	负债合计	1,065,903.56
		所有者权益：	
		实收基金	230,123,093.86
		未分配利润	16,402,486.91
		所有者权益合计	246,525,580.77
资产合计：	247,591,484.33	负债与持有人权益总 计：	247,591,484.33

## 2、利润表(已经审计)

会计主体：长城淘金一年期理财债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年5月7日（基金第一个封闭运作期到期日）

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 7 日 (基金第一个封闭运作期到期日)
一、收入	9,995,632.33
1. 利息收入	7,192,727.09
其中：存款利息收入	2,132,685.31
债券利息收入	5,055,479.86
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	4,561.92
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,802,905.24
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	2,802,905.24
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、费用	1,786,779.61
1. 管理人报酬	251,849.05
2. 托管费	83,949.68
3. 销售服务费	83,949.68
4. 交易费用	-
5. 利息支出	1,301,306.25

其中：卖出回购金融资产支出	1,301,306.25
6. 其他费用	65,724.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	8,208,852.72
所得税费用（以“-”号填列）	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	8,208,852.72

#### 四、重要财务报表项目的说明

##### 1、银行存款

单位：人民币元

项目	本期末2015年5月7日 (基金第一个封闭运作期到期日)
活期存款	246,600,645.66
定期存款	-
其中：存款期限3个月-1年	-
其他存款	-
合计	246,600,645.66

注：本期末活期存款包含本基金管理人长城基金管理有限公司的垫付的资金105万元。

##### 2、其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2015年5月7日 (基金第一个封闭运作期到期日)
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	13,917.93
预提信息披露费	-
预提银行间账户维护费	-
预提上清所账户维护费	-
其他应付款	1,050,000.00

合计	1,063,917.93
----	--------------

注：本期末其他应付款为本基金管理人长城基金管理有限公司的垫付的资金 105 万元。

### 3、结算备付金

单位：人民币元

项目	本期末2015年 5 月 7 日 (基金第一个封闭运作期到期日)
上交所最低结算备付金	256,224.29
深交所最低结算备付金	401,539.44
合计：	657,763.73

注：根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，结算备付金账户每月按上月的交易情况调整最低结算备付金，结算备付金账户每日日末须保留不低于最低结算备付金的金额。

### 4、结算保证金

单位：人民币元

项目	本期末2015年 5 月 7 日 (基金第一个封闭运作期到期日)
上交所结算保证金	9,969.36
深交所结算保证金	298,206.56
合计：	308,175.92

注：根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，以其对应的结算备付金帐户的担保交收净额（前六个月的结算数据）为计算基础调整本月结算保证金。

### 5、应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2015年 5 月 7 日 (基金第一个封闭运作期到期日)
应收活期存款利息	14,826.40
应收结算备付金利息	9,966.24

应收结算保证金利息	106.38
合计：	24,899.02

注：根据银行和中国证券登记结算有限责任公司的结息规则，银行存款账户、结算备付金账户和结算保证金的资金利息每季度结息一次，计息截止日为每季度第三个月的二十日，于计息截止日后第二个工作日到账。

## 五、 基金剩余财产分配

经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，截止 2015 年 5 月 7 日（第一个封  
闭期结束日，以下简称结束日），本基金总资产为 247,591,484.33 元人民币，总负债为  
1,065,903.56 元人民币，净资产为 246,525,580.77 元人民币，基金份额总额为  
230,123,093.86 份，基金份额净值为 1.071 元（截位）。本基金尚未变现的剩余资产具  
体  
金额如下：

单位：人民币元

项目	2015 年 5 月 7 日	备注
结算备付金	657,763.73	截止 2015 年 5 月 7 日尚未变现
存出保证金	308,175.92	截止 2014 年 5 月 7 日尚未变现
应收利息	24,899.02	截止 2014 年 5 月 7 日尚未变现
合计	990,838.67	

诚如前文所述，截止到 2015 年 5 月 7 日剩余财产中的结算备付金，存出保证金和  
应收利息不能及时变现，该部分金额合计 990,838.67 元人民币。为便于向投资人及时  
足额支付剩余财产，尚未变现部分资产已由本基金管理人代为垫付，垫付资金已于本基  
金结束日当日（2015 年 5 月 7 日）划入本基金资产，垫付金额为 1,050,000.00 元人民  
币，垫资当日产生的利息归属本基金所有。

基于基金管理人于 2015 年 5 月 7 日垫付的资金以及当日最终清算的数据，2015 年 5

月 7 日归属于投资者的剩余财产已全部变现，并于 2015 年 5 月 8 日一次性全部分配给投资者（金额为 246,525,580.77 元人民币），本基金归属于投资者的全部剩余财产已清算完毕。

2015 年 5 月 8 日完成了对归属于投资者的剩余资产的分配后，本基金的剩余资产滋生的权益均归垫付资金的基金管理人所有。

本报告已经基金托管人复核，本报告中的财务会计报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并报中国证监会备案及向基金份额持有人公告。

## 六、 备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、《长城淘金一年期理财债券型证券投资基金截止 2015 年 5 月 7 日已审财务报表》
- 2、中国证监会批准长城淘金一年期理财债券型证券投资基金设立的文件
- 3、《长城淘金一年期理财债券型证券投资基金基金合同》
- 4、《长城淘金一年期理财债券型证券投资基金托管协议》
- 5、中国证监会规定的其他文件

### （二）存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

### （三）查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城

基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)



2015年5月26日