

长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金清算报告

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：2019 年 3 月 16 日

一、重要提示

长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】902 号文核准募集，于 2013 年 9 月 24 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。

依据《长盛双月红 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。”本次开放期为 2018 年 12 月 24 日（含该日）至 2019 年 1 月 22 日（含该日），基金登记机构于 2019 年 1 月 23 日完成了本基金在本次开放期最后一日（即 2019 年 1 月 22 日）申购、赎回业务申请的确认，本次开放期最后一日基金资产净值低于 5000 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 2019 年 1 月 24 日《中国证券报》和基金管理人网站上的《关于长盛双月红 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》。

本基金自 2019 年 1 月 24 日起进入清算期，由基金管理人长盛基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所于 2019 年 1 月 24 日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：长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金（基金简称：长盛双月红定期债券。长盛双月红定期债券 A，基金代码：000303；长盛双月红定期债券 C，基金代码：000304）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2013 年 9 月 24 日

4、最后运作日（2019 年 1 月 23 日）基金份额总额：22,273,608.14 份，其中 A 类份额 13,648,951.71 份，C 类份额 8,624,656.43 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：中国农业银行股份有限公司

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】902 号文《关于核准长盛双月红 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 8 月 22 日至 2013 年 9 月 18 日向社公开发发行募集，基金合同于 2013 年 9 月 24 日正式生效，首次设立募集规模为 348,134,882.30 份基金份额。自 2013 年 9 月 24 日至 2019 年 1 月 23 日期间，本基金根据《基金合同》正常运作。

根据《基金合同》的相关约定，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），如发生基金资产净值低于 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%的情形的，则无须召开持有人大会，基金合同终止并进行基金财产清算。

2017 年 12 月 23 日至 2018 年 12 月 23 日为本基金第五个封闭运作期，封闭运作期结束后，本基金于 2018 年 12 月 24 日（含该日）至 2019 年 1 月 22 日（含该日）开放申购、赎回及转换业务。基金登记机构于 2019 年 1 月 23 日完成了本基金在本次开放期最后一日（即 2019 年 1 月 22 日）申购、赎回业务申请的确认，本次开放期最后一日基金资产净值低于 5000 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》的约定，无须召开基金份额持有人大会，本基金将终止并进入基金财产清算程序，本基金自 2019 年 1 月 24 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：长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 1 月 23 日

单位：人民币元

资 产

最后运作日

2019 年 1 月 23 日

资 产：

银行存款 500,020.42

结算备付金 1,030,680.35

存出保证金 7,310.98

交易性金融资产 18,961,624.22

应收利息 329,667.62

应收证券清算款 2,727,952.58

资产总计 23,557,256.17

负 债：

应付证券清算款 1,505,236.35

应付管理人报酬 10,069.66

应付托管费 2,877.05

应付销售服务费 1,662.93

应付交易费用 2,189.58

其他负债 147,500.00

负债合计 1,669,535.57

所有者权益：

实收基金 22,273,608.14

未分配利润 -385,887.54

所有者权益合计 21,887,720.60

负债和所有者权益总计 23,557,256.17

五、清算情况

自 2019 年 1 月 24 日至 2019 年 2 月 15 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《长盛双月红 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) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 1,030,680.35 元，2019 年 2 月 11 日划回至托管账户人民币 657,262.97 元，截至清算期结束日余额人民币 373,417.38 元，由基金管理人长盛基金管理有限公司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。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 7,310.98 元，2019 年 2 月 11 日划回至托管账户人民币 1,318.39 元，截至清算期结束日余额人民币 5,992.59 元，由基金管理人长盛基金管理有限公司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利息为人民币 329,667.62 元，其中应收银行存款利息人民币 4,588.27 元、应收结算备付金和应收存出保证金利息人民币 1,849.79 元、应收债券利息人民币 323,229.56 元。清算期间银行存款产生应收利息人民币 19,549.40 元、结算备付金和存出保证金产生应收利息人民币 955.77 元、债券产生应收利息人民币 2,525.64 元，清算期间收到债券应收利息人民币 325,755.20 元。截至清算期结束日，应收利息余额人民币 26,943.23 元，该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司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。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 18,961,624.22 元，全部为债券投资，明细如下：

金额单位：人民币元

交易平台
债券名称
债券代码
最后运作日估值单价
数量 (张)
最后运作日成本总额
最后运作日估值总额
最后运作日

应收利息
 上交所
 21 国 债
 (7)
 010107 103.14 17,410 1,797,708.80 1,795,667.40 35,965.72
 上交所
 03 国 债
 (3)
 010303 101.19 74,200 7,474,963.84 7,508,298.00 68,426.63
 上交所
 16 国 债
 08
 019536 96.92 24,240 2,324,542.80 2,349,340.80 21,272.76
 上交所
 16 国 债
 19
 019547 92.23 12,250 1,121,830.01 1,129,817.50 17,010.72
 上交所
 国 开
 1701
 018005 100.30 10,580 1,057,532.30 1,061,174.00 32,103.49
 上交所
 国 开
 1702
 018006 102.34 25,430 2,577,037.83 2,602,506.20 79,817.45
 上交所
 国 开
 1802
 018008 102.33 5,000 511,650.00 511,650.00 9,330.41
 深交所
 国 开
 1704
 108602 101.16 19,802 1,997,608.24 2,003,170.32 59,302.38

以上债券于 2019 年 1 月 28 日前全部处置变现，处置收益人民币-43,643.68 元，交易费用人民币 58.12 元，清算期间应收债券利息人民币 2,525.64 元，变现产生的证券清算款为人民币 19,243,677.62 元，已于 2019 年 1 月 29 日前全部划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 2,727,952.58 元，该款项已于 2019 年 1 月 24 日划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币 1,505,236.35 元、应付管理人报酬为

人民币 10,069.66 元、应付托管费为人民币 2,877.05 元、应付销售服务费为人民币 1,662.93 元、应付交易费用为人民币 2,189.58 元，已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币 147,500.00 元，其中中债登账户维护费为人民币 6,000.00 元、上清所账户服务费为人民币 1,500.00 元，已于清算期间内支付；其中信息披露费为人民币 90,000.00 元，审计费为人民币 50,000.00 元，在清算期间未支付，挂账在基金账户中。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目
2019 年 1 月 24 日
至 2019 年 2 月 15 日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）
利息收入（注 1） 23,030.81
处置交易性金融资产产生的净收益（注 2） -43,643.68
清算期间收益小计 -20,612.87
二、清算期间费用
律师费 30,000.00
审计费 15,000.00
银行划款费 935.94
债券交易费用 58.12
其他 100.00
清算期间费用小计 46,094.06
三、清算期间净损益 -66,706.93

注 1：利息收入系计提的自 2019 年 1 月 24 日至 2019 年 2 月 15 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、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债券成交金额减去卖出债券最后运作日债券估值总额和截至变现日应收债券利息后的差额。

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
最后运作日 2019 年 1 月 23 日基金净资产	21,887,720.60
加：清算期间净损益	-66,706.93
2019 年 2 月 15 日基金净资产	21,821,013.67

截至本次清算期结束日 2019 年 2 月 15 日，本基金剩余财产为人民币 21,821,013.67 元。

自本次清算期结束日次日 2019 年 2 月 16 日至本次清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。以上利息均按实际适用的利率计算，由基金管理人以自有资金垫付并将于清算款划出前划入托管账户，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。

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) 长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金 2019 年 1 月 23 日资产负债表及审计报告

(2) 《长盛双月红 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。

长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2019 年 2 月 15 日