

长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资 基金清算报告

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：渤海银行股份有限公司

清算报告出具日：2025 年 3 月 13 日

清算报告公告日：2025 年 3 月 19 日

§ 1 重要提示

长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信富海纯债一年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”或“《基金合同》”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]1395号文批准公开募集。本基金为契约型基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为1,182,700,474.41份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资,并出具了编号为毕马威华振验字第1500949号验资报告。基金合同于2015年9月30日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据2017年8月14日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金增设A类基金份额相关事项的公告》,从2017年8月16日起,本基金增设A类份额(以下简称“长信富海纯债一年定开债券A”),长信富海纯债一年定开债券A不收取销售服务费。本基金分类后,原有基金份额将自动划归为本基金C类基金份额(以下简称“长信富海纯债一年定开债券C”),长信富海纯债一年定开债券C的年销售服务费率为0.40%。

根据基金合同“第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定:“有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的;”

根据基金管理人于2025年2月19日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》(以下简称“《决议生效公告》”),基金份额持有人大会于2025年2月17日表决通过了《关于终止长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。本基金最后运作日为2025年2月19日,自2025年2月20日起进入清算期。

由基金管理人长信基金管理有限责任公司、基金托管人渤海银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2025年2月20日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长信富海纯债一年定开债券	
基金主代码	519953	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 9 月 30 日	
报告期末（2025 年 2 月 19 日）基金份额总额	8,836,510.85 份	
投资目标	本基金为纯债基金，以获取高于业绩比较基准的回报为目标，追求每年较高的绝对回报。	
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 1、封闭期投资策略 （1）资产配置策略 （2）类属配置策略 （3）个券选择策略 （4）骑乘策略 （5）息差策略 （6）利差策略 （7）资产支持证券的投资策略 2、开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信富海纯债一年定开债券 A	长信富海纯债一年定开债券 C
下属分级基金的交易代码	005068	519953
报告期末下属分级基金的份额总额	960,336.89 份	7,876,173.96 份

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会以证监许可[2015]1395 号文批准公开募集，基金合同于 2015 年 9 月 30 日生效，首次设立募集基金份额为 1,182,700,474.41 份。

因市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，本基金管理人根据《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》等有关规定，经与基金托管人渤海银行股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。基金管理人于 2025 年 1 月 18 日 0:00

起至 2025 年 2 月 16 日 17:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议了《关于终止长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

本次基金份额持有人大会于 2025 年 2 月 17 日表决通过了《关于终止长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。根据基金管理人于 2025 年 2 月 19 日发布的《决议生效公告》，自 2025 年 2 月 20 日起进入清算期。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同的约定正常运作。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表（经审计）

会计主体：长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金

单位：人民币元

资 产	清算结束日 2025 年 2 月 24 日	最后运作日 2025 年 2 月 19 日
资 产：		
银行存款	8,476,398.73	8,518,967.84
结算备付金	863,903.68	863,861.73
存出保证金	6,313.16	6,312.86
应收申购款	-	-
资产总计	9,346,615.57	9,389,142.43
负债和净资产	清算结束日 2025 年 2 月 24 日	最后运作日 2025 年 2 月 19 日
负 债：		
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	-	6,953.54
应付托管费	-	571.35
应付销售服务费	-	5,958.65
应付交易佣金	-	-
其他负债	10,155.00	10,155.00
负债合计	10,155.00	23,638.54
净资产：		
实收基金	8,836,510.85	8,836,510.85
未分配利润	499,949.72	528,993.04
净资产合计	9,336,460.57	9,365,503.89
负债和净资产总计	9,346,615.57	9,389,142.43

注：本基金最后运作日 2025 年 2 月 19 日，长信富海纯债一年定开债券 A 份额净值人民币 1.0599 元，长信富海纯债一年定开债券 C 份额净值人民币 1.0599 元；基金份额总额为 8,836,510.85 份，

