

长盛同泰债券型证券投资基金
清算报告

2017年6月14日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

公告日期：2017年7月8日

一、重要提示

长盛同泰债券型证券投资基金（以下简称“长盛同泰债券”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】196号文核准注册，于2016年5月17日成立并正式运作，基金托管人为中国银行股份有限公司。

依据《长盛同泰债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《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60个工作日出现前述情形的，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”截至2017年5月22日，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，且本基金管理人已与基金托管人协商一致决定终止本基金合同，无需召开基金份额持有人大会。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现终止事由后依法履行基金财产清算程序。本基金管理人与基金托管人协商一致确定2017年5月23日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2017年5月24日）起本基金进入基金财产清算程序。基金登记机构于2017年5月24日完成了本基金最后运作日（即2017年5月23日）申购、赎回业务申请的确认。本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见2017年5月24日刊登在《中国证券报》和基金管理人网站上的《关于长盛同泰债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金从2017年5月24日起进入清算期，由基金管理人长盛基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所于2017年5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，上海市海华永泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金名称：长盛同泰债券型证券投资基金（基金简称：长盛同泰债券。A类

基金份额，基金代码：002571；C类基金份额，基金代码：002572）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2016年5月17日

4、2017年5月23日基金份额总额：9,600,426.36份，其中A类份额7,377,447.11份，C类份额2,222,979.25份。

5、投资目标：在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。

6、投资策略：本基金的投资策略包括资产配置策略、债券组合管理策略和股票投资策略。围绕着这三个层次的投资策略，基金管理人还将充分运用市场上各种金融投资工具，结合投资策略的需要，利用权证等金融衍生工具，通过合理有效的金融模型分析，积极发掘低风险投资机会和锁定套利收益。

7、业绩比较基准： $90\% \times \text{中证综合债指数收益率} + 10\% \times \text{沪深300指数收益率}$ 。

8、风险收益特征：本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

9、基金管理人：长盛基金管理有限公司

10、基金托管人：中国银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

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【2016】196号文《关于准予长盛同泰债券型证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人长盛基金管理有限公司于2016年4月5日至2016年5月13日向社会公开发行募集，《基金合同》于2016年5月17日正式生效，首次设立募集规模为414,305,641.90份基金份额。自2016年5月17日至2017年5月23日期间，本基金按《基金合同》正常运作。

根据《基金合同》约定，本基金在《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60个工作日出现前述情形的，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。

截至2017年5月22日,本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,且本基金管理人已与基金托管人协商一致决定终止本基金合同,无需召开基金份额持有人大会。为维护基金份额持有人利益,根据基金合同约定,本基金管理人应当在出现终止事由后依法履行基金财产清算程序。本基金管理人与基金托管人协商一致确定2017年5月23日为本基金最后运作日,自最后运作日的下一工作日(即2017年5月24日)起本基金进入基金财产清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表(已经审计)

会计主体:长盛同泰债券型证券投资基金

报告截止日:2017年5月23日

单位:人民币元

	最后运作日 2017年5月23日
资 产:	
银行存款	265,607.05
结算备付金	82,105.84
存出保证金	2,207.71
交易性金融资产	8,784,600.80
买入返售金融资产	800,000.00
应收利息	104,832.92
应收申购款	999.20
资产总计	10,040,353.52
负债和所有者权益	
负 债:	
应付证券清算款	42,618.87
应付赎回款	172,478.11

应付管理人报酬	2,808.47
应付托管费	1,404.24
应付销售服务费	553.08
其他负债	35,051.26
负债合计	254,914.03
所有者权益：	
实收基金	9,600,426.36
未分配利润	185,013.13
所有者权益合计	9,785,439.49
负债和所有者权益总计	10,040,353.52

五、清算情况

自2017年5月24日至2017年6月14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：

1、清算费用

按照《长盛同泰债券型证券投资基金基金合同》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。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币82,105.84元，2017年6月2日增加结算备付金人民币57,434.35元；该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于2017年6月6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) 本基金最后运作日存出保证金人民币2,207.71元，2017年6月2日减少存出保证金人民币2,032.10元；该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于2017年6月6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。

