

# 长城久信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：交通银行股份有限公司

## 一、重要提示

长城久信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（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]2239号文准予注册，于2016年11月30日成立并正式运作。

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《长城久信债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，并经2020年6月15日本基金基金份额持有人大会表决通过，本基金进行基金财产清算并终止《基金合同》。本基金进入清算期的公告详见2020年6月16日刊登在《证券日报》和基金管理人网站（[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)）上的《长城久信债券型证券投资基金进入清算期及终止办理申购、赎回、转换及定投等业务的公告》。

本基金自2020年6月16日起进入财产清算期，由本基金基金管理人长城基金管理有限公司、本基金基金托管人交通银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力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，上海市通力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 长城久信债券型证券投资基金

基金简称 长城久信债券

基金主代码 003546

交易代码 003546

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年11月30日

基金最后运作日 2020年6月15日

基金最后运作日基金份额总额 44,784.15份

投资目标 本基金主要投资于债券资产，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略 1、大类资产配置策略 本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较债券市场、债券品种、股票市场、及现金类资产的收益风险特征，在基准配置比例的基础上，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。 2、固定收益资产投资策略 本基金投资组合在进行固定收益类资产的投资时，主要通过分析宏观经济形势、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，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。本基金将在科学的大类资产配置及券种配置、完整的信用评价系统和严格的投资风险管理基础上获取基准收益，同时争取获得超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。 3、权益资产投资策略 本基金将重点投资于具备内生性增长基础或具备外延式扩张能力的价值创造型企业，并重点关注相关个股的安全边际及绝对收益机会。在股票选择方面，充分发挥“自下而上”的主动选股能力，结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司内生性增长动力的判断，选择具备外延式扩张能力的优势上市公司，结合财务与估值分析，深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司，构建股票投资组合，同时将根据行业、公司状况的变化，基于估值水平的波动，动态优化股票投资组合。在安全边际方面，将加强个股下行风险的策略判断，并对于因市场阶段性有效性降低时出现的套利机会保持敏感性。

业绩比较基准 沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

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股票型基金、混合型基金，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 交通银行股份有限公司

### 三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2016]2239号文准予注册，由基金管理人长城基金管理有限公司于2016年11月24日至2016年11月25日向社会公开募集，《基金合同》于2016年11月30日正式生效，募集规模为200,342,081.11份基金份额。

自2016年11月30日至2020年6月15日期间，本基金按《基金合同》正常运作。本基金基金管理人于2020年5月15日至2020年6月14日以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，并于2020年6月15日表决通过了《关于终止长城久信债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“《议案》”）。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》以及上述经基金份额持有人大会表决通过的《议案》的有关规定，本基金自2020年6月16日起进入财产清算期。

### 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：长城久信债券型证券投资基金

报告截止日：2020年6月15日

单位：人民币元

最后运作日：2020年6月15日

资产：

银行存款 55,850.29

结算备付金 1,238.00

存出保证金 1,440.78

应收利息 1,686.82

资产合计：60,215.89

负债：

应付管理人报酬 17.12

应付托管费 4.29

其他负债 10,000.00

负债合计 10,021.41

所有者权益：

实收基金 44,784.15

未分配利润 5,410.33

所有者权益合计 50,194.48

负债与持有人权益总计：60,215.89

注：于最后运作日2020年6月15日，基金份额净值为1.1208元，份额总额为44,784.15份，资产净值为50,194.48元。

### 五、清算情况

自2020年6月16日至2020年6月29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《长城久信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 55,850.29 元，是储存于基金托管人交通银行的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日结算备付金 1,238.00 元和存出保证金 1,440.78 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存出保证金，其中上海结算备付金 1,238.00 元，深圳结算备付金 0.00 元，上海存出保证金 1,439.16 元，深圳存出保证金 1.62 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利息 1,686.82 元，包括活期银行存款应收利息 1,675.15 元、结算备付金应收利息 4.77 元和存出保证金应收利息 6.90 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。该款项已于 2020 年 6 月 22 日结息收回。

## 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 17.12 元，该款项已于 2020 年 6 月 18 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4.29 元，该款项已于 2020 年 6 月 18 日支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币 10,000.00 元，为预提审计费，已于 2020 年 6 月 18 日支付。

## 4、清算期间基金资产净值的变动情况

单位：人民币元

减少用“-”表示

项目 金额

一、最后运作日（2020 年 6 月 15 日）基金资产净值 50,194.48

加：清算期间（2020 年 6 月 16 日至 2020 年 6 月 29 日）收入 15.00

其中：利息收入-银行存款利息收入（注 1） 13.46

利息收入-结算备付金利息收入（注 1） 0.71

利息收入-存出保证金利息收入（注 1） 0.83

减：清算期间（2020 年 6 月 16 日至 2020 年 6 月 29 日）费用 -10.00

其中：账户费用（注 2） -10.00

二、清算期结束日（2020 年 6 月 29 日）基金资产净值 50,199.48

注 1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的 2020 年 6 月 16 日至 2020 年 6 月 29 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。

注 2、账户费用系清算期间本基金托管账户的银行汇划费。

## 5、其他说明事项

清算期结束日（2020 年 6 月 29 日）本基金剩余财产（基金资产净值）为人民币 50,199.48 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（2020 年 6 月 30 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) 长城久信债券型证券投资基金清算审计报告

(2) 上海市通力律师事务所关于《长城久信债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

##### 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](http://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。

长城久信债券型证券投资基金基金财产清算小组

2020 年 7 月 15 日