

# 长信富平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：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：2025年2月6日

清算报告公告日：2025年2月10日

## § 1 重要提示

长信富平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》、《长信富平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[2016]1069号文注册公开募集。本基金为契约型，定期开放式，存续期限为不定期。本基金根据认购、申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为1,764,632,292.70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1600550号验资报告。基金合同于2016年8月15日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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12月18日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信富平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12月16日表决通过了《关于终止长信富平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，本基金最后运作日为2024年12月25日，自2024年12月26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、基金托管人平安银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2024年12月26日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                    | 长信富平纯债一年定开债券  |
| 基金主代码                   | 002858        |
| 基金运作方式                  | 契约型开放式        |
| 基金合同生效日                 | 2016年8月15日    |
| 报告期末(2024年12月25日)基金份额总额 | 6,392,965.24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，追求基金资产的长期稳健增值。   |                   |
| 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>(一) 封闭期投资策略</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略</li> <li>2、类属配置策略</li> <li>3、个券选择策略</li> <li>4、骑乘策略</li> <li>5、息差策略</li> <li>6、利差策略</li> <li>7、资产支持证券的投资策略</li> <li>8、国债期货的投资策略</li> </ol> <p>(二) 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           | 平安银行股份有限公司  |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 长信富平纯债一年定开债券<br>A   | 长信富平纯债一年定开债券<br>C |
| 下属分级基金的交易代码     | 002858  | 002859            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,326,840.74 份  | 2,066,124.50 份    |

### § 3 基金运作情况概述

本基金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[2016]1069号文《关于准予长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于2016年8月15日正式生效，首次设立募集基金份额为1,764,632,292.70份。

因市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，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，经与基金托管人平安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2024年11月19日0:00起至2024年12月15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《关于终止长信富平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12月16日表决通过了《关于终止长信富平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12月18日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信富平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》，自2024年12月26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：长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 25 日

单位：人民币元

| 资产          | 最后运作日<br>2024年12月25日 |
|-------------|----------------------|
| <b>资产：</b>  |                      |
| 货币资金        | 5,613,977.40         |
| 结算备付金       | 1,047,854.75         |
| 资产总计        | 6,661,832.15         |
| 负债和净资产      | 最后运作日<br>2024年12月25日 |
| <b>负债：</b>  |                      |
| 应付管理人报酬     | 1,379.94             |
| 应付托管费       | 459.98               |
| 应付销售服务费     | 582.66               |
| 其他负债        | 111,000.00           |
| 负债合计        | 113,422.58           |
| <b>净资产：</b> |                      |
| 实收基金        | 6,392,965.24         |
| 未分配利润       | 155,444.33           |
| 净资产合计       | 6,548,409.57         |
| 负债和净资产总计    | 6,661,832.15         |

注：截至最后运作日，长信富平纯债一年定开债券 A 资产净值为 4,432,167.35 元，长信富平纯债一年定开债券 C 资产净值为 2,116,242.22 元。

## § 5 基金财产分配

自2024年12月26日至2024年12月30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 本基金最后运作日货币资金为人民币5,613,977.40元，其中存放于托管账户人民币5,613,701.55元，应计银行存款利息人民币275.85元。截至2024年12月30日，货币资金为人民币5,611,827.57元，其中存放于托管账户人民币5,611,278.97元，应计银行存款利息人民币548.60元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币1,047,854.75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1,047,619.05元，应计结算备付金利息人民币235.70元，该款项将于2024年12月30日后划入托管账户。

### 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,379.94元，该款项已于2024年12月26日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币459.98元，该款项已于2024年12月26日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币582.66元，该款项已于2024年12月26日支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债为人民币111,000.00元，其中预提清算审计费人民币11,000.00元，预提信息披露费100,000.00元，上述款项将于2024年12月30日之后支付。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目            | 自2024年12月26日<br>至2024年12月30日<br>止清算期间 |
|---------------|---------------------------------------|
| <b>一、清算收益</b> |                                       |
| 1、利息收入（注）     | 508.45                                |
| 其中：存款利息收入     | 508.45                                |
| 清算收益小计        | 508.45                                |
| <b>二、清算费用</b> |                                       |

|         |        |
|---------|--------|
| 清算费用小计  | -      |
| 三、清算净收益 | 508.45 |

注：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2024 年 12 月 26 日至 2024 年 12 月 30 日止清算期间的银行存款利息和结算备付金利息。2024 年 12 月 30 日后至清算款划出日前的银行存款应计利息和结算备付金应计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，上述所有利息于剩余资产分配日之前未划入托管账户的，将由基金管理人在剩余资产分配日以自有资金垫付，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 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12月25日）基金净资产 | 6,548,409.57 |
| 加：清算期间净收益                 | 508.45       |
| 二、2024年12月30日基金净资产        | 6,548,918.02 |

根据本基金的基金合同及《长信基金管理有限责任公司关于长信富平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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2024 年 12 月 30 日止的剩余财产为人民币 6,548,918.02 元，其中长信富平纯债一年定开债券 A 资产净值为 4,432,511.50 元，长信富平纯债一年定开债券 C 资产净值为 2,116,406.52 元。

截至 2024 年 12 月 30 日，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 5,611,278.97 元。

#### 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、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金清算审计报告；
- 2、《长信富平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。

### 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>。

长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金财产清算小组

2025年2月10日