

长盛盛景纯债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：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日期：2021年5月19日

清算报告公告日期：2021年5月25日

一、重要提示

长盛盛景纯债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〔2016〕1488号文注册募集，于2016年8月4日成立并正式运作，基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

根据《长盛盛景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“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定，“《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，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2021年4月22日日终，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《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《基金合同》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4月22日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2021年4月23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4月23日刊登在《证券时报》和本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《长盛基金管理有限公司关于长盛盛景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2021年4月23日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人兴业银行、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2021年4月23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

基金名称	长盛盛景纯债债券型证券投资基金
基金简称	长盛盛景纯债
基金代码	A类：003099 C类：003100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月4日
基金最后运作日（2021年4月22日）基金份额总额	747,694.95份
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。
投资策略	（一）大类资产配置策略 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。 （二）债券组合管理策略 本基金的债券组合管理策略包含：利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券等品种投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合指数（全价）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	兴业银行股份有限公司
基金合同存续期	不定期

三、基金运作情况概述

长盛盛景纯债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〔2016〕1488号文注册募集，于2016年8月4日成立并正式运作，首次设立募集规模为1,000,063,448.57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”的约定，“《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，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2021年4月22日日终，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《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。

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《基金合同》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4月22日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2021年4月23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（2016年8月4日）至最后运作日（2021年4月22日）期间，本基金正常运作。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛盛景纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021年4月22日

单位：人民币元

	最后运作日 2021年4月22日
资产：	
银行存款	58,245.84
结算备付金	5,086.77
存出保证金	45,705.57
交易性金融资产	768,116.00
其中：	
债券投资	768,116.00
应收利息	7,013.17
资产总计	884,167.35
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	925.68
应付管理人报酬	182.04
应付托管费	91.04

应付销售服务费	48.30
其他负债	111,162.24
负债合计	112,409.30
所有者权益：	
实收基金	747,694.95
未分配利润	24,063.10
所有者权益合计	771,758.05
负债和所有者权益总计	884,167.35

注：报告截止日2021年4月22日(基金最后运作日)，基金份额总额747,694.95份，其中长盛盛景纯债A基金份额净值1.0385元，份额总额409,797.49份；长盛盛景纯债C基金份额净值1.0245元，份额总额337,897.46份。

五、清算情况

自2021年4月23日至2021年5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5,086.77元，全部为上海结算备付金，已于2021年5月7日划至托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币45,705.57元，2021年5月7日划回至托管账户人民币2,146.49元。截至清算期结束日存出保证金余额为人民币43,559.08元，该款项将于清算期结束后由基金管理人以自有资金先行垫付；基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(3) 本基金最后运作日应收利息为人民币7,013.17元，其中应收银行存款利息人民币44.14元，应收结算备付金利息人民币17.44元，应收存出保证金利息人民币

65.92元，应收债券利息人民币6,885.67元。清算期间银行存款产生应收利息人民币73.58元，结算备付金产生应收利息人民币3.45元，存出保证金产生应收利息人民币54.42元。上述应收利息合计为人民币7,144.62元，其中应收债券利息人民币6,885.67元已于清算期间划入托管账户。截至清算期结束日，应收利息余额为人民币258.95元。该款项将于清算期结束后由基金管理人以自有资金先行垫付；基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币768,116.00元，全部为上交所国债，应收债券利息为人民币6,885.67元，明细如下：

金额单位：人民币元

交易平台	债券代码	债券名称	最后运作日 估值单价	数量(张)	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	019640	20国债10	100.02	3,500.00	349,865.00	350,070.00	5,793.22
上交所	020406	21贴债09	99.54	2,000.00	199,052.00	199,080.00	548.64
上交所	020408	21贴债11	99.53	2,200.00	218,944.00	218,966.00	543.81
合计					767,861.00	768,116.00	6,885.67

上述债券均已于2021年5月14日前处置变现，处置损失为人民币50.50元。清算期间交易性金融资产产生债券利息收入为人民币642.01元，交易费用为人民币0.77元，处置产生的证券清算款为人民币775,592.41元，已于清算期间划入托管账户。

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925.68元，已于清算期间支付；

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币182.04元，应付托管费人民币91.04元，应付销售服务费人民币48.30元，已于清算期间支付；

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币111,162.24元，其中应付赎回费为人民币0.22元，预提审计费人民币108,986.22元，预提中债登账户维护费人民币1,087.90元，预提上清所账户维护费人民币1,087.90元。清算期间产生上清所账户维护费人民币100.00元，预提中债登账户维护费人民币412.10元，上清所账户维护费人民币412.10元，银行划款费人民币170.00元。上述应付赎回费、账户维护费、银行划汇费已于清算期间支付。预提审计费中人民币90,000.00元为2020年度审计费用，已于2021年4月27日支付；剩余人民币18,986.22元为预提2021年度审计费用，已于清算期内转入其他收入。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年4月23日 至2021年5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）	773.46
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	-50.50
其他收入（注3）	18,986.22
清算期间收益小计	19,709.18
二、清算期间支出	
银行划款费	-170.00
债券交易费用	-0.77
银行间账户费用	-924.20
清算费用（注4）	0.00
清算期间支出小计	-1,094.97
三、清算期间净损益	18,614.21

注1：利息收入系计提的2021年4月23日至2021年5月19日止清算期间的银行存款、结算备付金、存出保证金利息及债券利息。

注2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出债券成交金额减去卖出债券最后运作日估值总额和截至变现日应收债券利息后的差额。

注3：其他收入系此前基金预提审计费，基金清算期间转入其他收入。

注4：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4月22日基金净资产	771,758.05
加：清算期间净收益	18,614.21
减：基金净赎回金额（于2021年4月23日确认的投资者申购、赎回申请）	1,612.36
二、2021年5月19日基金净资产	788,759.90

资产处置及负债清偿后，于2021年5月19日本基金剩余财产为人民币788,759.90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4月23日）至清算结束日（2021年5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5月20日）至清

算款划出日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存出保证金等。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) 《长盛盛景纯债债券型证券投资基金清算审计报告》

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于长盛盛景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。

长盛盛景纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2021年5月25日