

长江资管凌波 1 号集合资产管理计划清算报告

一、计划介绍

长江资管凌波 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2017 年 5 月 12 日正式公告成立，不设固定管理期限。由于本集合计划存续期间委托人数少于 2 人，根据《证券公司集合资产管理业务实施细则》《长江资管凌波 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的有关约定，本集合计划于 2018 年 12 月 25 日终止。截至 2019 年 9 月 27 日，管理人已完成部分持仓证券的变现。经本集合计划管理人长江证券（上海）资产管理有限公司（以下简称我公司）和托管人宁波银行股份有限公司协商一致，决定本集合计划于 2019 年 9 月 27 日进行第六次清盘。

二、清算方案

依据本集合计划资产管理合同的有关约定，管理人长江证券（上海）资产管理有限公司会同托管人宁波银行股份有限公司、中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）设立本集合计划清算小组。清算小组按照本集合计划资产管理合同约定的清算程序进行清算，清算收入归本集合计划所有，清算费用由本集合计划承担。

清算小组于 2019 年 9 月 27 日前对本集合计划持有的资产进行了评估和变现，并对各项负债进行了确认和清偿，最终确定了本集合计划剩余资产。清算小组将按照本集合计划剩余资产值及各持有人的份额比例，确认各持有人分配金额，并以货币的形式分配给本集合计划持有人。

另针对本集合计划的应收款项(包括银行存款利息)，因存款银行管

理规则限定，在清算期内无法收回，待产品最终清盘结束后，与剩余资产一并返还委托人。

清算小组将于 2019 年 10 月 9 日按照本集合计划持有人的分配金额向销售机构统一划付。

三、清算情况

截止清算期末，本集合计划的资产、负债、实收资本及资产净值情况如下：

1. 资产

- (1) 宁波银行活期存款：13,639,557.69 元；
- (2) 存出保证金：2,087.22 元；
- (3) 债券投资：9,992,000.00 元；
- (4) 理财产品：34,290,000.00 元；
- (5) 买入返售金融资产：60,000,000.00 元；
- (6) 应收利息：2,334,762.60 元。

2. 负债

- (1) 应付管理人报酬：3,710,929.64 元：其中应付基金管理费 51,688.82 元，应付业绩报酬 3,659,240.82 元；
- (2) 应付托管费：2,584.44 元；
- (3) 应交税费：3,102.07 元；
- (4) 其他应付款：4,984.68 元。

3. 实收资本

集合计划持有人总份额 104,242,275.93 份。

4. 资产净值

集合计划资产净值 116,507,897.69 元。

5. 单位净值

集合计划单位净值 1.1177 元。

四、剩余资产分配

本集合计划清算期末剩余资产 116,507,897.69 元,其中可分配资产 12,000,000.00 元,本集合计划应付管理人业绩报酬 3,659,240.82 暂不支付,预留 1,577,197.68 元应对可能发生的应付款项及交易所最低备付金、保证金调整。本集合计划分配资金共计 12,000,000.00 元,由本集合计划清算小组于 2019 年 10 月 9 日 15 时前通过本集合计划宁波银行托管户划付至销售机构的指定收款账户。

资产管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

（印签）

2019 年 月 日