

长城泰丰纯债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：兴业银行股份有限公司

一、重要提示

长城泰丰纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2019】2124号文准予注册，于2020年7月27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《长城泰丰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，截至2021年3月24日，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，触发了《基金合同》终止条款。本基金进入清算期的公告详见2021年3月25日刊登在《上海证券报》和基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）上的《关于长城泰丰纯债债券型证券投资基金基金合同终止与基金财产清算的公告》。

本基金自2021年3月25日起进入财产清算期，由本基金基金管理人长城基金管理有限公司、本基金基金托管人兴业银行股份有限公司、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	长城泰丰纯债债券型证券投资基金	
基金简称	长城泰丰债券	
基金主代码	008309	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年7月27日	
基金最后运作日	2021年3月24日	
基金最后运作日基金份额总额	1,004,034.16份	
下属分级基金的基金简称:	长城泰丰债券A	长城泰丰债券C
下属分级基金的交易代码:	008309	008310
报告期末下属分级基金的份额总额	1,003,224.18份	809.98份
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求获得超越业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结	

	<p>合，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产和现金类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，以规避市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、债券投资策略 本基金债券投资策略主要包括组合久期配置策略、信用债投资策略、骑乘策略和杠杆投资策略。</p> <p>3、国债期货投资策略 本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、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	兴业银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2019】2124号文准予注册，由基金管理人长城基金管理有限公司于2020年4月27日至2020年7月24日向社会公开募集，《基金合同》于2020年7月27日正式生效，募集规模为230,023,783.16份基金份额。

自2020年7月27日至2021年3月24日期间，本基金按《基金合同》正常运作。根据本基金《基金合同》约定“《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5000万元情形的，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，基金管理人应当终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会”。截至2021年3月24日，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000

万元，触发了《基金合同》终止条款，基金管理人将终止《基金合同》，并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。本基金自 2021 年 3 月 25 日起进入财产清算期。

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：长城泰丰纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 3 月 24 日

单位：人民币元

最后运作日：2021 年 3 月 24 日	
资 产：	
银行存款	10,145,512.46
存出保证金	1,850.31
应收利息	301.85
资产合计：	10,147,664.62
负 债：	
应付赎回款	9,080,900.00
应付管理人报酬	1,929.55
应付托管费	643.19
应付销售服务费	0.24
应付税费	22.35
其他负债	50,800.00
负债合计	9,134,295.33
所有者权益：	
实收基金	1,004,034.16
未分配利润	9,335.13
所有者权益合计	1,013,369.29
负债与持有人权益总计：	10,147,664.62

注：于最后运作日 2021 年 3 月 24 日，基金 A 级份额净值为 1.0093 元，份额为 1,003,224.18 份，资产净值为 1,012,553.77 元，C 级份额净值为 1.0068 元，份额为 809.98 份，资产净值为 815.52 元。

五、清算情况

自 2021 年 3 月 25 日至 2021 年 4 月 9 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《长城泰丰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 10,145,512.46 元，是储存于基金托管人兴业银行的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日存出保证金 1,850.31 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存出保证金，其中上海存出保证金 1,673.97 元，深圳存出保证金 176.34 元。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 301.85 元，包括活期银行存款应收利息 301.49 元、存出保证金应收利息 0.36 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 月的 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清；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 月的 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 9,080,900.00 元，该款项已于 2021 年 3 月 25 日支付 7,062,300.00 元和 2021 年 3 月 26 日支付 2,018,600.00 元。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,929.55 元，该款项已于 2021 年 4 月 6 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 643.19 元，该款项已于 2021 年 4 月 6 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0.24 元，该款项已于 2021 年 4 月 6 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付税费为人民币 22.35 元，该款项已于 2021 年 4 月 7 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 50,800.00 元。其中应付未付 2020 年审计费 35,000.00 和 2021 年审计费 6,800.00，该款项已于 2021 年 4 月 6 日支付；应付银行间维护费 9,000.00，将根据缴费通知单划付。

4、清算期间基金资产净值的变动情况

单位：人民币元
减少用“-”表示

项目	金额
一、最后运作日（2021 年 3 月 24 日）基金资产净值	1,013,369.29
加：清算期间（2021 年 3 月 25 日至 2021 年 4 月 9 日）收入	185.03
其中：利息收入-银行存款利息收入（注 1）	183.43
利息收入-存出保证金利息收入（注 1）	1.60
减：清算期间（2021 年 3 月 25 日至 2021 年 4 月 9 日）费用	-221.62
其中：账户费用（注 2）	-221.62
二、清算期结束日（2021 年 4 月 9 日）基金资产净值	1,013,332.70

注 1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的 2021 年 3 月 25 日至 2021 年 4 月 9 日期间的银行存款利息和存出保证金利息。

注 2、账户费用系清算期间本基金托管账户的银行汇划费。

5、其他说明事项

清算期结束日（2021 年 4 月 9 日）本基金剩余财产（基金资产净值）为人民币 1,013,332.70 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，按各类基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算期结束日次日（2021 年 4 月 10 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。

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) 长城泰丰纯债债券型证券投资基金清算审计报告

(2) 上海市通力律师事务所关于《长城泰丰纯债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

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。

长城泰丰纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2021 年 4 月 28 日