

长盛纯债债券型证券投资基金
清算报告

2018年6月8日

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

公告日期：2018年7月6日

一、重要提示

长盛纯债债券型证券投资基金（以下简称“长盛纯债”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】145号文核准注册，于2013年3月13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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）和《长盛纯债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，长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，由基金管理人召集，本基金基金份额持有人大会于2018年5月14日以现场方式召开，会议审议并通过了《关于终止长盛纯债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。基金管理人于2018年5月15日在指定媒介和基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上发布了《长盛纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金自2018年5月18日起进入清算期，由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、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同日组成基金财产清算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

1、基金名称：长盛纯债债券型证券投资基金（基金简称：长盛纯债债券。A类基金份额，基金代码：000050；C类基金份额，基金代码：000052）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2013年3月13日

4、2018年5月17日（基金最后运作日）基金份额总额：12,925,419.52份，其中A类基金份额10,371,704.34份，C类基金份额2,553,715.18份。

5、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。

6、投资策略：本基金的投资策略包括大类资产配置策略和债券组合管理策略。围绕着这两个层次的投资策略，基金管理人还将充分运用市场上各种金融投资工具，结合投资策略的需要，通过合理有效的金融模型分析，积极发掘低风险投资机会和锁定套利收益。

7、业绩比较基准：中债综合指数（全价）收益率。

8、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。

9、基金管理人：长盛基金管理有限公司

10、基金托管人：中国银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可【2013】145号文核准注册，由基金管理人于2013年2月25日至2013年3月8日向社会公开发行人募集，《基金合同》于2013年3月13日正式生效，首次设立募集规模为3,335,066,436.23份基金份额。自2013年3月13日至2018年5月17日期间，本基金按《基金合同》正常运作。

根据《基金法》《运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，本基金基金份额持有人大会于2018年5月14日以现场方式召开，会议审议并通过了《关于终止长盛纯债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。基金管理人于2018年5月15日在指定媒介和基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上发布了《长盛纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金自2018年5月18日起进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2018年5月17日

单位：人民币元

	最后运作日 2018年5月17日
资产：	
银行存款	1,755,932.78
结算备付金	345,010.51
存出保证金	2,128.49
买入返售金融资产	12,000,000.00
应收证券清算款	981.36
应收利息	5,215.97
应收申购款	1,449.96
资产总计	14,110,719.07
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	55,326.40
应付管理人报酬	5,222.08
应付托管费	1,492.04
应付销售服务费	472.72
应交税费	110,526.67
其他负债	124,240.78
负债合计	297,280.69
所有者权益：	
实收基金	12,925,419.52
未分配利润	888,018.86
所有者权益合计	13,813,438.38
负债和所有者权益总计	14,110,719.07

五、清算情况

自2018年5月18日至2018年6月8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》“二十三、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组优先从基金财产中支付。但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345,010.51元，2018年6月4日中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户人民币132,906.10元，余额为212,104.41元。该款项由基金管理人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) 本基金最后运作日存出保证金为人民币2,128.49元，2018年6月4日托管账户划入中国证券登记结算有限责任公司人民币616.11元，余额为2,744.60元。该款项由基金管理人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) 本基金最后运作日持有的买入返售金融资产余额为人民币12,000,000.00元，于2018年5月18日到期，到期收到本金12,000,000.00元，以及买入返售利息收入人民币2,653.15元，以上款项已于2018年5月21日划入本基金托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币981.36元，该款项已于2018年5月18日划入本基金托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收利息为人民币5,215.97元，主要包括应收银行存款利息、应收结算备付金利息和应收存出保证金利息，该款项由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(6) 本基金最后运作日应收申购款人民币1,449.96元及2018年5月18日确认的应

收申购款人民币2,518.40元，已于2018年5月21日前划入本基金托管账户。

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55,326.40元，及2018年5月18日确认的应付赎回款5,932.55元和应付转出款215.82元，已于2018年5月22日前从本基金托管账户划付给基金份额持有人。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币5,222.08元，该款项已于2018年6月4日从本基金托管账户支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1492.04元，该款项已于2018年6月4日从本基金托管账户支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币472.72元，该款项已于2018年6月4日从本基金托管账户支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币110,526.67元，其中应交增值税和应交附加税分别为人民币58.65元和7.04元，已于2018年6月7日从托管账户中划出；应交债券利息所得税为人民币110,460.98元，将于税务机关指定时间从本基金托管账户中划出。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币124,240.78元，包括以下内容：

①应付赎回费及转出费为人民币40.78元，已于2018年5月18日和5月21日支付。

②应付证券时报2017年信息披露费90,000.00元，将于收到证券时报信息披露费合同及发票后从本基金托管账户支付；

③应付证券日报2018年信息披露费28,000.00元，已于2018年5月25日从本基金托管账户中划出；

④应付2018年二季度账户维护费6,200.00元，将于收到中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司费用清单后从本基金托管账户中划出。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2018年5月18日 至2018年6月8日止清算期间
----	-------------------------------

一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
1、利息收入-存款利息收入（注1）	5,395.02
2、利息收入-买入返售金融资产利息收入	2,653.15
清算期间收益小计	8,048.17
二、清算期间费用	
清算期间费用小计（注2）	
三、清算期间净收益	8,048.17

注1：利息收入系计提的自2018年5月18日至2018年6月8日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息。

注2：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。按照《基金合同》的约定，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，经基金管理人确认，本基金的清算费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

5、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2018年5月17日基金净资产	13,813,438.38
加：清算期间净收益	8,048.17
减：基金净赎回金额（于2018年5月18日确认的投资者申购赎回申请）	3,638.20
二、2018年6月8日基金净资产	13,817,848.35

截至本次清算期结束日2018年6月8日，本基金剩余财产为人民币13,817,848.35元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组将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财产扣除基金财产清算费用（本基金的清算费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付）、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。

清算起始日2018年5月18日至清算款划出日前一日的应收利息亦属份额持有人所有。以上利息均按实际适用的利率计算，由基金管理人以自有资金垫付并将于清

算款划出前划入托管账户。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。

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) 长盛纯债债券型证券投资基金2018年5月17日资产负债表及审计报告

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛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。

长盛纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2018年6月8日