

长信海外收益一年定期开放债券型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：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年8月29日

清算报告公告日：2018年10月22日

§ 1 重要提示

长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2016]458号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为244,272,655.91份。《基金合同》于2016年5月19日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行。

根据《基金合同》第二十部分“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,《基金合同》应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的;”根据基金管理人2018年8月3日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信海外收益一年定期开放债券型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已于2018年8月2日表决通过了《关于终止长信海外收益一年定期开放债券型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8月20日,自2018年8月21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、基金托管人中国民生银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)、上海源泰律师事务所于2018年8月21日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由德勤华永会计师事务所(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 长信海外收益一年定开债券(QDII)

基金主代码 519939

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年5月19日

报告期末(2018年8月20日)基金份额总额 3,761,029.98份

投资目标 本基金在严格控制信用、利率和流动性风险的前提下追求本金长期安全的基础上,通过积极和深入的宏观经济、行业和公司基本面研究力争为投资者创造较高的当期收益和长期资产增值。

投资策略 本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。本基金将通过对相关市场的宏观经济状况、市场利率走势、债券利差、证券市场走势、信用风险情况、以及各类资产的不同风险和回报的综合分析,在整体资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。

业绩比较基准 同期人民币三年期银行定期存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 长信基金管理有限责任公司

基金托管人 中国民生银行股份有限公司

注：基金管理人决定自 2018 年 3 月 15 日起对长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额归为人民币份额（基金代码为 519939），同时增设美元份额（基金代码为 004650），具体事宜可详见基金管理人于 2018 年 3 月 13 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金增设美元份额相关事项的公告》。美元份额与人民币份额并表披露。

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2016]458 号文批准公开募集。《基金合同》于 2016 年 5 月 19 日生效，首次设立募集基金份额为 244,272,655.91 份。

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 7 月 6 日 0:00 起至 2018 年 8 月 1 日 17:00 止以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，于 2018 年 8 月 2 日对表决结果进行统计，大会审议通过了《关于终止长信海外收益一年定期开放债券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。

根据管理人 2018 年 8 月 3 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信海外收益一年定期开放债券型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 8 月 20 日，自 2018 年 8 月 21 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 清算资产负债表

会计主体：长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金

单位：人民币元

项目 2018 年 8 月 20 日

(最后运作日) 2018 年 8 月 29 日

(清算结束日)

资产：

银行存款 14,971,960.13 3,635,978.63

结算备付金 --

存出保证金 --

交易性金融资产 --

应收利息 17,112.74 18,022.43

资产总计 14,989,072.87 3,654,001.06

负债和净资产

负债：

应付管理人报酬 --

应付托管费 --

应付交易费用 --

应付赎回款 11,332,186.61

其他负债 53,773.95 50,000.00

负债合计 11,385,960.56 50,000.00

所有者权益：

实收基金 3,761,029.98 3,761,029.98
未分配利润 -157,917.67 -157,028.92
所有者权益合计 3,603,112.31 3,604,001.06

负债和所有者权益总计 14,989,072.87 3,654,001.06

注：1、截止最后运作日，本基金人民币份额净值 0.9580 元，人民币总份额 3,761,029.98 份；本基金美元份额净值 0.1394 美元，美元总份额 0 份。

2、本财务报告已经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师曾浩、吴凌志签字出具了德师报(审)字(18)第 S00439 号标准无保留意见的审计报告。

4.2 清算损益表

会计主体：长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金

单位：人民币元

项目 2018 年 8 月 21 日

(清算开始日)至

2018 年 8 月 29 日

(清算结束日)

一、收入 908.75

1、利息收入（注 1） 909.69

2、其他收入 -

3、汇兑损益（注 2） -0.94

二、费用 20.00

1、管理人报酬 -

2、基金托管费 -

3、交易费用 -

4、利息支出 -

5、税金及附加 -

6、其他费用（注 3） 20.00

三、利润总额 888.75

减：所得税费用 -

四、净收益 888.75

§ 5 基金财产分配

自 2018 年 8 月 21 日至 2018 年 8 月 29 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 资产负债处置情况

5.1.1 本基金最后运作日持有银行存款 14,971,960.13 元，其中人民币存款 14,969,910.20 元，美元存款 298.31 美元（按当日估值汇率折合人民币 2,049.93 元）。美元存款用于支付美元赎回款及相关费用，剩余部分已于清算期间结汇。

5.1.2 本基金最后运作日应付赎回款为 11,332,186.61 元，其中人民币应付赎回款 11,330,288.62 元，美元应付赎回款 276.20 美元（按当日估值汇率折合人民币 1,897.99 元）。

5.1.3 本基金最后运作日其他负债为人民币 53,773.95 元，该款项包含预提信息披露费人民币 50,000.00 元及应付赎回费 3,773.95 元。

5.1.4 清算期间利息收入系以当前适用利率预估计提的自 2018 年 8 月 21 日(清算开始日)至 2018 年 8 月 29 日(清算结束日)期间的银行存款利息收入人民币 909.69 元。(注 1)

5.1.5 根据《长信基金管理有限责任公司关于长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金自 2018 年 8 月 3 日起，已停止收取基金管理费、基金托管费。

5.1.6 清算期间汇兑损益系自 2018 年 8 月 21 日(清算开始日)至 2018 年 8 月 29 日(清算结束日)止清算期间由于结汇及汇率浮动产生的损益人民币-0.94 元。(注 2)

5.1.7 清算期间其他费用系自 2018 年 8 月 21 日(清算开始日)至 2018 年 8 月 29 日(清算结束日)止清算期间产生的汇划手续费人民币 20.00 元。(注 3)

5.2 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 8 月 20 日基金净资产 3,603,112.31

加：清算期间净收益 888.75

二、2018 年 8 月 29 日基金净资产 3,604,001.06

截至 2018 年 8 月 29 日(清算结束日)，本基金剩余资产为人民币 3,604,001.06 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(清算起始日 2018 年 8 月 21 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有)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。其中，本次清算的律师费用由本基金管理人承担。

为保护委托人利益，加快清盘速度，管理人将垫付应收利息，管理人垫付资金孳生的利息归管理人所有。

5.3 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、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金 2018 年 8 月 20 日(最后运作日)资产负债表、2018 年 8 月 29 日(清算结束日)资产负债表及审计报告；
- 2、《长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金清算报告》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>。

长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金财产清算小组
2018 年 8 月 29 日