(3) 本基金最后运作日买入返售金融资产为人民币800,000.00元，已于2017年5月25日划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收利息为人民币104,832.92元，除应收债券利息外的应收活期存款利息、应收结算备付金利息、应收存出保证金利息，由基金管理人长盛基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于2017年6月6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。应收申购款利息已于2017年5月26日划入托管账户。应收债券利息参见资产处置情况(6)所述。

(5) 本基金最后运作日应收申购款为人民币999.20元，该款项已于2017年5月24日划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币8,784,600.80元，全部为债券投资，应收债券利息为人民币103,760.30元，明细如下：

金额单位：人民币元

交易平台	债券名称	债券代码	最后运作日 估值单价	数量	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额	最后运作日 应收利息
交易所	02国债(13)	010213	99.70	58,000.00	5,799,532.26	5,782,600.00	26,854.79
交易所	12苏国信	122550	99.98	9,990.00	1,012,867.75	998,800.20	35,252.38
交易所	02广核债	111019	100.10	10,006.00	1,016,358.13	1,001,600.60	19,145.73
交易所	11徐工02	112124	100.16	10,000.00	1,019,087.56	1,001,600.00	22,507.40
合计				87,996.00	8,847,845.70	8,784,600.80	103,760.30

以上全部交易性金融资产于2017年5月24日和2017年5月25日处置变现，共发生处置收益人民币11,628.60元，交易费用人民币22.87元，清算期债券利息收入人民币1,174.58元。变现产生的证券清算款人民币8,901,141.41元，已于2017年5月25日和2017年5月26日划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币42,618.87元，该款项已于2017年5月24日支付。

(2) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币172,478.11元，该款项已于2017年5月25日支付。

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币2,808.47元，该款项已于2017年5月24日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,404.24元，该款项已于2017年5月25日支付。

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币553.08元，该款项已于2017年5月24日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币35,051.26元，其中人民币35,000.00元为信息披露费，已于2017年5月24日支付；剩余人民币51.26元为应付赎回费，已于2017年5月25日支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2017年5月24日 至2017年6月14日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	5,251.39
2、处置交易性金融资产产生的收益（注2）	11,628.60
清算收入小计	16,879.99
二、清算费用	
1、债券交易费用	22.87
2、审计费	15,000.00
3、律师费	30,000.00
4、账户维护费	3,000.00
3、汇划费	320.00
清算费用小计（注3）	48,342.87
三、清算净损失	31,462.88

注1:利息收入系计提的自2017年5月24日至2017年6月14日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息、申购款利息、买入返售金融资产利息和尚未变现债券利息。

注2:处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出债券成交金额扣除最后运作日债券成本市值、应收债券利息后的净额。

注3:截至2017年6月14日,审计费、律师费和汇划费中的人民币220.00元尚未支付,共计人民币45,220.00元在其他负债核算,在清算款划出日前支付。

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2017年5月23日基金净资产	9,785,439.49
减:清算期间净损失	31,462.88
减:基金净赎回金额(于2017年5月24日确认的投资者申购、赎回申请)	172,099.52
二、2017年6月14日基金净资产	9,581,877.09

资产处置及负债清偿后,于2017年6月14日本基金剩余财产为人民币9,581,877.09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2017年5月24日至清算款划出日前一日的应收利息亦属份额持有人所有。以上利息均按实际适用的利率计算,由基金管理人以自有资金垫付并已于清算终止前划入托管账户。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。

截至2017年6月14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9,682,571.57元,其中人民币200,000.00元系基金管理人代垫的结算备付金、存出保证金和应收利息。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) 长盛同泰债券型证券投资基金2017年5月23日资产负债表及清算审计报告
- (2) 《上海市海华永泰律师事务所关于长盛同泰债券型证券投资基金清算报告之法律意见》

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。

长盛同泰债券型证券投资基金基金财产清算小组

2017年6月14日