

长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金 清算报告

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

清算报告出具日期：2021年3月19日

清算报告公告日期：2021年3月23日

一、重要提示

长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】607号文批准募集，于2013年8月9日成立并正式运作，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《长盛年年收益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》”）“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”项下的约定，“基金合同生效后，在每个开放期的最后一日日终（基金登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认后），如发生以下情形之一的，则无须召开持有人大会，基金合同将于该日次日终止并根据本基金合同第二十部分的约定进行基金财产清算：（1）基金资产净值低于5000万元；（2）基金份额持有人人数少于200人；（3）本基金前十名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的90%。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

本基金本年度自2021年1月11日起（含该日）进入开放期，至2021年2月5日（含该日）结束。截至本次开放期最后一日（即2021年2月5日）日终，本基金出现基金资产净值低于5000万元的情形，触发《基金合同》终止条款。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”），决定终止《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。本基金管理人确定2021年2月5日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2021年2月6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2021年2月6日刊登在《证券时报》和本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《关于长盛年年收益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2021年2月6日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国银行、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2021年2月6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

| | |
|--------------------------|--|
| 基金名称 | 长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 长盛年年收益定期债券 |
| 基金代码 | A类：000225 C类：000226 |
| 基金运作方式 | <p>契约型开放式，本基金自基金合同生效日起每封闭一年集中开放申购与赎回一次，开放期为5至20个工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。</p> <p>本基金以定期开放方式运作，其封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。首个封闭期结束之后第一个工作日起进入5至20个工作日的首个开放期，如封闭期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，自不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的一年，以此类推。</p> |
| 基金合同生效日 | 2013年8月9日 |
| 基金最后运作日（2021年2月5日）基金份额总额 | 6,998,521.59份 |
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的基础上，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于固定收益类金融工具，不直接买入股 |

| | |
|--------|--|
| | <p>票、权证等权益类金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的投资策略包括大类资产配置策略、债券组合管理策略和期限管理策略。</p> <p>本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。</p> <p>由于本基金封闭期为一年，基金规模相对稳定，但在开放期内本基金规模的不确定性增强。本基金将采用期限管理策略，分散化投资于不同剩余期限标的，临近开放期时，在最大限度保证收益的同时将组合剩余期限降低，保证开放期内具备足够流动性应对可能发生的组合规模变化。</p> |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款税后收益率 |
| 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。 |
| 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 |

三、基金运作情况概述

长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】607号文批准募集，于2013年8月9日成立并正式运作，首次设立募集规模为592,654,154.16份基金份额（含利息结转份额）。

根据《基金合同》第五部分“基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”项下的约定：“基金合同生效后，在每个开放期的最后一日

日终（基金登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认后），如发生以下情形之一的，则无须召开持有人大会，基金合同将于该日次日终止并根据本基金合同第二十部分的约定进行基金财产清算：（1）基金资产净值低于5000万元；（2）基金份额持有人人数少于200人；（3）本基金前十名基金份额持有人持有的基金份额超过基金总份额的90%。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

本基金本年度自2021年1月11日起（含该日）进入开放期，至2021年2月5日（含该日）结束。截至本次开放期最后一日（即2021年2月5日）日终，本基金出现基金资产净值低于5000万元的情形，触发《基金合同》终止条款。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决定终止《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。

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。本基金管理人确定2021年2月5日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2021年2月6日）起本基金进入基金财产清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日（2021年2月5日）期间，本基金正常工作。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021年2月5日

单位：人民币元

| | 最后运作日 2021年2月5日 |
|------------|--------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 7,315,132.52 |
| 结算备付金 | 190,004.11 |
| 存出保证金 | 1,225.79 |
| 应收利息 | 5,127.57 |

| | |
|-----------------|-----------------|
| 资产总计 | 7, 511, 489. 99 |
| 负债和所有者权益 | |
| 负 债: | |
| 应付赎回款 | 125, 842. 69 |
| 应付管理人报酬 | 504. 75 |
| 应付托管费 | 151. 43 |
| 应付销售服务费 | 75. 29 |
| 应付交易费用 | 1, 924. 25 |
| 应交税费 | 4, 515. 20 |
| 其他负债 | 14, 090. 48 |
| 负债合计 | 147, 104. 09 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 6, 998, 521. 59 |
| 未分配利润 | 365, 864. 31 |
| 所有者权益合计 | 7, 364, 385. 90 |
| 负债和所有者权益总计 | 7, 511, 489. 99 |

注：报告截止日2021年2月5日(基金最后运作日)，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金份额总额为6,998,521.59份，其中长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金A类基金份额净值1.053元，基金份额3,212,291.41份；长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金C类基金份额净值1.052元，基金份额3,786,230.18份。

五、清算情况

自2021年2月6日至2021年3月19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》第二十部分“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) 本基金最后运作日应收利息人民币5,127.57元，其中应收银行存款利息为人民币4,808.45元，应收结算备付金利息为人民币318.94元，应收存出保证金利息为人民币0.18元，该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人将于本基金剩余财产分配结束后自他方收回。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) 本基金最后运作日结算备付金人民币190,004.11元，该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人将于本基金剩余财产分配结束后自他方收回。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) 本基金最后运作日存出保证金人民币1,225.79元，该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人将于本基金剩余财产分配结束后自他方收回。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、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币125,842.69元，该款项已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币504.75元，该款项已于清算期间内支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币151.43元，该款项已于清算期间内支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币75.29元，该款项已于清算期间内支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币1,924.25元，该款项已于清算期间内支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币14,090.48元，其中，信息披露费为人

人民币7,890.48元，该款项已于清算期间内冲回至基金剩余资产；账户维护费为人民币6,200.00元，该款项已于清算期间内支付。

(7) 本基金最后运作日应交税费为人民币4,515.20元，该款项将于税务局指定时间支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 自2021年2月6日 至2021年3月19日止清算期间 |
|--------------------|--------------------------------|
| 一、清算期间收益（损失以“-”填列） | |
| 利息收入（注1） | 3,152.56 |
| 信息披露费冲回 | 7,890.48 |
| 清算期间收益小计 | 11,043.04 |
| 二、清算期间支出 | |
| 银行划款费 | -60.00 |
| 清算费用（注2） | - |
| 清算期间支出小计 | -60.00 |
| 三、清算期间净损益 | 10,983.04 |

注1：利息收入系计提的2021年2月6日至2021年3月19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：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。

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2021年2月5日基金净资产 | 7,364,385.90 |
| 加：清算期间净收益 | 10,983.04 |
| 减：基金净赎回金额（于2021年2月8日确认的投资者申购、赎回申请） | 104,571.91 |
| 二、2021年3月19日基金净资产 | 7,270,797.03 |

资产处置及负债清偿后，于2021年3月19日本基金剩余财产为人民币

7,270,797.03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扣除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。

自清算起始日（2021年2月6日）至清算结束日（2021年3月19日）的银行存款等产生的利息已计入清算期间净损益，自清算期结束日次日（2021年3月20日）至清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。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）《长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金2021年1月1日至2021年2月5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年年收益定期开放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。

长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2021年3月19日