其中长信富海纯债一年定开债券 A 份额 960,336.89 份，长信富海纯债一年定开债券 C 份额 7,876,173.96 份。

4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金

单位：人民币元

项目	2025 年 2 月 20 日(清算开始日)至 2025 年 2 月 24 日(清算结束日)止期间
一、 收入	986.68
1、利息收入（注 1）	986.68
其中：存款利息收入	986.68
2、投资收益(损失以“-”填列)	-
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-
4、其他业务收入(损失以“-”填列)	-
二、 费用	30,030.00
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、销售服务费	-
4、税金及附加	-
5、其他费用（注 2）	30,030.00
三、 利润总额	-29,043.32
减：所得税费用	-
四、 净收益	-29,043.32

注：1、利息收入系以适用利率预估计提的自 2025 年 2 月 20 日(清算开始日)至 2025 年 2 月 24 日(清算结束日)止期间的银行存款利息收入、结算备付金及保证金利息收入。2025 年 2 月 24 日后至清算款划出日前的银行存款应计利息、存出保证金利息和结算备付金应计利息归基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，上述所有利息于剩余资产分配日之前未划入托管账户的，将由基金管理人在剩余资产分配日以自有资金垫付，待实际资金到账后再返还基金管理人，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

2、其他费用系自 2025 年 2 月 20 日(清算开始日)至 2025 年 2 月 24 日(清算结束日)止期间支付费用产生的汇划费，共计人民币 30 元；基金份额持有人大会费用共计 30,000 元，其中律师费 20,000 元，公证费 10,000 元。

3、本次清算期间产生的其他清算费用由本基金基金管理人承担。

§ 5 基金财产分配

自2025年2月20日至2025年2月24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：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日银行存款为人民币8,518,967.84元，其中活期存款人民币8,508,460.61元，应计活期存款利息人民币10,507.23元；于清算结束日（2025年2月24日）银行存款为人民币8,476,398.73元，其中活期存款人民币8,464,947.07元，应计活期存款利息人民币11,451.66元。

5.1.2 本基金最后运作日，结算备付金为人民币863,861.73元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币863,333.33元，应计结算备付金利息为人民币528.40元。存出保证金为人民币6,312.86元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币6,295.40元，应计存出保证金利息为人民币5.51元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币11.95元。清算结束日（2025年2月24日），结算备付金为人民币863,903.68元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币863,333.33元，应计结算备付金利息为人民币570.35元。存出保证金为人民币6,313.16元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金为人民币6,295.40元，应计存出保证金利息为人民币5.81元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金为人民币11.95元。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币6,953.54元，该款项已于2025年2月24日前支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币571.35元，该款项已于2025年2月24日前支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币5,958.65元，该款项已于2025年2月24日前支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债为人民币10,155.00元，其中银行间交易费用人民币155.00元；预提审计费用人民币10,000.00元。以上款项将于2025年2月24日之后支付。

5.3 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（2025年2月19日）基金净资产	9,365,503.89
加：清算期间净收益	-29,043.32
基金净申购转入金额	-
减：基金净赎回转出金额	-
二、2025年2月24日基金净资产	9,336,460.57

根据基金合同的约定，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、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。清算结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款、存出保证金和结算备付金孳生的利息归基金份额持有人所有。资产处置及部分负债清偿后，本基金截至 2025 年 2 月 24 日止的净资产为人民币 9,336,460.57 元，其中长信富海纯债一年定开债券 A 资产净值为人民币 1,014,659.44 元，长信富海纯债一年定开债券 C 资产净值为人民币 8,321,801.13 元。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付上述未结息金额及存出保证金，供清盘分配使用，待实际资金到账后再返还基金管理人，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

5.4 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，报监管备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、《长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金清算财务报表及审计报告》；
- 2、《上海源泰律师事务所关于长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金清算事宜之法律意见》。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

长信基金管理有限公司网站：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金财产清算小组

2025 年 3 月 19 日