

长安泓泽纯债债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：长安基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：二零二零年十一月十一日

清算报告公告日：二零二零年十一月十八日

§ 1 重要提示及目录

§ 1.1 重要提示

长安泓泽纯债债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予长安泓泽纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2513号文）准予注册募集，自2016年11月16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》、《长安泓泽纯债债券型证券投资基金基金合同》（以下或简称《基金合同》）的有关规定，《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会审议。截至2020年10月21日日终，本基金已连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人的情形。根据《基金合同》的约定，本基金将依法进入基金财产清算程序，且无需召开基金份额持有人大会审议。本基金管理人应终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序。

本基金《基金合同》终止及基金财产清算安排详见基金管理人于2020年10月23日在中国证监会规定报刊及公司网站上发布的《关于长安泓泽纯债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2020年10月23日起进入清算期，由基金管理人长安基金管理有限公司、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）、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，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，由上海市通力律师事务所对本基金清算事宜出具法律意见书。

§ 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
§1.1 重要提示	2
§1.2 目录	3
§2 基金产品概况	4
§3 基金运作情况	8
§4 财务会计报告（经审计）	9
§5 清盘事项说明	11
§5.1 清算费用	11
§5.2 资产处置情况	11
§5.3 负债清偿情况	12
§5.4 清算期间的剩余资产分配情况	12
§5.5 基金财产清算报告的告知安排	13
§6 备查文件目录	14
§6.1 备查文件目录	14
§6.2 存放地点	14
§6.3 查阅方式	14

§2 基金产品概况

基金名称	长安泓泽纯债债券型证券投资基金
基金简称	长安泓泽纯债债券
基金主代码	003731
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月16日
最后运作日（2020年10月22日） 基金份额总额	204, 525, 050. 37份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求超越业绩比较基准的投资回报和长期稳健增值。
投资策略	<p>1、 久期策略</p> <p>久期是衡量债券价格变动对利率变动敏感性最重要和最主要的指标，也是影响组合收益率的重要因素。久期越长，债券价格对利率的变动就越敏感，债券价格的波动就越大。久期策略主要指综合各类经济和市场情况，确定债券组合的久期水平。</p> <p>2、 类属配置策略</p> <p>类属配置策略即决定资金在不同类型债券间的分配，本基金类属配置策略包括两个层面：决定利率债和信用债的配置侧重和大概比例及细分类别债券的配置比例。</p> <p>本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合市场上主要的债券配置机构资金的情况，深入分析利率债和信用债的相对投资价值，确定利率债和信用债的配置侧重和大概比例，并根据市场的变化趋势，及时进行调整。</p> <p>3、 期限结构策略</p> <p>在对影响利率和信用风险变化的宏观和市场因素分析的基础上，本基金通过预测同一类型债券收益率曲线的形状和变化趋势，在久期策略和类属配置策略的基础上，确定债</p>

券组合最优的期限结构。具体来看，期限结构策略可细分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券收益率的下滑，获得资本利得收益。

子弹策略是在收益率曲线较陡时，使投资组合中债券的久期集中于收益率曲线的一点；杠铃策略是在收益率曲线可能呈现两头下降较中间下降更多的蝶式变动时，使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端；梯式策略是在收益率曲线水平移动时，使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线上。

4、 信用债券投资策略

信用债券面临着债券本息无法按时兑付或无法部分或全部兑付的信用风险，同时信用风险带来了信用溢价，使信用债券的收益率高于同期限的利率债，因此信用债券成为决定债券组合收益率和风险水平的重要券种。本基金拟通过承担适度的信用风险获取信用溢价收益以提升组合的收益率并控制组合的风险，信用债券投资策略包括个券精选、行业配置和动态调整三个层面。通过定性和定量分析，精选信用评级较高、信用风险小、收益率相对较高的个券，再通过筛选行业并在不同行业中分散配置以分散信用债券的风险，最后密切跟踪个券和发债主体的情况，对于经营或信用可能恶化的个券，及时卖出。

定性分析主要包括对企业性质和内部治理情况、财务管理的风格、企业的盈利模式、企业在产业链中的位置和地位、产品竞争力和企业核心优势等企业内部因素分析，以及企业的股东背景、政府对企业的支持、银企关系、企业对国家或地方的重要程度等外部

