

长盛同裕纯债债券型证券投资基金
清算报告

2018年3月16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4月18日

一、重要提示

长盛同裕纯债债券型证券投资基金（以下简称“长盛同裕纯债”或“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【2015】2787号文核准注册，于2016年3月29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《长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）“第八部分 基金份额持有人大会”的相关规定，终止《基金合同》需召开基金份额持有人大会审议，并经基金份额持有人大会以特别决议的方式通过方为有效。本基金于2018年1月19日至2018年2月25日以通讯方式召开基金份额持有人大会审议终止《基金合同》事项，并于2018年2月26日表决通过了《关于终止长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人大会决议生效后，本基金于2018年2月27日成立基金财产清算小组，进入基金财产清算程序。基金登记机构于2018年2月27日完成了本基金最后运作日（即2018年2月26日）申购、赎回业务申请的确认。本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见2018年2月27日刊登在《中国证券报》和基金管理人网站上的《长盛同裕纯债债券型证券投资基金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2月27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2018年2月27日组成基金财产清算小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：长盛同裕纯债债券型证券投资基金（基金简称：长盛同裕纯债；A类基金份额，基金代码：002283；C类基金份额，基金代码：002284；E类基金份额，基金代码：002285）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2016年3月29日

4、2018年2月26日（基金最后运作日）基金份额总额：14,788,665.75份，其中A类基金份额10,903,955.09份，C类基金份额3,881,698.73份，E类基金份额3,011.93份。

5、投资目标：在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。

6、投资策略：本基金的投资策略包括大类资产配置策略和债券组合管理策略。

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，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，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：中国银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可【2015】2787号文《关于准予长盛同裕纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人长盛基金管理有限公司于2016年3月7日至2016年3月25日向社会公开发行募集，《基金合同》于2016年3月29日正式生效，首次设立募集规模为490,359,408.25份基金份额。自2016年3月29日至2018年2月26日期间，本基金按《基金合同》正常运作。

根据《基金合同》“第八部分 基金份额持有人大会”的相关规定，终止《基金合同》需召开基金份额持有人大会审议，并经基金份额持有人大会以特别决议的方式通过方为有效。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间为自2018年1月19日起，至2018年2月25日17:00止，会议审议了《关于终止长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并于2018年2月26日表决通过了《关于终止长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据《基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定及《基金合同》的约定，本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人

大会决议生效后，本基金于2018年2月27日成立基金财产清算小组，进入基金财产清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛同裕纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2018年2月26日

单位：人民币元

	最后运作日 2018年2月26日
资 产：	
银行存款	1, 579, 717. 40
结算备付金	106, 689. 00
存出保证金	873. 05
债券投资	13, 133, 874. 80
应收利息	312, 581. 56
资产总计	15, 133, 735. 81
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	36. 12
应付管理人报酬	4, 451. 08
应付托管费	2, 225. 55
应付销售服务费	1, 022. 92
应付交易费用	350. 00
其他负债	71, 862. 92
负债合计	79, 948. 59
所有者权益：	

实收基金	14,788,665.75
未分配利润	265,121.47
所有者权益合计	15,053,787.22
负债和所有者权益总计	15,133,735.81

五、清算情况

自2018年2月27日至2018年3月16日止为本基金的清算期间，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《长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的约定，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。

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106,689.00元，2018年3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106,689.00元，余额0元。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币873.05元，该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司以自有资金垫付。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312,581.56元，除应收债券利息外的应收活期存款利息、应收结算备付金利息、应收存出保证金利息，由基金管理人长盛基金管理有限公司以自有资金垫付。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13,133,874.80元，全

部为债券投资，应收债券利息为人民币308,515.00元，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	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	100.81	20,000	2,045,838.84	2,016,200.00	6,302.47
上交 所	03国债(3)	010303	96.73	2,760	271,466.10	266,974.80	3,419.38
深交 所	国开1703	108601	100.07	10,000	998,489.24	1,000,700.00	29,773.97
银行 间	16国开08	160208	98.50	100,000	9,972,391.19	9,850,000.00	269,019.18

以上全部交易性金融资产于2018年2月27日处置变现，变现产生的证券清算款为人民币13,443,903.11元，已于2018年2月28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赎回款为人民币36.12元，该款项已于2018年2月27日和2月28日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币4,451.08元，该款项已于2018年3月2日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币2,225.55元，该款项已于2018年3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1,022.92元，该款项已于2018年3月2日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币350.00元，其中应付中央国债登记结算有限责任公司结算服务费300.00元已于2018年3月12日支付，应付中国外汇交易中心交易手续费50.00元待收到缴费单后支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币71,862.92元，其中信息披露费为人

人民币12,000.00元,已于2018年3月12日支付,多计提的信息披露费493.26元已于2018年3月5日冲回;账户维护费为人民币9,000.00元,其中中央国债登记结算有限责任公司账户维护费4,500.00元已于2018年3月12日支付,银行间市场清算所账户维护费4,500.00元待收到缴费单后支付;审计费为人民币50,369.66元,包括2017年度审计费人民币50,000.00元,将于收到会计师事务所的缴费通知书后进行支付,2018年度计提的年度审计费为369.66元,已于2018年3月5日冲回。

4、清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	自2018年2月27日 至2018年3月16日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	4,917.54
2、处置交易性金融资产产生的收益(注2)	1,513.31
3、预提费用冲回(注3)	862.92
清算收入小计	7,293.77
二、清算费用	
清算费用小计(注4)	-
三、清算净收益	7,293.77

注1:利息收入系计提的自2018年2月27日至2018年3月16日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

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清算金额扣除卖出债券最后运作日估值总额和应收债券利息后的净额。

注3:预提费用冲回系冲回2018年度计提的年度审计费和多计提的信息披露费用。

注4: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。按照《基金合同》的约定,清算费用由基金财产清算小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2月26日基金净资产	15,053,787.22
加：清算期间净收益	7,293.77
二、2018年3月16日基金净资产	15,061,080.99

资产处置及负债清偿后，2018年3月16日本基金剩余财产为人民币15,061,080.99元，根据《基金合同》的约定，基金财产清算小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资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2月27日至清算款划出前一日的应收利息亦属份额持有人所有。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，基金财产清算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，报中国证监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) 《长盛同裕纯债债券型证券投资基金2018年1月1日至2018年2月26日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于〈长盛同裕纯债债券型证券投资基金清

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。

长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2018年3月16日