

长盛盛通纯债债券型证券投资基金  
清算报告

2018年5月18日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

公告日期：2018年6月20日

## 一、重要提示

长盛盛通纯债债券型证券投资基金（以下简称“长盛盛通纯债”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】2705号文核准注册，于2017年5月23日成立并正式运作，基金托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

根据《长盛盛通纯债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”中的约定，《基金合同》生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。截至2018年4月4日，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元，触发上述终止《基金合同》情形。为保护投资者利益，根据《基金合同》约定，基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”）与基金托管人平安银行协商一致，并向中国证券监督管理委员会备案，拟终止《基金合同》并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现终止事由后依法履行基金财产清算程序。本基金管理人与基金托管人协商一致确定2018年5月2日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2018年5月3日）起本基金进入基金财产清算程序。《基金合同》终止及基金财产清算安排详见2018年4月28日刊登在《中国证券报》和基金管理人网站上的《关于长盛盛通纯债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5月3日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人平安银行、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2018年5月3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：长盛盛通纯债债券型证券投资基金（基金简称：长盛盛通纯债。A类基金份额，基金代码：004528；C类基金份额，基金代码：004529）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2017年5月23日

4、2018年5月2日（基金最后运作日）基金份额总额：5,084,869.85份，其中A类基金份额4,878,836.46份，C类基金份额206,033.39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。围绕着这两个层次的投资策略，基金管理人还将充分运用市场上各种金融投资工具，结合投资策略的需要，通过合理有效的金融模型分析，积极发掘低风险投资机会和锁定套利收益。

7、业绩比较基准：中债综合指数（全价）收益率。

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：平安银行股份有限公司

### 三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】2705号文《关于准予长盛盛通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于2017年5月13日至2017年5月18日向社会公开发行募集，《基金合同》于2017年5月23日正式生效，首次设立募集规模为210,057,913.28份基金份额。自2017年5月23日至2018年5月2日期间，本基金按《基金合同》正常运作。

根据《基金合同》约定，本基金在《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。

截至2018年4月4日，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元

的情形，且本基金管理人已与基金托管人协商一致，并向中国证券监督管理委员会备案，决定终止本《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现终止事由后依法履行基金财产清算程序。本基金管理人与基金托管人协商一致确定2018年5月2日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2018年5月3日）起本基金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：长盛盛通纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2018年5月2日

单位：人民币元

	最后运作日 2018年5月2日
<b>资 产：</b>	
银行存款	671,609.27
结算备付金	26,277.70
存出保证金	373.63
交易性金融资产	5,728,427.10
应收利息	191,769.73
应收申购款	999.20
其他资产	9,300.00
资产总计	6,628,756.63
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负 债：</b>	
应付赎回款	83,679.77
应付管理人报酬	1,879.48

应付托管费	626.49
应付销售服务费	52.20
其他负债	1,049.01
负债合计	87,286.95
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	5,084,869.85
未分配利润	1,456,599.83
所有者权益合计	6,541,469.68
负债和所有者权益总计	6,628,756.63

## 五、清算情况

自2018年5月3日至2018年5月18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《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。但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代为支付。

### 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26,277.70元，2018年5月3日增加结算备付金人民币6,578.96元；该款项由基金管理人长盛基金在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户。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373.63元，2018年5月3日增加存出保证金人民币769.56元；该款项由基金管理人长盛基金在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户。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191,769.73元，除应收债券利息外的

应收银行存款利息、应收结算备付金利息、应收存出保证金利息，共计人民币2,088.03元，该款项由基金管理人长盛基金在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户。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。应收债券利息参见资产处置情况（4）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5,728,427.10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	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	17国债09	019563	99.99	57,290	5,731,291.50	5,728,427.10	189,681.70

以上债券于2018年5月4日到期兑付，债券兑付收到人民币5,919,202.80元，其中清算期债券利息收入为人民币521.10元，处置净收益为人民币572.90元，以上款项已于2018年5月4日划入托管账户。

（5）本基金最后运作日应收申购款为人民币999.20元，该款项已于2018年5月3日划入托管账户。

（6）本基金最后运作日其他资产为人民币9,300.00元，为应收基金管理人款项。依据本基金管理人于2018年1月9日发给基金托管人平安银行的《关于长盛盛通基金费用的说明函》，本基金因连续大额赎回引起2018年1月9日的基金资产净值低于人民币1,000万元，本基金自2018年1月10日起产生的审计费、信息披露费、账户维护费等费用均由本基金管理人承担。本基金支付了2018年1月10日起产生的账户维护费人民币9,000.00元和查询服务费人民币300.00元，该款项由本基金管理人承担，本基金管理人将在清算款划出前以自有资金支付至本基金托管账户。

### 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83,679.77元，该款项已于2018年5月3日和5月4日支付。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,879.48元，该款项已于2018

年5月3日和5月8日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币626.49元，该款项已于2018年5月3日和5月8日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币52.20元，该款项已于2018年5月3日和5月8日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币1,049.01元，其中人民币62.70元为应付赎回费，已于2018年5月3日和2018年5月4日支付；人民币986.31元为2018年1月1日至2018年1月9日的信息披露费，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	2018年5月3日 至2018年5月18日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
1、利息收入（注1）	2,266.63
2、处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	572.90
清算期间收益小计	2,839.53
二、清算期间费用	
清算期间费用小计（注3）	-
三、清算期间净收益	2,839.53

注1：利息收入系计提的自2018年5月3日至2018年5月18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债券的兑付面额与最后运作日债券估值金额的差额。

注3：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、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2018年5月2日基金净资产	6,541,469.68
加：清算期间净收益	2,839.53
减：基金净赎回金额(于2018年5月3日确认的投资者赎回申请)	560,935.78
二、2018年5月18日基金净资产	5,983,373.43

截至本次清算期结束日2018年5月18日，本基金剩余财产为人民币5,983,373.43元，根据本基金的《基金合同》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财产扣除基金财产清算费用（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）、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5月3日至清算款划出日前一日的应收利息亦属份额持有人所有。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。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

截至2018年5月18日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额人民币5,937,226.33元，结算备付金人民币32,856.66元，存出保证金人民币1,143.19元，应收利息人民币3,833.56元，其他资产人民币9,300.00元，其他负债人民币986.31元。

## 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)长盛盛通纯债债券型证券投资基金2018年5月2日资产负债表及清算审计报告



告

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛盛通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。

长盛盛通纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2018年5月18日