

# 长城淘金一年期理财债券型证券投资基金清算报告

## 1、重要提示

长城淘金一年期理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2014]364号文核准募集，于2014年5月7日成立并正式运作。

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》和《长城淘金一年期理财债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金进行基金财产清算并终止《基金合同》。本基金《基金合同》终止及清算的公告详见2016年8月25日刊登在《上海证券报》和基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）上的《关于长城淘金一年期理财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2016年8月25日起进入清算程序，由本基金管理人长城基金管理有限公司、基金托管人中信银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所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，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 2、基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城淘金一年期理财债券型证券投资基金
基金简称	长城淘金理财债券
基金主代码	000611
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月7日
基金最后运作日	2015年5月7日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金严格采用买入持有到期策略，将基金资产配置于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的固定收益资产，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期初，将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境进行封闭期组合构建。在封闭期内，本基金严格采用买入持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例稳定。本基金资产投资于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的债券类资产、债券回购和银行存款，力求基金资产在开放前可完全变现。
业绩比较基准	每个封闭期同期对应的一年期定期存款利率（税后） $\times 1.1$ 。
风险收益特征	本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金。

## 3、基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2014]364号文核准，由基金管理人长城基金管理有限公司于2014年4月10日至2014年5月5日向社会公开募集，《基金合同》于2014年5月7日正式生效，募集规模为230,123,093.86份基金份额。

自2014年5月7日至2015年5月7日期间，本基金按《基金合同》正常运作。2015年5月7日日终，本基金全部基金份额自动赎回。之后，本基金暂停运作。

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》和《基金合同》的有关规定，本基金自2016年8月25日起进入清算程序。

## 4、审计报告

安永华明(2016)专字第60737541\_H04号  
长城淘金一年期理财债券型证券投资基金基金财产清算小组：

我们审计了后附的长城淘金一年期理财债券型证券投资基金的清算报表，包

括截至最后运作日 2015 年 5 月 7 日长城淘金一年期理财债券型证券投资基金资产负债表及自 2016 年 8 月 25 日至 2016 年 9 月 14 日止期间的清算事项说明。清算报表已由长城淘金一年期理财债券型证券投资基金财产清算小组按照后附的清算事项说明二所述的编制基础编制。

一、长城淘金一年期理财债券型证券投资基金基金财产清算小组对清算报表的责任

长城淘金一年期理财债券型证券投资基金基金财产清算小组负责按照后附的清算事项说明二所述的编制基础编制清算报表，并负责设计、执行和维护必要的内部控制，以使清算报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对清算报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对清算报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关清算报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的清算报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与清算报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价长城淘金一年期理财债券型证券投资基金财产清算小组选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价清算报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述清算报表在所有重大方面已经按照后附的清算事项说明二所述的编制基础编制。

四、编制基础以及对分发和使用的限制

我们提醒报表使用者关注后附的清算事项说明二所述的编制基础的说明。本报告仅供长城淘金一年期理财债券型证券投资基金基金财产清算小组呈报长城

淘金一年期理财债券型证券投资基金全体持有人以及中国证券监督管理委员会使用。因使用不当造成的后果,与执行本业务的注册会计师及会计师事务所无关。本段内容不影响已发表的审计意见。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师 吴翠蓉

中国 北京

中国注册会计师 乌爱莉

2016年9月14日

## 5、资产负债表

## 长城淘金一年期理财债券型证券投资基金最后运作日资产负债表

单位：人民币元

	最后运作日 2015年5月7日
<b>资产：</b>	
银行存款	246,600,645.66
结算备付金	657,763.73
存出保证金	308,175.92
应收利息	24,899.02
资产总计	247,591,484.33
<b>负债：</b>	
应付交易费用	1,985.63
其他负债	1,063,917.93
负债合计	1,065,903.56
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	230,123,093.86
未分配利润	16,402,486.91
所有者权益合计	246,525,580.77
负债和所有者权益总计	247,591,484.33

## 6、清算事项说明

## 6.1 长城淘金一年期理财债券型证券投资基金简介

## 6.1.1 基本情况

长城淘金一年期理财债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2014]364号文“关于核准长城淘金一年期理财债券型证券投资基金募集的批复”的核准,由长城基金管理有限公司自2014年4月10日至2014年5月5日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014)验字第60737541\_H02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年5月7日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,以每个封闭期为周期进行投资运作,每个封闭期为1年。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币230,000,000.00元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币123,093.86元,以上实收基金(本息)合计为人民币230,123,093.86

元，折合 230,123,093.86 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金投资的债券包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、分离交易可转债纯债等。货币市场工具包括：现金、通知存款、定期存款、协议存款、大额可转让存单、债券回购等。本基金投资于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的债券类资产、债券回购和银行存款。本基金不进行股票等权益类资产的投资。本基金的业绩比较基准为：每个封闭期同期对应的一年期定期存款利率（税后） $\times 1.1$ 。

