

长城久盈纯债债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

一、重要提示

长城久盈纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由长城久盈纯债分级债券型证券投资基金经中国证监会 2018 年 11 月 16 日证监许可[2018]1887 号文准予变更注册而来。

《长城久盈纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）于 2019 年 1 月 23 日生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，本基金进行基金财产清算并终止《基金合同》。本基金《基金合同》终止与基金财产清算的公告详见 2019 年 4 月 26 日刊登在《上海证券报》和基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）上的《关于长城久盈纯债债券型证券投资基金基金合同终止与基金财产清算的公告》。

本基金自 2019 年 4 月 26 日起进入清算程序，由本基金管理人长城基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市中伦律师事务所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，北京市中伦律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

基金名称 长城久盈纯债债券型证券投资基金

基金简称 长城久盈纯债

基金主代码 000768

交易代码 000768

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2019 年 1 月 23 日

最后运作日基金份额总额 6,640,345.26 份

投资目标 在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略 1、资产配置策略

本基金采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置，主要通过对宏观经济运行周期、财政政策、货币政策、利率走势、证券市场估值水平等可能影响资本市场的重要因素进行研究和预测，分析债券市场、债券品种、现金等大类资产的预期风险和收益，动态调整基金大类资产的投资比例，以控制系统性风险。本基金将择机利用债券回购交易放大组合债券资产杠杆，在严格控制信用风险、流动性风险的基础上增强基金整体收益。

2、债券投资策略

本基金通过综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整债券资产的平均久期及债券资产配置。本基金具体投资策略包括久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、债券回购杠杆策略等。

业绩比较基准 中国债券综合全价指数收益率

风险收益特征 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

基金管理人 长城基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金由长城久盈纯债分级债券型证券投资基金经中国证监会 2018 年 11 月 16 日证监许可[2018]1887 号文准予变更注册而来，《基金合同》于 2019 年 1 月 23 日生效。

自 2019 年 1 月 23 日至 2019 年 4 月 25 日期间，本基金按《基金合同》正常运作。截至 2019 年 4 月 25 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元的情形，触发《基金合同》中约定的基金终止条款，本基金根据《基金合同》的约定进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》和《关于长城久盈纯债债券型证券投资基金基金合同终止与基金财产清算的公告》的有关规定，本基金自 2019 年 4 月 26 日起进入清算程序。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：长城久盈纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 4 月 25 日

单位：人民币元

最后运作日：2019 年 4 月 25 日

资 产：

银行存款 3,919,326.99

结算备付金 251,578.64

存出保证金 14,745.65

应收证券清算款 2,500,199.86

应收利息 3,421.26

资产合计：6,689,272.40

负债：

应付赎回款 29,599.45

应付管理人报酬 1,941.85

应付托管费 728.20

其他负债 10,688.10

负债合计 42,957.60

所有者权益：

实收基金 5,590,100.48

未分配利润 1,056,214.32

所有者权益合计 6,646,314.80

负债与持有人权益总计： 6,689,272.40

注：于最后运作日 2019 年 4 月 25 日，基金份额净值为 1.0009 元，份额总额为 6,640,345.26 份，资产净值为 6,646,314.80 元。

五、清算情况

自 2019 年 4 月 26 日至 2019 年 5 月 17 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、清算费用

按照《长城久盈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) 本基金最后运作日银行存款 3,919,326.99 元，是储存于基金托管人建设银行的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日结算备付金 251,578.64 元和存出保证金 14,745.65 元，是由中国证券登记结算公司上海分公司和深圳分公司收取并保管的结算备付金和结算保证金，其中上海结算备付金 251,578.64 元，深圳结算备付金 0.00 元，上海存出保证金 11,974.33 元，深圳存出保证金 2,771.32 元。结算备付金和存出保证金每月调整一次，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该笔款项。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款 2,500,199.86 元，为上交所证券清算款，该款项已于 2019 年 4 月 26 日清算收回。

(4) 本基金最后运作日应收利息 3,421.26 元，包括活期银行存款应收利息 2,986.38 元、结算备付金应收利息 407.4 元和存出保证金应收利息 27.48 元。应收活期银行存款利息由托管银行于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月的 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清；结算备付金和存出保证金利息由中国证券登记结算有限责任公司于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月的 21 日（节假日顺延）结算入账。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该笔款项。

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 29,599.45 元，该款项已于 2019 年 4 月 26 日至 29 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,941.85 元，该款项已于 2019 年 5 月 8 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 728.2 元，该款项已于 2019 年 5 月 8 日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 10,688.10 元。其中，预提审计费 9,451.85 元，已于 2019 年 5 月 6 日支付；预提银行间账户维护费 1,236.25 元，将根据缴费通知单划付。

4、清算期间基金资产净值的变动情况

单位：人民币元

项目 金额

一、最后运作日（2019 年 4 月 25 日）基金资产净值 6,646,314.80

加：清算期间（2019年4月26日至2019年5月17日）收入 3,059.95

其中：利息收入-银行存款利息收入（注） 2,818.72

利息收入-结算备付金利息收入（注） 228.58

利息收入-存出保证金利息收入（注） 12.65

减：清算期间基金净赎回转出金额（2019年4月25日赎回并于2019年4月26日确认的申请）(减少用“-”表示) -1,163.96

二、清算期结束日（2019年5月17日）基金资产净值 6,648,210.79

注：利息收入系以当前适用的利率预估计提的2019年4月26日至2019年5月17日期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

5、其他说明事项

清算期结束日（2019年5月17日）本基金剩余财产（基金资产净值）为人民币6,648,210.79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。

清算期结束日次日（2019年5月18日）至清算款划出日前一日的银行存款等孳生的利息亦属份额持有人所有。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该笔款项（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。

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) 长城久盈纯债债券型证券投资基金清算审计报告

(2) 北京市中伦律师事务所关于《长城久盈纯债债券型证券投资基金清算报告》的法律意见书

2、存放地点

基金管理人的办公场所：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心40-41层

存放网址：www.ccfund.com.cn

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。

长城久盈纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2019年6月25日