

长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金
清算报告

2020 年 9 月 17 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

公告日期：2020 年 9 月 22 日

一、重要提示

长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金（以下简称“长盛同瑞”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】1659号文核准注册，于2011年12月6日成立并正式运作，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本基金管理人经与本基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，提议终止《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。

本基金管理人于2020年7月17日至2020年8月16日期间以通讯方式组织召开了本基金基金份额持有人大会，会议审议并表决通过了《关于终止长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，会议决议自2020年8月17日起生效。本基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告详见刊登在规定媒介和管理人网站上的《长盛同瑞中证200指数分级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2020年8月19日进入清算程序。基金管理人长盛基金管理有限公司、基金托管人中国农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2020年8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

基金名称	长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金
基金简称	长盛同瑞中证200分级
场内简称	长盛同瑞
基金代码	160808

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月6日
基金最后运作日（2020年8月18日）基金份额总额	8,246,284.86份
投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内，以实现中证200 指数的有效跟踪。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，按照成份股在中证200指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证200指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证200指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证200 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分拆的两类基金份额来看，同瑞A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；同瑞B份额具有高风险、高预期收益的特征。
基金管理人	长盛基金管理有限公司

基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年1月12日		
下属分级基金的基金简称	长盛同瑞中证200 分级	长盛同瑞A	长盛同瑞B
下属分级基金场内简称	长盛同瑞	同瑞A	同瑞B
下属分级基金的交易代码	160808	150064	150065
最后运作日（2020年8月18日）下属分级基金的份额总额	6,095,022.86	860,505.00	1,290,757.00

三、基金运作情况概述

长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金（以下简称“长盛同瑞分级”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可〔2011〕1659号文核准，于2011年12月6日成立，募集规模6.2亿元。基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金之长盛同瑞A份额与长盛同瑞B份额经深圳证券交易所深证上〔2012〕4号文批准，于2012年1月12日上市交易。

本基金管理人于2020年7月17日至2020年8月16日期间以通讯方式组织召开了本基金基金份额持有人大会，会议审议并表决通过了《关于终止长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，会议决议自2020年8月17日起生效。

根据基金管理人于2020年8月18日发布的《长盛同瑞中证200指数分级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2020年8月19日进入清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日（2020年8月18日）期间，本基金正常运

作。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金

报告截止日：2020年8月18日

单位：人民币元

	最后运作日 2020年8月18日
资 产：	
银行存款	569,966.10
存出保证金	666.72
交易性金融资产	9,638,536.19
其中：股票投资	9,625,536.19
债券投资	13,000.00
应收证券清算款	22,302.70
应收利息	6,616.33
应收申购款	8,255.58
资产总计	10,246,343.62
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	23,738.52
应付管理人报酬	3,996.79
应付托管费	799.37
应付交易费用	1,711.63
其他负债	54,469.45
负债合计	84,715.76
所有者权益：	

实收基金	6,843,088.01
未分配利润	3,318,539.85
所有者权益合计	10,161,627.86
负债和所有者权益总计	10,246,343.62

注：报告截止日2020年8月18日(基金最后运作日)，长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金份额总额为8,246,284.86份，其中长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金之长盛同瑞基础份额为6,095,022.86份，基金份额净值为1.232元；长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金之长盛同瑞A 份额为860,505.00份，基金份额参考净值为1.032元；长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金之长盛同瑞B 份额为1,290,757.00份，基金份额参考净值为1.365元。

五、清算情况

自2020年8月19日至2020年9月17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》二十四“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) 本基金最后运作日存出保证金人民币666.72元，2020年9月2日中国证券登记结算有限责任公司收取存出保证金2,556.00元，余额为3,222.72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) 本基金最后运作日应收利息为人民币6,616.33元，除应收债券利息外的应收银行存款利息及应收存出保证金利息，共计人民币6,614.88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申购款人民币8,255.58元及2020年8月19日确认的应收申购款人民币1,353.72元，已于2020年8月21日前划入本基金托管账户。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币9,638,536.19元，其中股票投资人民币9,625,536.19元，债券投资人民币13,000.00元，于清算期内全部变现。

其中股票投资于2020年8月25日前处置变现，处置损益人民币-216,971.96元，变现产生的证券清算款为人民币9,398,321.45元，已于2020年8月26日前划入托管账户。交易费用为人民币19,005.72元，含应付佣金人民币8,762.94元，已在清算期内支付。

其中债券于2020年9月10日前处置变现，处置损益人民币3,134.05元，交易费用人民币0.16元，变现产生的证券清算款为人民币16,136.54元，已于2020年9月11日前划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款人民币23,738.52元，应付赎回费人民币21.21元及2020年8月19日确认的应付赎回款人民币54,003.21元，应付赎回费人民币89.47元已于2020年8月22日前支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币3,996.79元，该款项已于清算期内支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币799.37元，该款项已于清算期内支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币1,711.63元，清算期间处置交易性金融资产产生的应付佣金人民币8,762.94元，共计10,474.57元，该款项已于清算期内支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币54,469.45元，包括预提上市费用40,000.00元，已于清算期内支付；应付管理公司代垫中登备付金及保证金的利息及应付证管费共计人民币14,448.24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	自2020年8月19日 至2020年9月17日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	12,198.49
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	-232,843.79
股息红利及股息红利个税（注3）	-3,037.09
清算期间收益小计	-223,682.39
二、清算期间费用	
清算期间费用小计	-
三、清算期间净损益	-223,682.39

注1：利息收入系计提的2020年8月19日至2020年9月17日止清算期间的银行存款利息、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及交易费用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、截至变现日应收债券利息及交易费用后的差额。

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。

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2020年8月18日基金净资产	10,161,627.86
加：清算期间净收益	-223,682.39
减：基金净赎回金额（于2020年8月19日确认的投资者申购、赎回申请）	-52,738.96
二、2020年9月17日基金净资产	9,885,206.51

资产处置及负债清偿后，于2020年9月17日本基金剩余财产为人民币9,885,206.51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。

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交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算长盛同瑞基础份额、长盛同瑞A份额与长盛同瑞B份额各自的应计分配比例，并据此由长盛同瑞基础份额、长盛同瑞A份额与长盛同瑞B份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日2020年8月19日至清算款划出日前一日的应收利息亦属基金份额持有人所有。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) 《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金2020年1月1日至2020年8月18日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛同瑞中证200指数分级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。

长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金财产清算小组

2020年9月17日