根据《基金合同》规定，基金合同生效后的存续期内，每个封闭期到期前，基金管理人可以根据市场环境、产品特点等情况综合评估基金在下一封闭期的风险收益，决定基金进入开放期或暂停进入开放期，并提前公告。如本基金决定暂停进入开放期，应报中国证监会备案。如出现暂停进入开放期的情形，本基金将在封闭期结束前使基金财产保持为现金形式。在封闭期的最后一日，全部基金份额按封闭期最后一个工作日的基金份额净值自动赎回，赎回款项将在该日后的 5 个工作日内返还给投资人。本基金暂停进入开放期或暂停封闭期运作的期间，基金合同不终止，本基金不收取管理费、托管费、销售服务费，基金运作的相关账户继续保留，本基金财产不进行清算。暂停进入开放期或暂停封闭期运作期间所发生的基金费用，由基金管理人承担。

### 6.1.2 清算原因

根据《基金合同》的规定，基金合同的当事人为基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。本基金暂停运作并赎回全部基金份额后，本基金不再有基金份额持有人，基金合同当事人为基金管理人和基金托管人。经基金合同当事人协商一致并向中国证监会备案后，决定终止本基金基金合同，并依法履行基金财产清算程序。

### 6.1.3 清算起始日

根据长城基金管理有限公司于 2016 年 8 月 25 日公布的《关于长城淘金一年期理财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》，本基金于 2016 年 8 月 25 日起进入清算程序，故本基金清算起始日为 2016 年 8 月 25 日。

## 6.2 清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 6.3 暂停运作情况

长城基金管理有限公司已于 2015 年 4 月 22 日发布《关于长城淘金一年期理财债券型证券投资基金第一个封闭期到期后暂停运作、不接受申购等安排的公告》，本基金于第一个封闭期到期后暂停进入开放期、不再接受申购。按照《基金合同》的约定，在本基金第一个封闭期的最后一个工作日（即 2015 年 5 月 7 日），全部基金份额已按当日的基金份额净值自动赎回，赎回款项在该日后的 5 个工作日内返还给投资人。

本基金第一个封闭期届满后，本基金停止收取基金管理费、基金托管费，本基金暂停运作。截至本基金清算起始日前一日，长城基金管理有限公司根据基金合同的规定，已完成对本基金资产的处置、负债的清偿及剩余资产的分配工作，本基金基金份额为 0。

本基金第一个封闭期的最后一个工作日为最后运作日（即 2015 年 5 月 7 日），本基金于第一个封闭期届满后，基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

### 6.3.1 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币 657,763.73 元，该款项已于 2015 年 5 月 7 日由基金管理人长城基金管理有限公司以自有资金垫付。

(2) 本基金最后运作日存出保证金人民币 308,175.92 元，该款项已于 2015 年 5 月 7 日由基金管理人长城基金管理有限公司以自有资金垫付。

(3) 本基金最后运作日应收利息人民币 24,899.02 元，该款项已于 2015 年 5

月7日由基金管理人长城基金管理有限公司以自有资金垫付。

### 6.3.2 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,985.63 元, 该款项已于 2015 年 7 月 31 日支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币 1,063,917.93 元, 包括其他应付款-管理人垫资款人民币 1,050,000 元, 预提审计费用人民币 13,917.93 元。其中, 预提审计费用人民币 13,917.93 元已于 2015 年 7 月 1 日支付。由于 2015 年 5 月 8 日已经完成了对归属于投资者的剩余资产的分配, 本基金的剩余资产产生的损益均归垫付资金的基金管理人所有, 其他应付款-管理人垫资款及基金剩余资产产生的损益已分别于 2015 年 11 月 17 日及 2015 年 12 月 21 日返还给长城基金管理有限公司, 共计人民币 1,050,342.38 元。

### 6.3.3 基金净资产分配情况

本基金最后运作日基金净资产已于 2015 年 5 月 8 日全部返还给投资人, 本基金归属于投资人的全部剩余财产已于该日全部分配完毕。

### 6.3.4 暂停运作期间损益情况

于 2015 年 5 月 7 日, 本基金全部基金份额已按当日的基金份额净值自动赎回。自 2015 年 5 月 8 日至本基金清算起始日前一日, 本基金剩余资产滋生的权益均归垫付资金的基金管理人所有。

## 6.4 清算情况

本基金已于第一个封闭期届满后完成对本基金资产的处置、负债的清偿及剩余资产的分配工作。截至本基金清算起始日前一日, 本基金资产负债余额均为 0, 不存在未变现的资产和未清偿的负债, 本基金基金份额为 0, 不存在清算期间收益, 清算费用由基金管理人代为支付。

### 6.5 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5月7日基金净资产	246,525,580.77
二、2015年5月8日基金份额返还给投资人	-246,525,580.77



加：暂停运作期间净收益	-
加：清算期间净收益	-
三、2016年9月14日基金净资产	-

## 7、备查文件目录

### 7.1 备查文件目录

7.1.1 长城淘金一年期理财债券型证券投资基金清算审计报告

7.1.2 通力律师事务所关于《长城淘金一年期理财债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

### 7.2 存放地点

深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40-41 层

### 7.3 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。

长城淘金一年期理财债券型证券投资基金基金财产清算小组

2016 年 11 月 11 日