

长信富民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：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年2月28日

清算报告公告日：2024年3月6日

§ 1 重要提示

长信富民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》、《长信富民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]1034号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为516,038,428.69份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第1501219号验资报告。基金合同于2015年9月2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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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2024年1月31日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信富民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》,基金份额持有人大会于2024年1月29日表决通过了《关于终止长信富民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。根据此次本基金基金份额持有人大会表决通过的前述议案,大会决议生效后,本基金管理人决定自2024年2月1日起安排5个工作日的赎回选择期,即2024年2月1日起至2024年2月7日止,在赎回选择期期间,投资人仅可以办理本基金的赎回业务,不可办理申购业务。本基金最后运作日为2024年2月7日,自2024年2月8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、基金托管人中国民生银行股份有限公司、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2024年2月8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 | 长信富民纯债一年定开债券 |
| 基金主代码 | 519955 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |

| | | |
|-----------------------|--|-------------------|
| 基金合同生效日 | 2015年9月2日 | |
| 报告期末（2024年2月7日）基金份额总额 | 1,133,429.42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 | <p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）资产配置策略</p> <p>（2）类属配置策略</p> <p>（3）个券选择策略</p> <p>（4）骑乘策略</p> <p>（5）息差策略</p> <p>（6）利差策略</p> <p>（7）资产支持证券的投资策略</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>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。</p> | |
| 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 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信富民纯债一年定开债券 A | 长信富民纯债一年定开债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005069 | 519955 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 391,472.03份 | 741,957.39份 |

§ 3 基金运作情况概述

本基金系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]1034号文批准公开募集，基金合同于2015年9月2日正式生效，首次设立募集基金份额为516,038,428.69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，经与基金托管人中国民生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2023年12月29日0:00起至2024年1月28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

于终止长信富民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2024年1月29日表决通过了《关于终止长信富民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2024年1月31日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信富民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》，本基金管理人决定自2024年2月1日起安排5个工作日的赎回选择期，即2024年2月1日起至2024年2月7日止，在赎回选择期期间，投资人仅可以办理本基金的赎回业务，不可办理申购业务。本基金最后运作日为2024年2月7日，自2024年2月8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：长信富民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 2024年2月19日 | 最后运作日 2024年2月7日 |
|-------------|---------------------|--------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 1,218,313.64 | 14,019.33 |
| 结算备付金 | 14,818.54 | 1,419,899.52 |
| 存出保证金 | 6,535.70 | 6,532.22 |
| 资产总计 | 1,239,667.88 | 1,440,451.07 |
| 负债和净资产 | 清算结束日 2024年2月19日 | 最后运作日 2024年2月7日 |
| 负债： | | |
| 应付赎回款 | - | 738.17 |
| 应付管理人报酬 | - | 153.08 |
| 应付托管费 | - | 51.03 |
| 应付销售服务费 | - | 4.27 |
| 其他负债 | 42,076.32 | 242,076.32 |
| 负债合计 | 42,076.32 | 243,022.87 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 1,133,419.80 | 1,133,429.42 |
| 未分配利润 | 64,171.76 | 63,998.78 |
| 净资产合计 | 1,197,591.56 | 1,197,428.20 |
| 负债和净资产总计 | 1,239,667.88 | 1,440,451.07 |

注：本基金最后运作日 2024 年 2 月 7 日，长信富民纯债一年定开债券 A 份额净值人民币 1.0606 元，长信富民纯债一年定开债券 C 份额净值人民币 1.0543 元，基金份额总额为 1,133,429.42 份，其中长信富民纯债一年定开债券 A 份额 391,472.03 份，长信富民纯债一年定开债券 C 份额 741,957.39 份。

4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金

清算损益表

单位：人民币元

| 项目 | 2024 年 2 月 8 日 (清算开始日)至 2024 年 2 月 19 日 (清算结束日)止期间 |
|----------------------|---|
| 一、 收入 | 202.00 |
| 1、利息收入（注 1） | 202.00 |
| 其中：存款利息收入 | 202.00 |
| 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、其他收入(损失以“-”填列) | - |
| 二、 费用 | 28.50 |
| 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） | 28.50 |
| 三、 利润总额 | 173.50 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、 净收益 | 173.50 |

注：1、利息收入系以当前适用利率预估计提的自 2024 年 2 月 8 日(清算开始日)至 2024 年 2 月 19 日(清算结束日)止期间的银行存款利息收入人民币 130.37 元、结算备付金利息收入人民币 68.15 元和存出保证金利息收入人民币 3.48 元，共计人民币 202.00 元。

2、其他费用系自 2024 年 2 月 8 日(清算开始日)至 2024 年 2 月 19 日(清算结束日)止期间支付费用产生的汇划费，共计人民币 28.50 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2024年2月8日至2024年2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：

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14,019.33元，其中活期存款人民币13,273.30元，应计活期存款利息人民币746.03元；上述活期存款在清算期支付了赎回款、管理费、托管费和销售服务费，调整了最低结算备付金及存出保证金后，于清算结束日（2024年2月19日）银行存款为人民币1,218,313.64元，其中活期存款人民币1,217,437.24元，应计活期存款利息人民币876.40元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币1,419,899.52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1,414,303.55元，应计结算备付金利息人民币5,595.97元。上述结算备付金于2024年2月8日根据中国证券登记结算有限责任公司业务规则进行调整后，于清算结束日（2024年2月19日）结算备付金为人民币14,818.54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9,154.42元，应计结算备付金利息人民币5,664.12元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币6,532.22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人民币6,521.59元，应计存出保证金利息人民币10.63元。于清算结束日（2024年2月19日）存出保证金为人民币6,535.70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人民币6,521.59元，应计存出保证金利息人民币14.11元。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币738.17元，该款项已于2024年2月19日前支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币153.08元，该款项已于2024年2月19日前支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币51.03元，该款项已于2024年2月19日前支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币4.27元，该款项已于2024年2月19日前支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币242,076.32元，其中其他应付款为人民币

200,000.00元，该款项已于2024年2月19日前支付；预提审计费人民币42,076.32元将于2024年2月19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（2024年2月7日）基金净资产 | 1,197,428.20 |
| 加：清算期间净收益 | 173.50 |
| 减：基金净赎回转出金额 （于2024年2月8日确认的投资者净赎回转出申请） | 10.14 |
| 二、2024年2月19日基金净资产 | 1,197,591.56 |

注：根据本基金的基金合同及基金管理人于2024年1月31日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信富民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》，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、结算备付金及存出保证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2024年2月19日止的净资产为人民币1,197,591.56元，其中长信富民纯债一年定开债券A资产净值为415,273.64元，长信富民纯债一年定开债券C资产净值为782,317.92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、结算备付金及存出保证金，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、长信富民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、《长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律意见书。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

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

长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金财产清算小组

2024年3月6日