

长江财富-稳盈3号增强型债券专项资产管理计划

财产清算报告

长江财富-稳盈3号增强型债券专项资产管理计划（以下简称“本资产管理计划”）资产管理合同于2014年09月12日生效，存续期间为15个月，根据《长江财富-稳盈3号增强型债券专项资产管理计划合同》约定，本资产管理计划于2015年12月11日终止，本公司作为本资产管理计划的资产管理人，和中国工商银行股份有限公司上海市分行组成清算小组，对截至终止日的到期资产进行清算。

本资产管理计划清算情况如下：

一、截至2015年12月11日（合同终止日）的资产负债表

单位：人民币元

	合同终止日余额 (2015年12月11日)		合同终止日余额 (2015年12月11日)
资 产：		负 债：	
银行存款	455,546,926.21	短期借款	0.00
结算备付金	0.00	交易性金融负债	0.00
存出保证金	1.00	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	0.00	卖出回购金融资产 款	0.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	0.00	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	130,690.39
权证投资	0.00	应付业绩报酬	21,420,019.73
资产支持证券 投资	0.00	应付托管费	130,690.39
衍生金融工具	0.00	应付销售服务费	2,869,426.60
买入返售金融资产	0.00	应付交易费用	0.00
应收证券清算款	0.00	应交税费	0.00
应收利息	124,584.05	应付利息	0.00
应收股利	0.00	应付利润	0.00
应收申购款	0.00	应付投顾费	959,766.97
其他资产	0.00	负债合计	25,510,594.08
		所有者权益：	
		实收基金	331,100,000.00
		未分配利润	99,060,917.18
		所有者权益合计	430,160,917.18

资产合计	455,671,511.26	负债和所有者权益 总计	455,671,511.26
------	----------------	----------------	----------------

注：1、截至 2015 年 12 月 11 日（合同终止日），本资产管理计划资产净值为 430,160,917.18 元,单位份额净值为 1.299 元,其中优先级资产净值为 259,081,137.53 元,单位份额净值为 1.015 元,累计份额净值为 1.076 元；一般级资产净值为 171,079,779.65 元,单位份额净值为 2.254 元,累计份额净值为 2.254 元；

2、从成立日至 2015 年 12 月 11 日（合同终止日），本资产管理计划优先级累计分红 15,567,200.00 元，优先级每单位份额累计分红 0.0608 元。

3、根据《长江财富-稳盈 3 号增强型债券专项资产管理计划》，资产管理人管理费按前一日计划财产参考净值的 0.15%计提，截至合同终止日 2015 年 12 月 11 日，资产管理人管理费累计 744,847.22 元，计提业绩报酬 21,420,019.73 元，管理人报酬合计 22,164,866.95 元。

4、根据《长江财富-稳盈 3 号增强型债券专项资产管理计划》，托管费按前一日计划财产参考净值的 0.15%计提，截至合同终止日 2015 年 12 月 11 日，托管费累计 744,847.22 元。

5、根据《长江财富-稳盈 3 号增强型债券专项资产管理计划》，销售服务费按本资产管理计划生效日销售机构实际代销的全部优先受益份额净值 0.9%计提，截至合同终止日 2015 年 12 月 11 日，销售服务费累计 2,869,426.60 元。

6、根据《长江财富-稳盈 3 号增强型债券专项资产管理计划》，投资顾问费按前一日计划财产参考净值的 0.2 %年费率计提，截至合同终止日 2015 年 12 月 11 日，投资顾问费累计 992,469.60 元。

二、业绩报酬

根据《长江财富-稳盈 3 号增强型债券专项资产管理计划》。在资产管理合同终止财产清算完毕时，资产管理人按一般级份额委托人合同终止时所持有份额提取在该期间高于预先设定的业绩比较基准的投资增值部分的 20%收取业绩报酬。

业绩报酬以退出资产的投资增值部分（净值增长部分）高于预先设定的业绩比较基准的部分为基础进行计算，具体计算方法如下：

$$\text{业绩报酬} = S_i \times \text{NAV}_0 \times [(\text{NAV}_1 - \text{NAV}_0) / \text{NAV}_0 \times 100\% - B \times T / \text{当年天数}] \times 20\%$$

截至合同终止日，未扣除业绩报酬的一般级份额参考净值为 2.536 元，经计算，应

计提业绩报酬 21,420,019.73 元。

根据合同约定，对于业绩报酬的计算，托管人不承担复核义务。

三、本资产管理计划清算情况

1、根据本资产管理计划合同约定，本资产管理计划终止清算采取现金方式，在计划终止日前，资产管理人必须将投资组合内所有证券变现。截至合同终止日 2015 年 12 月 11 日，本资产管理计划持有所有证券均已变现。

2、应收利息

截至本资产管理计划终止日 2015 年 12 月 11 日，本资产管理计划应收活期银行存款利息为 65,622.92 元，应收券商保证金利息 58,961.13 元，共计 124,584.05 元。

因应收利息按季度于 2015 年 12 月 20 日（节假日顺延）结算入账，故本资产管理计划分两次清算，第一次清算优先级份额委托人清算金额全额支付，一般级份额委托人清算金额将扣除应收利息后支付；第二次清算待应收利息结算入账后，根据实际到账的应收利息金额全额分配给一般级份额委托人。

4、清算款划付

截至合同终止日 2015 年 12 月 11 日，在扣减管理费、业绩报酬、托管费、销售服务费、投资顾问费后，本资产管理计划资产净值为 430,160,917.18 元，再扣除应收利息后，本资产管理计划资产本次实际清算金额为 430,036,333.13 元，其中：其中优先级资产委托人清算金额按优先级资产净值全额支付，为 259,081,137.53 元，一般级资产委托人清算金额为一般级资产委托人净值扣除应收利息后的金额，为 170,955,195.60 元。

四、其他需要说明的事项

1、本资产管理计划全部清算完毕后，资产托管人协助管理人进行资金账户、证券账户的销户工作，销户过程中资产委托人应给予必要的配合。

2、本资产管理计划清算小组成员由资产管理人和资产托管人组成，本报告经资产托管人复核，并以合同约定的方式告知委托人。

3、本资产管理计划应收资金和应付资金全部结清、账户销户后，资产管理人、资产托管人职责终止。

特此报告。

2015年12月14日

资产托管人：

中国工商银行股份有限公司上海市分行

资产管理人：

上海长江财富资产管理有限公司