支持因素分析。定量分析主要包括资本结构分析、现金获取能力分析、盈利能力和偿债能力分析等。同时，关注个券的债券条款和特征，包括其信用评级、收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式和利息税务处理）、剩余期限、久期、凸性、流动性（发行总量、流通量、上市时间）等指标。综合上述因素决定是否将个券纳入备选债券库。

5、 资产支持证券投资策略

本基金将深入研究资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率水平等基本面因素，并且结合债券市场宏观分析的结果，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，辅以量化模型分析，评估其内在价值进行投资。

6、 证券公司短期公司债券投资策略

本基金将根据审慎原则，密切跟踪发行主体的资产负债率和现金流等基本面情况以及债券的信用评级、收益率和投资人数量及流动性情况，重点投资具有较好流动性和具有较高相对投资价值的品种，力求在控制风险的前提下提高投资收益。

7、 中小企业私募债投资策略

本基金将根据审慎原则，密切跟踪中小企业私募债的信用风险变化和流动性情况，通过对中小企业私募债进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债的比例限制，严格控制风险，并充分考虑单只中小企业私募债对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。同时，本基金持续跟踪所投债券发债主体的经营情况和财务指标等，分析评估发债主体未来的偿债能力，对中小企业私募债的信用风险进行评估并及时作出反应。

8、 国债期货投资策略

	<p>本基金主要利用国债期货管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将根据法律法规的规定，结合对宏观经济运行情况和政策趋势的分析，预测债券市场变动趋势。通过对国债期货的流动性、波动水平、风险收益特征、国债期货和现货基差、套期保值的有效性等指标进行持续跟踪，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>9、 回购套利策略</p> <p>本基金将在考虑债券投资的风险收益情况以及回购成本等因素的情况下，在风险可控及法律法规允许的范围内，通过债券回购融入和滚动短期资金，投资于收益率高于融资成本的债券等其他金融工具，获得杠杆放大收益。</p>
业绩比较基准	中国债券综合全价指数的收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金，属于较低风险的投资品种。
基金管理人	长安基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§3 基金运作情况

长安泓泽纯债债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予长安泓泽纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2513号文）准予注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2016年11月11日起至2016年11月11日通过销售机构公开发售。基金合同于2016年11月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为200,061,549.24份（含募集期间利息结转的份额）。

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》、《长安泓泽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，《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，在履行适当程序后，则直接终止《基金合同》并进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会审议。鉴于自《基金合同》生效后，本基金已连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人的情形，为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，无需召开基金份额持有人大会，本基金管理人应终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序。本基金最后运作日为2020年10月22日，自2020年10月23日起进入清算期。

§4 财务会计报告（经审计）

基金最后运作日资产负债表

会计主体：长安泓泽纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020年10月22日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2020年10月22日（基金最后运作日）
资 产：	
银行存款	45,706.30
结算备付金	2,049,347.47
存出保证金	19,126.66
交易性金融资产	192,560,237.60
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	192,560,237.60
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	32,400,000.00
应收证券清算款	1,790.35
应收利息	3,058,838.34
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	230,135,046.72
负债和所有者权益	本期末 2020年10月22日（基金最后运作日）
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-

应付赎回款	21,000.91
应付管理人报酬	41,468.49
应付托管费	13,822.84
应付销售服务费	27.71
应付交易费用	175.00
应交税费	12,399.43
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	124,412.64
负债合计	213,307.02
所有者权益：	
实收基金	204,525,050.37
未分配利润	25,396,689.33
所有者权益合计	229,921,739.70
负债和所有者权益总计	230,135,046.72

注：1、报告截止日2020年10月22日（基金最后运作日），基金份额净值1.1242元，基金份额总额204,525,050.37份。

2、本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

§5 清盘事项说明

自 2020 年 10 月 23 日至 2020 年 11 月 11 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：

§ 5.1 清算费用

按照《长安泓泽纯债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剩余财产中支付。

§ 5.2 资产处置情况

本基金最后运作日存出保证金为人民币 19,126.66 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金，该款项于 2020 年 11 月 3 日划入本基金托管账户。

本基金最后运作日清算备付金为人民币 2,049,347.47 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的最低备付金，该款项于 2020 年 11 月 3 日调整为 1,120,869.55 元，为加快清算速度，基金管理人将以自有资金垫付。

