

长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

公告日期：2018年7月21日

一、重要提示

长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“长盛盛腾混合”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】2258号文核准注册，于2017年1月13日成立并正式运作，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

依据《长盛盛腾灵活配置混合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，基金管理人应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2018年6月1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，触发上述终止《基金合同》的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，经本基金管理人与基金托管人协商一致，拟终止《基金合同》并对基金财产进行清算，此次终止事由已经中国证券监督管理委员会备案同意。

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2018年6月18日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2018年6月19日）起本基金进入基金财产清算程序。基金登记机构于2018年6月19日完成了本基金最后运作日（即2018年6月18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2018年6月15日刊登在《中国证券报》和基金管理人网站上的《关于长盛盛腾灵活配置混合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2018年6月19日起进入清算期，由基金管理人长盛基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所于2018年6月19日组成基金财产清算小组，履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（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：长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：长盛盛腾混合。A类基金份额，基金代码：003596；C类基金份额，基金代码：003597）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2017年1月13日

4、2018年6月18日（基金最后运作日）基金份额总额：2,444,834.24份，其中A类基金份额240,957.71份，C类基金份额2,203,876.53份。

5、投资目标：通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在有效控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。

6、投资策略：本基金的投资策略包括大类资产配置、股票投资策略和债券投资策略。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：沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%。

8、风险收益特征：本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

9、基金管理人：长盛基金管理有限公司

10、基金托管人：兴业银行股份有限公司

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】2258号文《关于准予长盛盛腾灵活配置混合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12月20日至2017年1月11日向社会公开发行募集，《基金合同》于2017年1月13日正式生效，首次设立募集规模为300,028,320.91份基金份额。自2017年1月13日至2018年6月18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2018年6月1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2018年6月18日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2018年6月19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：长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月18日

单位：人民币元

最后运作日

2018年6月18日

资产：

银行存款 3,441,415.36

结算备付金 64,686.73

存出保证金 63,592.08

应收利息 13,472.85

应收申购款 350.00

资产总计 3,583,517.02

负债和所有者权益

负债：

应付赎回款 10,382.99

应付管理人报酬 1,199.52

应付托管费 299.88

应付销售服务费 357.69

其他负债 49,000.00

负债合计 61,240.08

所有者权益：

实收基金 2,444,834.24

未分配利润 1,077,442.70

所有者权益合计 3,522,276.94

负债和所有者权益总计 3,583,517.02

五、清算情况

自 2018 年 6 月 19 日至 2018 年 6 月 28 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《基金合同》第十八部分“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。

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，本基金的清算费用将由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币 64,686.73 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。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 63,592.08 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。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) 本基金最后运作日应收利息为人民币 13,472.85 元，主要包括应收活期存款利息、应收结算备付金利息和应收存出保证金利息，已于 2018 年 6 月 21 日划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收申购款人民币 350.00 元及 2018 年 6 月 19 日确认的应收申购款人民币 4,556.27 元，已于 2018 年 6 月 20 日前划入本基金托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款人民币 10,382.99 元及 2018 年 6 月 19 日确认的应付赎回款人民币 102,929.56 元，已于 2018 年 6 月 21 日前支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,199.52 元，该款项已于 2018 年 6 月 21 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 299.88 元，该款项已于 2018 年 6 月 21 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 357.69 元，该款项已于 2018 年 6 月 21 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 49,000.00 元，其中人民币 40,000.00 元为信息披露费，将于完成相关支付流程后从本基金托管账户中支付；账户维护费 9,000.00 元，其中中央国债登记结算有限责任公司账户维护费 4,500.00 元和银行间市场清算所账户维护费 4,500.00 元，均将于收到费用清单后从本基金托管账户中支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目

自 2018 年 6 月 19 日

至 2018 年 6 月 28 日止清算期间

一、清算收益

1、利息收入（注 1） 1,575.63

清算收入小计 1,575.63

二、清算费用

清算费用小计

三、清算净收益 1,575.63

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 6 月 19 日至 2018 年 6 月 28 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。

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 2018 年 6 月 18 日基金净资产 3,522,276.94

加：清算期间净收益 1,575.63

减：基金净赎回金额（于 2018 年 6 月 19 日确认的投资者申购、赎回申请） 98,373.92

二、2018 年 6 月 28 日基金净资产 3,425,478.65

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 6 月 28 日本基金剩余财产为人民币 3,425,478.65 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 2018 年 6 月 19 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。为便于及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息及结算备付金等。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，将于清算期后返还给基金管理人，基金财产清算完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

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) 长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 6 月 18 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盛腾灵活配置混合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。

长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018 年 6 月 28 日