

长盛同禧债券型证券投资基金
清算报告

2019年1月18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：2019年3月6日

一、重要提示

长盛同禧债券型证券投资基金（以下简称“长盛同禧”或“本基金”）由长盛同禧信用增利债券型证券投资基金（以下简称“长盛同禧信用增利”）根据中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1697号文变更注册而来。长盛同禧信用增利经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1401号文批准募集，于2011年12月6日成立，募集规模37.01亿元，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《长盛同禧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，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的，按其规定办理。”截至2018年11月7日，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元，触发上述终止《基金合同》情形。为保护投资者利益，根据《基金合同》约定，基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”）与基金托管人中国银行协商一致，并向中国证券监督管理委员会备案，决定终止《基金合同》并进行基金财产清算，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12月25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12月26日）起本基金进入基金财产清算程序。《基金合同》终止及基金财产清算安排详见2018年12月22日刊登在《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》和基金管理人网站上的《关于长盛同禧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》。

本基金自2018年12月26日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国银行、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2018年12月26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：长盛同禧债券型证券投资基金（基金简称：长盛同禧A，基金代码：080009；长盛同禧C，基金代码：080010）
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金合同生效日：2011年12月6日
- 4、2018年12月25日（基金最后运作日）基金份额总额：5,221,995.27份（其中，长盛同禧A份额总额：3,392,387.30份；长盛同禧C份额总额：1,829,607.97份）。
- 5、投资目标：在控制风险和保持资产流动性的基础上，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
- 6、投资策略：本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。
- 7、业绩比较基准： $40\% \times \text{中证国债指数收益率} + 60\% \times \text{中证企业债指数收益率}$ 。
- 8、风险收益特征：本基金为债券型基金，其长期平均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

本基金由长盛同禧信用增利根据中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1697号文变更注册而来。长盛同禧信用增利经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1401号文核准募集，由基金管理人长盛基金于2011年10月31日至2011年12月2日向社会公开发行募集，于2011年12月6日成立，首次设立募集规模为3,700,861,505.32份基金份额（含利息结转份额）。自2011年12月6日至2018年12月25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，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11月7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，并向中国证券监督管理委员会备案，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12月25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12月26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：长盛同禧债券型证券投资基金

报告截止日：2018年12月25日

单位：人民币元

| | 最后运作日 2018年12月25日 |
|-------------|----------------------|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 1,243,067.49 |
| 结算备付金 | 2,438.83 |
| 存出保证金 | 7,086.73 |
| 交易性金融资产 | 4,274,931.30 |
| 其中：股票投资 | |
| 债券投资 | 4,274,931.30 |
| 资产支持证券投资 | |
| 基金投资 | |
| 衍生金融资产 | |
| 买入返售金融资产 | |
| 应收证券清算款 | 214,168.49 |

| | |
|-----------------|--------------|
| 应收利息 | 69,792.84 |
| 应收股利 | |
| 应收申购款 | 649.35 |
| 其他资产 | |
| 资产总计 | 5,812,135.03 |
| 负债和所有者权益 | |
| 负债： | |
| 短期借款 | |
| 交易性金融负债 | |
| 衍生金融负债 | |
| 卖出回购金融资产款 | |
| 应付证券清算款 | |
| 应付赎回款 | 292,937.49 |
| 应付管理人报酬 | 2,862.22 |
| 应付托管费 | 763.25 |
| 应付销售服务费 | 504.15 |
| 应付交易费用 | 1,133.20 |
| 应付税费 | 126,834.49 |
| 应付利息 | |
| 应付利润 | |
| 其他负债 | 335,099.11 |
| 负债合计 | 760,133.91 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 5,221,995.27 |
| 未分配利润 | -169,994.15 |
| 所有者权益合计 | 5,052,001.12 |
| 负债与持有人权益总计： | 5,812,135.03 |

五、清算情况

自2018年12月26日至2019年1月18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》“第二十三部分 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。

但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，本基金清算期间的审计费、律师费将由基金管理人支付。

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2,438.83元，已于2019年1月3日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币7,086.73元，2019年1月3日增加存出保证金人民币1,260.99元，截至清算期结束日余额人民币8,347.72元，由基金管理人长盛基金管理有限公司在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，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69,792.84元，其中应收银行存款利息人民币65.20元、应收结算备付金利息人民币1.72元、应收债券利息人民币69,725.92元。清算期间产生应收银行存款利息人民币1,355.07元、应收结算备付金利息人民币9.42元、应收债券利息人民币4,202.92元，共计人民币5,567.41元；清算期间收到债券应收利息人民币73,928.84元。清算结束日应收利息余额为人民币1,431.41元。该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户，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。应收债券利息参见资产处置情况(6)所述。

