

兴银长禧半年定期开放债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：兴银基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年3月5日

清算报告公告日：2018年4月18日

一、重要提示

华福长禧半年定期开放债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会 2015 年 12 月 2 日《关于准予华福长禧半年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】2786 号）注册公开募集，自 2016 年 5 月 24 日起《华福长禧半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效，基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司，自 2017 年 4 月 5 日起“华福长禧半年定期开放债券型证券投资基金”更名为“兴银长禧半年定期开放债券型证券投资基金”（以下简称“本基金”）。

根据《兴银长禧半年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》”或“基金合同”）第五部分约定，“本基金自基金合同生效之日起，在任一开放期最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），如发生以下情形之一，则无须召开基金份额持有人大会，《基金合同》应当终止并根据《基金合同》第二十部分的约定进行财产清算：

- 1、基金份额持有人数量不满 200 人的；
- 2、基金资产净值低于 5000 万元的。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

截至 2018 年 1 月 29 日（最后一个开放日 2018 年 1 月 26 日的申购、赎回业务申请于 2018 年 1 月 29 日确认）日终，本基金基金资产净值低于 5000 万元，且基金份额持有人数量不满 200 人，触发基金合同终止情形，基金合同自动终止，基金管理人已就该事项于 2018 年 1 月 30 日刊登了《兴银长禧半年定期开放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》。

基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2018 年 1 月 30 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	兴银长禧半年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	兴银长禧定开债
基金主代码	002570
交易代码	002570
基金运作方式	契约型、定期开放式

基金合同生效日	2016年5月24日
最后运作日(2018-1-29)基金份额总额	12,750,205.11份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,自上而下决定资产配置及组合久期,并依据内部信用评级系统,深入挖掘价值被低估的标的券种,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券组合投资收益。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数
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,长期预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。
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经中国证监会2015年12月2日证监许可【2015】2786号文注册募集,由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2016年4月25日至2016年5月17日止期间向社会公开募集。本基金基金合同于2016年5月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总数为564,274,593.53份(含募集期间利息结转的份额)。自2016年5月24日至2018年1月29日期间,本基金按基金合同约定正常运作。

根据《基金合同》第五部分约定,“本基金自基金合同生效之日起,在任一开放期最后一日日终(登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后),如发生以下情形之一,则无须召开基金份额持有人大会,《基金合同》应当终止并根据《基金合同》第二十部分的约定进行财产清算:

- 1、基金份额持有人数量不满200人的;
- 2、基金资产净值低于5000万元的。

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。”

截至2018年1月29日(最后一个开放日2018年1月26日的申购、赎回业务申请于2018年1月29日确认)日终,本基金基金资产净值低于5000万元,且基金份额持有人数量不满200人,触发基金合同终止情形,基金合同自动终止,基金管理人已就该事项于2018

年 1 月 30 日刊登了《兴银长禧半年定期开放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》。

四、财务会计报告

1、清算期间

兴银长禧半年定期开放债券型证券投资基金的清算期间为 2018 年 1 月 30 日至 2018 年 3 月 2 日止。

2、清算财务报表的编制基础

本清算报表仅为供本基金基金管理人用以本基金清算相关监管报送或公告之目的而编制，本清算报表以非持续经营为基础编制。因此，本清算报表列示资产和负债时不再区分流动资产和非流动资产、流动负债和非流动负债，期末资产项目以预计可收回金额列报，负债项目按照需要偿付的金额列报。本清算报表仅列示了 2018 年 1 月 29 日(最后运作日)及 2018 年 3 月 2 日(清算结束日)的清算资产负债表和 2018 年 1 月 30 日(清算开始日)至 2018 年 3 月 2 日(清算结束日)止清算期间的清算损益表及重要报表项目说明，除上述内容外，本基金遵循《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《兴银长禧半年定期开放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》及基金合同的有关规定。

清算资产负债表（经审计）

单位：人民币元

项目	2018 年 1 月 29 日 (最后运作日)	2018 年 3 月 2 日 (清算结束日)
资 产：		
银行存款	17,843,745.62	12,871,962.36
存出保证金	6,122.49	3,495.27
应收利息	37,034.83	55,612.94
资产总计	17,886,902.94	12,931,070.57
负 债：		
应付赎回款	4,945,420.54	-
应付管理人报酬	16,885.76	-
应付托管费	2,814.28	-
应付交易费用	961.44	14.25
应付银行汇划费	220.00	30.00

预提费用	62,137.04	56,137.04
应交税费	2,102.58	-
负债合计	5,030,541.64	56,181.29
所有者权益：		
实收基金	12,750,205.11	12,750,205.11
未分配利润	106,156.19	124,684.17
所有者权益合计	12,856,361.30	12,874,889.28
负债和所有者权益总计	17,886,902.94	12,931,070.57

注：1、本基金最后运作日2018年1月29日，基金份额净值1.008元，基金总份额12,750,205.11份，基金资产净值12,856,361.30元。

清算损益表（经审计）

单位：人民币元

项目	2018年1月30日（清算开始日） 至 2018年3月2日（清算结束日）
一、收益	18,578.11
1、利息收入	18,578.11
2、差价收入	-
3、公允价值变动损益	-
4、其他收入	-
二、费用	50.13
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、交易费用	15.13
4、利息支出	-
5、税金及附加	-
5、其他费用	35.00
三、收益（损失）总额	18,527.98
减：所得税费用	-
四、净收益（损失）	18,527.98

五、清算情况

自2018年1月30日至2018年3月2日止为清算期间，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、根据《兴银长禧半年定期开放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 2018 年 1 月 30 日起(含 2018 年 1 月 30 日)，停止收取基金管理费、基金托管费。

2、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，经本基金管理人兴银基金管理有限责任公司确认，本次清算相关的费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

3、资产处置及负债清偿后，于 2018 年 3 月 2 日本基金剩余财产为人民币 12,874,889.28 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，清算起始日 2018 年 1 月 30 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，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。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付上交所最低结算备付金、存款利息（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人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。

4、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)《兴银长禧半年定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《关于<兴银长禧半年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免费查阅。

兴银长禧半年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组
2018 年 3 月 5 日