

长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）清算报告

2018年2月9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：2018年3月28日

一、重要提示

长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“长盛同丰”或“本基金”）由长盛同丰分级债券型证券投资基金分级运作期届满转型而来。长盛同丰分级债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1543号文核准募集，于2012年12月27日成立并正式运作，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）和《长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，由基金管理人召集，本基金基金份额持有人大会于2018年1月15日以现场方式召开，审议通过了《关于终止长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。基金管理人于2018年1月16日在指定媒介和基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上发布了《长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）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2018年1月23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同日组成基金财产清算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：长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）（基金简称：长盛同丰债券（LOF），场内简称：长盛同丰，基金代码：160810）
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金合同生效日：2012年12月27日
- 4、2018年1月22日（基金最后运作日）基金份额总额：4,809,669.33份
- 5、投资目标：本基金投资于债券市场，基金管理人通过分析影响债券市场的各

类要素，进行积极主动的投资管理，追求基金资产的稳定增值，以最大程度上取得超越业绩比较基准的收益。

6、投资策略：本基金的债券投资理念是以利率风险管理为核心，以久期配置为关键技术，实现债券组合的保值增值，通过合理判断未来利率期限结构的变化，并充分考虑组合流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期和债券组合期限结构；结合不同类型债券流动性、税收和信用风险等因素综合确定债券组合的类属配置；利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资运作中，还将运用灵活多样的操作策略，如：换券利差交易策略、凸性套利交易策略以及骑乘收益率曲线策略等，以尽可能地控制风险、获取超额的投资收益。

7、业绩比较基准：中债综合指数（全价）

8、风险收益特征：本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种，其长期预期收益和平均风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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

长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）由长盛同丰分级债券型证券投资基金分级运作期届满转型而来。长盛同丰分级债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1543号文《关于核准长盛同丰分级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2012年12月3日至2012年12月25日向社会公开发行募集，基金合同于2012年12月27日正式生效，首次设立募集规模为1,997,372,126.07份基金份额。自2012年12月27日至2018年1月22日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金法》《运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，本基金基金份额持有人大会于2018年1月15日以现场方式召开，审议并通过了《关于终止长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。基金管理人于2018年1月16日在指定媒介和基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上发布了《长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）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2018年1月23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：长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018年1月22日

单位：人民币元

| 资 产 | 最后运作日 2018年1月22日 |
|---------|---------------------|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 5,782,898.55 |
| 结算备付金 | 152,193.29 |
| 存出保证金 | 1,648.36 |
| 债券投资 | 8,924.40 |
| 应收利息 | 1,562.62 |
| 资产总计 | 5,947,227.22 |
| 负 债： | |
| 应付管理人报酬 | 4,160.59 |
| 应付托管费 | 1,188.74 |
| 应付销售服务费 | 1,783.11 |
| 应付赎回款 | 20,512.73 |
| 应交税费 | 45,052.76 |
| 其他负债 | 146,300.00 |
| 负债合计 | 218,997.93 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 4,901,011.07 |
| 未分配利润 | 827,218.22 |

| | |
|------------|--------------|
| 所有者权益合计 | 5,728,229.29 |
| 负债和所有者权益总计 | 5,947,227.22 |

五、清算情况

自2018年1月23日至2018年2月9日止为本基金清算期间,基金财产清算组对本基金的资产、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

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的约定,清算费用由基金财产清算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)本基金最后运作日结算备付金为人民币152,193.29元,2018年2月2日中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户人民币124,465.19元,余额为27,728.10元。该款项将由基金管理人以自有资金垫付。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)本基金最后运作日存出保证金为人民币1,648.36元,该款项将由基金管理人以自有资金垫付。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。

(3)本基金最后运作日应收利息为人民币1,562.62元,其中应收活期存款利息、应收结算备付金利息、应收存出保证金利息将由基金管理人以自有资金垫付。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。应收债券利息参见“2、资产处置情况”第(4)项所述。

(4)本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币8,924.40元,全部为债券投资,应收债券利息为人民币5.86元,明细如下:

金额单位:人民币元

| 债券名称 | 债券代码 | 最后运作日估值单价 | 数量 | 最后运作日估值总额 | 最后运作日应收利息 |
|---------|---------|-----------|----|-----------|-----------|
| 12 晋煤销债 | 1280007 | 99.16 | 90 | 8,924.40 | 5.86 |

根据基金管理人于2017年12月15日发布的《关于以现场方式召开长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》中附件三《关于终止长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项议案的说明》的规定，基金进入清算程序后，如有持仓资产无法变现，为了最大化保护基金份额持有人利益，提高清算效率，基金管理人将以自有资金按照基金所持有资产的公允价值垫付基金未能变现的资产，具体清算规则按照相关规定办理。

12晋煤销债是本基金未能变现的债券资产，按照该债券持有至计息截止日（2022年1月17日）计算的本金及利息合计为人民币11,138.40元，将由基金管理人以自有资金垫付。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。

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20,512.73元，该款项已于2018年1月23日和1月24日支付。

(2)本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币4,160.59元，该款项已于2018年2月2日支付。

(3)本基金最后运作日应付托管费为人民币1,188.74元，该款项已于2018年2月2日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币1,783.11元，该款项已于2018年2月2日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币146,300.00元，其中信息披露费为人民币93,300.00元，已于2018年2月6日支付；其中2017年度审计费为人民币50,000.00元，已于2018年2月1日支付；其中账户维护费为人民币3,000.00元，待收到账户维护费收费账单后支付。

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币45,052.76元，其中应交增值税为人民币148.00元，已于2018年2月7日支付；其中应交附加税为人民币17.76元，已于2018年2月7日支付；其中应交债券利息所得税为人民币44,887.00元，将于税务机关指定时间支付。

4、清算日的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 自2018年1月23日至2018年2月9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) | 2,043.69 |
| 2、利息收入-债券利息收入(注2) | 2,132.54 |
| 3、投资收益(注3) | 75.60 |
| 清算收益小计 | 4,251.83 |
| 二、清算费用 | |
| 清算费用小计(注4) | |
| 三、清算净收益 | 4,251.83 |

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2018年1月23日至2018年2月9日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2：债券利息收入系计提自2018年1月23日至2022年1月17日（债券计息截止日）的债券利息。

注3：投资收益系未变现债券的兑付面额与最后运作日估值金额的差额。

注4：清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的约定，清算费用由基金财产清算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，经基金管理人确认，本基金的清算费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

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2018年1月22日基金净资产 | 5,728,229.29 |
| 加：清算期间净收益 | 4,251.83 |

| | |
|------------------------------|--------------|
| 减：2017年4季度账户维护费 | 4,500.00 |
| 减：基金赎回金额（于2018年1月23日确认的赎回申请） | 393,696.89 |
| 二、清算结束日2018年2月9日基金净资产 | 5,334,284.23 |

资产处置及负债清偿后，2018年2月9日本基金剩余财产为人民币5,334,284.23元，根据《基金合同》的约定，基金财产清算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（本基金的清算费用将由基金管理人承担，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。

清算起始日2018年1月23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。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时对本基金剩余财产进行分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）2018年1月22日资产负债表及审计报告

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）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。

长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金财产清算组

2018年2月9日