(4) 本基金最后运作日应收申购款为人民币649.35元，该款项于2018年12月26日划入托管户。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币214,168.49元，该款项于2018年12月26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余额为人民币4,274,931.30元，全部为债券投资，明细如下：

金额单位：人民币元

| 序号 | 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 估值总额 | 最后运作日应 收利息 |
|----|------|------|---------------|-----------|---------------|---------------|
|----|------|------|---------------|-----------|---------------|---------------|

| | | | | | | |
|---|----------|--------|--------|--------|--------------|-----------|
| 1 | 21 国债(7) | 010107 | 102.79 | 6,510 | 669,162.90 | 11,245.00 |
| 2 | 03 国债(3) | 010303 | 100.58 | 8,850 | 890,133.00 | 5,770.68 |
| 3 | 16 凤凰 EB | 132007 | 96.10 | 4,880 | 468,968.00 | 598.97 |
| 4 | 17 山高 EB | 132008 | 98.00 | 4,850 | 475,300.00 | 4,445.52 |
| 5 | 国开 1701 | 018005 | 100.37 | 4,000 | 401,480.00 | 10,936.11 |
| 6 | 国开 1702 | 018006 | 101.70 | 2,000 | 203,400.00 | 5,656.11 |
| 7 | 国开 1704 | 108602 | 100.82 | 11,570 | 1,166,487.40 | 31,073.53 |
| | 合计 | | | | 4,274,931.30 | 69,725.92 |

以上债券于2019年1月11日前全部处置变现，处置收益人民币21,581.29元，交易费用人民币21.62元，清算期间应收债券利息人民币4,202.92元，变现产生的证券清算款为人民币4,370,419.81元，已于2019年1月14日前全部划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币292,937.49元，该款项已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币2,862.22元，应付托管费为人民币763.25元，应付销售服务费为人民币504.15元，款项已于2019年1月3日支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币1,133.20元，该款项已于2019年1月15日支付。

(4) 本基金最后运作日应交税费为人民币126,834.49元，其中应交增值税和应交附加税为人民币32.97元和3.96元，已于2019年1月15日从托管户划出；应交债券利息所得税为人民币126,797.56元，将于税务机关指定时间从本基金托管账户中划出。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币335,099.11元，其中证券交易监管费人民币12,686.59元、银行间账户服务费人民币8,412.52元，已于清算期间内支付；应付2018年年度报告审计费为人民币50,000.00元，待完成支付流程后支付；应付2018年度信息披露费为人民币264,000.00元，其中应付证券时报和中国证券报信息披露费各88,000.00元，款项已于2019年1月8日支付，应付上海证券报信息披露费为人民币88,000.00元，待完成支付流程后支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 2018年12月26日 至2019年1月18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） | 5,557.69 |
| 2、处置交易性金融资产产生的净损益（注2） | 21,581.29 |
| 清算期间收益小计 | 27,138.98 |
| 二、清算期间费用 | |
| 1、交易费用 | 21.62 |
| 2、税金及附加 | 1.16 |
| 3、汇划手续费 | 130.00 |
| 4、账户维护费 | 3,987.48 |
| 清算期间费用小计 | 4,140.26 |
| 三、清算期间净损益 | 22,998.72 |

注1：利息收入系计提的自2018年12月26日至2019年1月18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损益系清算期间卖出债券成交金额减去卖出债券最后运作日债券估值总额和截至变现日应收债券利息后的差额。

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12月25日基金净资产 | 5,052,001.12 |
| 加：清算期间净损益 | 22,998.72 |
| 减：基金净赎回金额（于2018年12月26日确认的投资者申购、赎回申请） | 297,051.85 |
| 二、2019年1月18日基金净资产 | 4,777,947.99 |

截至本次清算期结束日2019年1月18日，本基金剩余财产为人民币

4,777,947.99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（本基金清算期间的审计费、律师费由基金管理人支付，不从基金财产中支付）、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。

自清算起始日（2018年12月26日）至清算结束日（2019年1月18日）的银行存款等产生的利息已计入清算期间净损益，自清算结束日次日（2019年1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。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。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 长盛同禧债券型证券投资基金清算审计报告2019年1月18日

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于〈长盛同禧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。

长盛同禧债券型证券投资基金基金财产清算小组

2019年1月18日