本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 192,560,237.60 元，为了保护基金份额持有人利益，截至 2020 年 11 月 11 日清算结束日，本基金持有交易性金融资产已全部变现，扣除交易费用后的变现金额（含利息）为人民币 179,010,214.97 元。

本基金最后运作日买入返售金融资产为人民币 32,400,000.00 元，为了保护基金份额持有人利益，截至 2020 年 11 月 11 日清算结束日，本基金持有买入返售金融资产已全部变现，变现金额为人民币 32,405,326.03 元。

本基金最后运作日应收利息为人民币 3,058,838.34 元，其中应收银行存款利息人民币 710.22 元、应收清算备付金利息人民币 2,762.68 元、应收申购款利息人民币 33,453.93 元，应收债券利息人民币 3,021,911.51 元，其中截至清算

结束日 2020 年 11 月 11 日，应收债券利息已全部结算，应收利息余额为人民币 114,766.32 元，为加快清算速度，基金管理人将以自有资金垫付。

§ 5.3 负债清偿情况

本基金最后运作日应付赎回款为人民币 21,000.91 元，该款项已于 2020 年 10 月 23 日支付 20,893.85 元，2020 年 10 月 26 日支付 107.06 元。

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 41,468.49 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日支付。

本基金最后运作日应付托管费为人民币 13,822.84 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日支付。

本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 27.71 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日支付。

本基金最后运作日应付交易费用为人民币 175.00 元，该款项将于清算资产支付日后支付，截至 2020 年 11 月 11 日清算结束日，应付交易费用余额为 1,262.50 元，该款项将于清算资产支付日后支付。

本基金最后运作日应交税费为人民币 12,399.43 元，该款项已于 2020 年 11 月 9 日支付，截至 2020 年 11 月 11 日清算结束日，应交税费余额为 10,932.00 元，该款项将于清算资产支付日后支付。

本基金最后运作日其他负债为人民币 124,412.64 元，为预提审计费、预提信息披露费及预提银行间账户维护费。其中预提审计费为人民币 24,263.12 元，该款项预计将于收到会计师事务所付款通知书及发票起五日内支付；预提信息披露费为人民币 97,049.52 元，该款项将于清算资产支付日后支付；预提银行间账户维护费 3,100.00 元，该款项将于清算资产支付日后支付。

§ 5.4 清算期间的剩余资产分配情况

项目	金额
一、最后运作日2020年10月22日基金净资产	229,921,739.70
加：清算期间（2020-10-23至2020-11-11）收入	-16,499,934.29
利息收入（注1）	584,309.24
投资收益	-21,780,866.41

公允价值变动损益	4,696,622.88
其他收入	-
减：清算期间（2020-10-23至2020-11-11）费用	18,045.42
交易费用	1,202.26
税金及附加	1,593.16
清算费用（注2）	15,250.00
二、2020年11月11日（清算报告出具日）基金净资产（注3）	213,403,759.99

注：1、利息收入中 76,059.01 元系以当前适用的利率预估计提的自 2020 年 10 月 23 日至 2020 年 11 月 11 日止清算期间及清算期结束日后至清算款划出日前一日的银行存款利息；利息收入中 1,780.48 元系以当前适用的利率计提的自 2020 年 10 月 23 日至 2020 年 11 月 11 日止清算期间及清算期结束日后至清算款划出日前一日的备付金利息；利息收入中 499,135.25 元系以各债券利率预估计提的自 2020 年 10 月 23 日至 2020 年 11 月 11 日止清算期间的债券利息；利息收入中 7,334.50 元系以买入返售金融资产交易预估计提的自 2020 年 10 月 23 日至 2020 年 11 月 11 日止清算期间的买入返售金融资产利息。

2、清算费用中 15,000.00 元系清盘期间计提的律师费；250.00 元系清盘期间产生的银行汇划费。

3、资产处置及负债清偿后，于 2020 年 11 月 11 日本基金剩余财产为人民币 213,403,759.99 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。

2020 年 10 月 23 日至清算款划出日前一日的银行存款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，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。

§ 5.5 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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§6 备查文件目录

§ 6.1 备查文件目录

- 1、长安泓泽纯债债券型证券投资基金自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 10 月 22 日（基金最后运作日）止期间财务报表及审计报告；
- 2、上海市通力律师事务所关于《长安泓泽纯债债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

§ 6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

§ 6.3 查阅方式

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。

长安泓泽纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组
2020 年 11 月 11 日