

# 长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金 清算报告

2015 年 8 月 12 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：2015 年 9 月 10 日

## 一、重要提示

长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金（以下简称“季季红”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】367号文核准募集，于2013年6月14日成立并正式运作，基金托管人为中国银行股份有限公司。

依据《长盛季季红1年期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》”）“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“基金合同生效后，在每个开放期的最后一日日终（基金登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认后），如发生以下情形之一的，则无须召开持有人大会，基金合同将于该日次日终止并根据本基金合同第二十部分的约定进行基金财产清算：（1）基金资产净值低于5000万元；（2）基金份额持有人人数少于200人；（3）本基金前十名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的90%。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”基金登记机构于2015年7月27日完成了本基金在开放期最后一日（即2015年7月24日）申购、赎回业务申请的确认，业务确认后本基金基金资产净值为4902万元，已触发基金合同中约定的本基金终止条款。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，无须召开基金份额持有人大会，本基金基金合同终止并进入基金财产清算程序。本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见刊登在2015年7月28日《证券日报》和基金管理人网站上的《关于长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金触发基金合同终止条款及基金财产清算的公告》。

本基金从2015年7月28日起进入清算期，由基金管理人长盛基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、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2015年7月27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

1、基金名称：长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金（基金简称：长盛季季红1年期债券。长盛季季红1年期债券A，基金代码：000145；长盛季季红1年

期债券C，基金代码：000146)

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2013年6月14日

4、2015年7月27日基金份额总额：47,653,170.84份，其中A类份额37,670,990.31份，C类份额9,982,180.53份。

5、投资目标：在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，给投资者带来长期的现金红利收益。

6、投资策略：本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的投资策略包括大类资产配置策略、债券组合管理策略和期限管理策略。

7、业绩比较基准：一年期银行定期存款税后收益率

8、风险收益特征：本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、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

本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2013】367号文《关于核准长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准，由基金管理人长盛基金管理有限公司于2013年5月15日至2013年6月7日向社会公开发行人募集，基金合同于2013年6月14日正式生效，首次设立募集规模为1,396,003,609.71份基金份额。自2013年6月14日至2015年7月27日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金合同》约定，本基金在每个开放期的最后一日日终（基金登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认后），基金资产净值低于5000万元，或者基金份额持有人人数少于200人，或者本基金前十名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的90%，则无须召开持有人大会，基金合同终止。

2014年7月12日至2015年7月11日为本基金第二个封闭运作期，封闭运作期结束后，本基金于2015年7月13日（含该日，2015年7月12日为非工作日）至2015年7月24

日（含该日）开放申购、赎回及转换业务。基金登记机构于2015年7月27日完成了本基金在开放期最后一日（即2015年7月24日）申购、赎回业务申请的确认，业务确认后本基金基金资产净值为4902万元，已触发基金合同中约定的本基金终止条款。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，无须召开基金份额持有人大会，本基金将终止并依法履行基金财产清算程序，本基金自2015年7月28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：长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2015年7月27日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2015年7月27日
资 产：	
银行存款	46,596,974.45
结算备付金	1,055,771.82
存出保证金	25,940.57
应收利息	18,623.54
应收申购款	3,621,558.71
资产总计	51,318,869.09
负 债：	
应付管理人报酬	58,473.35
应付托管费	17,542.00
应付销售服务费	4,373.36
应付赎回款	2,138,188.68
应付交易费用	2,230.00
应交税费	4,598.36

其他应付款	200.00
预提费用	79,782.56
负债合计	2,305,388.31
所有者权益：	
实收基金	47,653,170.84
未分配利润	1,360,309.94
所有者权益合计	49,013,480.78
负债和所有者权益总计	51,318,869.09

## 五、清算情况

自2015年7月28日至2015年8月12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《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》第二十部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，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) 本基金最后运作日应收申购款（含应收转入款）为人民币3,621,558.71元，已于2015年7月28日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币1,055,771.82元，已于2015年8月4日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户人民币281,853.51元，剩余人民币773,918.31元将由基金管理人长盛基金管理有限公司在剩余资产划付日前以自有资金垫付至托管账户。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。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币25,940.57元，已于2015年8月4日由中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收利息为人民币18,623.54元, 将由基金管理人长盛基金管理有限公司在剩余资产划付日前以自有资金垫付至托管账户。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。

### 3、 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款(含应付转出款)为人民币2,138,188.68元, 其中人民币1,180,077.29元, 已于2015年7月28日支付; 人民币958,111.39元, 已于2015年7月29日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币58,473.35元, 该款项已于2015年7月28日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币17,542.00元, 该款项已于2015年7月28日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币4,373.36元, 该款项已于2015年7月28日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币2,230.00元, 其中银行间结算费为人民币1,650.00元, 已于2015年7月30日支付; 交易手续费为人民币580.00元, 已于2015年8月7日支付。

(6) 本基金最后运作日预提费用为人民币79,782.56元, 其中应付信息披露费为人民币51,288.64元, 已于2015年8月7日支付人民币51,000.00元, 剩余人民币288.64元冲减清算费用; 应付审计费为人民币28,493.92元, 已于2015年8月7日支付。

(7) 本基金最后运作日其他应付款为人民币200.00元, 该款项已于2015年8月7日支付。

### 4、 清算日的清算损益情况

项目	自2015年7月28日至2015年8月12日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入-银行存款利息收入(注1)	16,056.01
2、其他收入(注2)	4,598.36

清算收益小计	20,654.37
二、清算费用	
1、律师费	20,000.00
2、会计师费	11,506.08
3、信息披露费	-288.64
4、划款手续费	85.00
5、银行间账户维护费	3,000.00
清算费用小计	34,302.44
三、清算净收益	-13,648.07

注1:利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2015年7月28日至2015年8月12日止清算期间的银行存款利息及结算备付金利息。

注2:其他收入系应交税费,因基金管理人不是法定扣缴义务人,故在本清算期转为其他收入,作为剩余资产分配给基金份额持有人。

#### 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 2015 年 7 月 27 日基金净资产	49,013,480.78
加:清算期间净收益	-13,648.07
二、2015 年 8 月 12 日基金净资产	48,999,832.71

资产处置及负债清偿后,于2015年8月12日本基金剩余财产为人民币48,999,832.71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2015年7月28日至清算款划出日前一日的银行存款产生的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资产,基金管理人长盛基金管理有限公司将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将于清算

期后返还给基金管理人，基金财产清偿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)长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金2015年7月27日资产负债表及审计报告

(2)《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

#### 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。

长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2015年8月12日