

# 长盛盛禧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：中信银行股份有限公司

公告日期：2018年9月7日

## 一、重要提示

长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“长盛盛禧”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可（2016）2911号准予募集，并于2017年3月2日成立并正式运作，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）和《长盛盛禧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》”）的有关规定，长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人中信银行股份有限公司协商一致，由基金管理人召集，本基金基金份额持有人大会于2018年6月15日至2018年7月22日以通讯方式召开，并于2018年7月23日对本次持有人大会投票进行了统计，大会审议通过了《关于终止长盛盛禧灵活配置混合型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。基金管理人于2018年7月24日在指定媒介和基金管理人网站（[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)）上发布了《长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金自2018年7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、基金托管人中信银行股份有限公司、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同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：长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：长盛盛禧混合。A类基金份额，基金代码：004305；C类基金份额，基金代码：004306）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2017年3月2日

4、2018年7月23日（基金最后运作日）基金份额总额：5,133,014.18份，其中A类基金份额5,100,113.46份，C类基金份额32,900.72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，在严格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策略、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，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：50%\*沪深 300 指数收益率+50%\*中证综合债指数收益率。

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：中信银行股份有限公司

### 三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可〔2016〕2911号准予募集，由基金管理人于2017年2月21日至2017年2月27日向社会公开发行募集，《基金合同》于2017年3月2日正式生效，首次设立募集规模为600,095,547.15份基金份额。自2017年3月2日至2018年7月23日期间，本基金按《基金合同》正常运作。

根据《基金法》《运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，本基金基金份额持有人大会以通讯方式于2018年6月15日至2018年7月22日召开，审议并通过了《关于终止长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自2018年7月23日起生效。基金管理人于2018年7月24日在指定媒介和基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上发布了《长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金自2018年7月24日起进入清算期。

### 四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年7月23日

单位：人民币元

最后运作日

2018年7月23日

资 产：

银行存款 1,959,792.10

结算备付金 179,000.00

存出保证金 45,494.81

交易性金融资产 1,265,712.00

其中：股票投资 1,025,640.00

债券投资 240,072.00  
应收证券清算款 492,738.99  
应收利息 8,615.06  
资产总计 3,951,352.96  
负债和所有者权益  
负 债：  
应付管理人报酬 1,818.44  
应付托管费 303.03  
应付销售服务费 1.51  
应付交易费用 2,150.10  
其他负债 63,606.22  
负债合计 67,879.30  
所有者权益：  
实收基金 5,133,014.18  
未分配利润 -1,249,540.52  
所有者权益合计 3,883,473.66  
负债和所有者权益总计 3,951,352.96

## 五、清算情况

自 2018 年 7 月 24 日至 2018 年 8 月 10 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为人民币 179,000.00 元，2018 年 8 月 2 日划回结算备付金人民币 159,909.09 元至托管账户，余额为人民币 19,090.91 元。该款项由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。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为人民币 45,494.81 元，2018 年 8 月 2 日增加存出保证金人民币 1,670.94 元，余额为人民币 47,165.75 元。该款项由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。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 8,615.06 元，除应收债券利息外的应收银行存款利息、应收结算备付金利息和应收存出保证金利息，共计人民币 842.02 元，该款项由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。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。应收债券利息参见“2、资产处置情况”第（5）项所述。

（4）本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 492,738.99 元，该款项已于 2018 年 7 月 24 日划入本基金托管账户。

（5）本基金最后运作日持有的交易性金融资产余额为人民币 1,265,712.00 元，其中股票投资人民币 1,025,640.00 元，债券投资人民币 240,072.00 元。前述交易性金融资产明细如下：

①股票投资明细如下：

金额单位：人民币元

股票名称	股票代码	最后运作日估值
单价		
数量		
(股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
海航控股	600221	2.59 396,000 1,281,172.68 1,025,640.00

以上股票投资于 2018 年 7 月 24 日处置变现，处置损益为人民币-35,640.00 元，变现产生的证券清算款为人民币 988,922.08 元，已于 2018 年 7 月 25 日划入托管账户。交易费用为人民币 1,801.85 元（含应付佣金人民币 723.93 元），已在清算期内支付。

②债券投资明细如下：

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				
(张)				
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				
上交所	17 国债	17 019571	100.03	2,400 240,216.00 240,072.00 7,773.04

以上债券于 2018 年 7 月 24 日处置变现，处置损益为人民币-24.00 元，交易费用为人民币 0.25 元，清算期债券利息收入为人民币 21.90 元，变现产生的证券清算款为人民币 247,842.69 元，已于 2018 年 7 月 25 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管理费人民币 1,818.44 元、应付托管费人民币 303.03 元、应付销售服务费人民币 1.51 元, 应付交易费用人民币 2,150.10 元, 已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币 63,606.22 元, 其中人民币 22,356.36 元为信息披露费, 在清算期间冲减多预提的信息披露费人民币 356.36 元, 余额人民币 22,000 元, 将于完成相关支付流程后后支付; 人民币 20,000.00 元和人民币 10,000.00 分别为应付的持有人大会律师费和公证费, 已于清算期内支付; 人民币 11,249.86 元为应付账户维护费, 已于清算期内支付。

#### 4、清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	2018 年 7 月 24 日
至 2018 年 8 月 10 日止清算期间	
一、清算期间收益 (损失以“-” 填列)	
1、利息收入 (注 1)	1,428.15
2、处置交易性金融资产产生的净收益 (注 2)	-35,664.00
3、股息红利个税 (注 3)	-165.90
清算期间收益小计	-34,401.75
二、清算期间费用	
1、交易费用	1,802.10
2、审计费	15,000.00
3、律师费	20,000.00
4、账户维护费	750.14
5、银行汇划费	223.73
6、其他 (注 4)	-56.36
清算期间费用小计	37,719.61
三、清算期间净损益	-72,121.36

注 1: 利息收入系计提的自 2018 年 7 月 24 日至 2018 年 8 月 10 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息和债券利息。

注 2: 处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票最后运作日的股票估值总额后的差额以及卖出债券成交金额减去卖出债券最后运作日估值总额和截至变现日应收债券利息后的差额。

注 3: 股息红利个税系根据《股息红利差别化纳税会计核算细则》(中基协发[2012]21 号), 于最后运作日转让交割股票后的次一交易日, 根据中登公司按投资者实际持股期限计算的应缴税额计提应缴税款而确认的红字股利收益。

注 4: 清算期间冲减多预提的信息披露费人民币 356.36 元, 支付上清所结算服务费人民币 300.00 元。

## 5、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日 2018 年 7 月 23 日基金净资产 3,883,473.66

加：清算期间净损益 -72,121.36

减：基金净赎回金额（于 2018 年 7 月 24 日确认的投资者申购赎回申请） 1,007.03

二、2018 年 8 月 10 日基金净资产 3,810,345.27

截至本次清算期结束日 2018 年 8 月 10 日，本基金剩余财产为人民币 3,810,345.27 元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组将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财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 7 月 24 日至清算结束日 2018 年 8 月 10 日的银行存款等产生的利息已计入清算期间净损益，自本次清算期结束日次日 2018 年 8 月 11 日至本次清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。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将于清算款划出前划入托管账户，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。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。

## 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。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时对本基金剩余财产进行分配。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

(1) 长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于〈长盛盛禧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。

长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018年8月10日