

# 长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金清算 报告

长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型  
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

长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2016]2082号文核准募集，于2016年11月4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《长城久盛安稳纯债两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》”）的有关规定，本基金进行基金财产清算并终止《基金合同》。本基金《基金合同》终止及清算的公告详见2018年11月12日刊登在《中国证券报》和基金管理人网站（[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)）上的《关于长城久盛安稳纯债两年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2018年11月10日起进入清算程序，由本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、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 长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金

基金简称 长城久盛安稳两年定期开放债券

基金主代码 003466

交易代码 003466

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年11月4日

最后运作日基金份额总额 20,061,906.31份

投资目标 本基金将在控制组合风险和保持资产流动性的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期增值。

**投资策略** 在大类资产配置基础上，本基金通过综合分析宏观经济形势、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。本基金采用的投资策略包括久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、信用利差策略以及债券回购杠杆策略等。

**业绩比较基准** 中债综合指数（总财富）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，其预期风险与预期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]2082号文核准，由基金管理人长城基金管理有限公司于2016年10月26日至2016年11月1日向社会公开募集，《基金合同》于2016年11月4日正式生效，募集规模为1,000,097,562.92份基金份额。

自2016年11月4日至2018年11月9日期间，本基金按《基金合同》正常运作。2018年11月5日至2018年11月9日为本基金开放期，截至开放期最后一个工作日（2018年11月9日）日终，本基金基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于2亿元，触发《基金合同》中约定的基金终止条款，本基金根据《基金合同》的约定进行基金财产清算，不需召开基金份额持有人大会。

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《基金合同》的有关规定，本基金自2018年11月10日起进入清算程序。

### 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：长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018年11月9日

单位：人民币元

最后运作日：2018年11月9日

**资产：**

银行存款 504,185,531.06

结算备付金 3,447,991.89

存出保证金 26,907.40

应收利息 98,935.27

资产总计 507,759,365.62

**负债：**

应付赎回款 487,123,596.06

应付管理人报酬 83,242.36

应付托管费 20,810.59

应付交易费用 9,417.74

应交税费 6,094.93

其他负债 132,543.28  
负债总计 487,375,704.96  
所有者权益：  
实收基金 20,061,906.31  
未分配利润 321,754.35  
所有者权益合计 20,383,660.66  
负债和所有者权益合计 507,759,365.62

注：于最后运作日 2018 年 11 月 9 日，基金份额净值为 1.0160 元，份额总额为 20,061,906.31 份，资产净值为 20,383,660.66 元。

## 五、清算情况

自 2018 年 11 月 10 日至 2018 年 11 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《长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金合同》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 504,185,531.06 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 3,447,991.89 元和存出保证金 26,907.40 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结算保证金，其中上海结算备付金 2,976,276.50 元，深圳结算备付金 471,715.39 元，上海存出保证金 22,123.88 元，深圳存出保证金 4,783.52 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 98,935.27 元，包括活期银行存款应收利息 91,862.43 元、结算备付金应收利息 7,030.02 元和存出保证金应收利息 42.82 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 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 21 日（节假日顺延）结算入账。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、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 487,123,596.06 元，该款项已于 2018 年 11 月 12 日至 13 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 83,242.36 元，该款项已于 2018 年 11 月 13 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 20,810.59 元，该款项已于 2018 年 11 月 13 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 9,417.74 元，该费用为应付银行间交易费用，将根据缴费通知单划付。

(5) 本基金最后运作日应交税费 6,094.93 元，该款项已于 2018 年 11 月 13 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 132,543.28 元。其中，预提审计费 42,877.87 元，已于 2018 年 11 月 28 日支付；预提信息披露费 85,752.61 元，已于 2018 年 11 月 28 日支付；预提银行间账户维护费 3,912.80 元，将根据缴费通知单划付。

### 4、清算期间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（2018年11月9日）基金净资产 20,383,660.66  
加：清算期间（2018年11月10日至2018年11月29日）收入 40,636.34  
其中：利息收入-银行存款利息收入（注1） 37,508.74  
利息收入-结算备付金利息收入（注1） 3,103.20  
利息收入-存出保证金利息收入（注1） 24.40  
减：清算期间（2018年11月10日至2018年11月29日）费用 20,245.00  
其中：账户费用（注2） 245.00  
清算费用（注3） 20,000.00  
二、2018年11月29日基金净资产 20,404,052.00

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的2018年11月10日至2018年11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。

2、账户费用系清算期间本基金托管账户的银行汇划费及银行间账户费。

3、该项为清算律师费用，已于2018年11月28日支付。

2018年11月29日本基金剩余财产为人民币20,404,052.00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。

2018年11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。

### 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）长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金清算审计报告

（2）通力律师事务所关于《长城久盛安稳纯债两年定期开放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。

长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2019年1月23日