

宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式 证券投资基金清算报告

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日：2026年5月29日

清算报告公告日：2026年6月3日

一、重要提示

宝盈基金管理有限公司旗下的宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称为“本基金”）成立于2019年5月8日，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

为了维护基金份额持有人利益，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《宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司经与基金托管人协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《基金合同》终止事项。

本次基金份额持有人大会的权益登记日为2026年4月14日，投票时间自2026年4月13日起至2026年5月11日17:00。本次基金份额持有人大会的计票于2026年5月12日在基金托管人授权代表的监督及上海市通力律师事务所的见证下进行，并由深圳市深圳公证处对计票过程及结果进行了公证。本次基金份额持有人大会于2026年5月12日表决通过了《关于宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同终止有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

根据《关于宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同终止有关事项的议案》，自基金份额持有人大会决议生效并公告之日（2026年5月13日）的下一日起，本基金即进入基金财产清算程序，本基金将根据《基金合同》中关于基金财产清算的有关规定组织基金财产清算。

本基金最后运作日为2026年5月13日，自2026年5月14日起进入清算期。基金管理人宝盈基金管理有限公司、基金托管人浙商银行股份有限公司、容诚会计师事务所（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，并由容诚会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，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

1、基金基本情况

| | |
|------|------------------------|
| 基金名称 | 宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金 |
|------|------------------------|

| | |
|---------------------|-------------|
| 基金简称 | 宝盈聚享定期开放债券 |
| 基金主代码 | 006946 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019年5月8日 |
| 基金管理人 | 宝盈基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 浙商银行股份有限公司 |
| 基金最后运作日（2026年5月13日） | 485,678.26份 |
| 基金份额总额 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2、基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金将在严格控制投资组合风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）债券投资策略</p> <p>本基金以宏观研究、行业研究、公司研究三个维度为决策出发点，结合估值研究、投资者行为研究，自上而下确定组合整体杠杆率以及货币类、利率类、信用类的债券配置比例。同时，本基金注重微观层面的投资研究及策略，尤其是在信用债券领域，具体投资标的选取和估值评估侧重深入的自下而上研究。</p> <p>本基金封闭期内采用的债券投资策略主要包括债券资产配置策略、行业配置策略、公司配置策略。</p> <p>1）债券资产配置策略。组合杠杆率及货币类、利率类、信用类债券的配置比例决策主要参考以下几个方面的研究：</p> <p>①宏观经济变量（包括但不限于宏观经济增长及价格类数据、货币政策及流动性、行业周期等）、流动性条件、行业基本面等研究；</p> <p>②利率债及信用债的绝对估值、相对估值、期限结构研究；</p> <p>③宏观流动性环境及货币市场流动性研究；</p> <p>④大宗商品及国际宏观经济、汇率、主要国家货币政策及债券市场研究。</p> <p>2）行业配置策略。基于产业债、地产债、城投债不同的中观及微观研究方法，并结合行业数据分析、财务数据分析、估值分析等研究，本基金以分散化配置模式为基础，实现组合在不同行业信用债券的构建及动态投资管理。本基金将根据行业估值差异，在考虑绝对收益率和行业周期预判的基础上，合理地决定不同行业的配置比例。</p> <p>3）公司配置策略。基于公司价值研究的重要性，本基金将根据不同发行人主体的信用基本面及估值情况，在充分考虑组合流动性特征的前提下，结合行业周期研究，甄别具有估值优势、基本面改善的公司，以分散化配置模式为基础策略。</p> <p>（2）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析、公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>(3) 中小企业私募债券投资策略</p> <p>本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，选择风险与收益相匹配的品种进行投资。本基金投资中小企业私募债券的剩余期限，不得超过自投资之日起至本次封闭期结束之日的长度。</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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×90%+1年定期存款利率（税后）×10% |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型基金，属于中低风险/收益的产品，预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

三、基金运作情况概述

宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金经 2018 年 11 月 14 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2018〕1849 号《关于准予宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册。本基金自 2019 年 5 月 6 日起向社会公开募集，基金募集工作于 2019 年 5 月 6 日顺利结束。本次基金募集总额为 209,999,000.00 元人民币，有效认购户数为 2 户。上述资金于 2019 年 5 月 7 日全额划入本基金在基金托管人浙商银行股份有限公司开立的宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金托管专户。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资并向中国证监会备案，《宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 5 月 8 日正式生效。

为了维护基金份额持有人利益，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，本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司经与基金托管人协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《基金合同》终止事项。

本次基金份额持有人大会的权益登记日为 2026 年 4 月 14 日，投票时间自 2026 年 4 月 13 日起至 2026 年 5 月 11 日 17:00。本次基金份额持有人大会的计票于 2026 年 5 月 12 日在基金托管人授权代表的监督及上海市通力律师事务所的见证下进行，并由深圳市深圳公证处对计票过程及结果进行了公证。本次基金份额持有人大会于 2026 年 5 月 12 日表决通过了《关于宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同终止有关

事项的议案》，本次基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

根据《关于宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同终止有关事项的议案》，自基金份额持有人大会决议生效并公告之日（2026年5月13日）的下一日起，本基金即进入基金财产清算程序，本基金将根据《基金合同》中关于基金财产清算的有关规定组织基金财产清算。本基金最后运作日为2026年5月13日，自2026年5月14日起进入基金财产清算程序。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026年5月13日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| 资 产 | 2026年5月13日（基金最后运作日） |
|--------------------|----------------------------|
| 资产： | |
| 货币资金 | 18,488.13 |
| 结算备付金 | 2,663.30 |
| 存出保证金 | 28,289.06 |
| 交易性金融资产 | 504,488.77 |
| 其中：债券投资 | 504,488.77 |
| 资产合计： | 553,929.26 |
| 负债和所有者权益 | 2026年5月13日（基金最后运作日） |
| 负债： | |
| 卖出回购金融资产款 | 10,000.29 |
| 应付管理人报酬 | 58.14 |
| 应付托管费 | 19.36 |
| 应交税费 | 23.77 |
| 其他负债 | 38,000.00 |
| 负债合计： | 48,101.56 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 485,678.26 |
| 未分配利润 | 20,149.44 |
| 所有者权益合计： | 505,827.70 |
| 负债和所有者权益总计： | 553,929.26 |

注：1、报告截止日2026年5月13日（基金最后运作日），基金份额总额为485,678.26份，基金

份额净值 1.0415 元。

2、本财务报告已经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并出具了无保留意见的审计报告。

五、清算情况

自 2026 年 5 月 14 日起至 2026 年 5 月 20 日止的清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式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。

2、资产处置情况

（1）本基金最后运作日的银行存款为人民币 18,488.13 元，其中存储于基金托管人浙商银行股份有限公司的活期银行存款本金为人民币 9,439.47 元，应计活期银行存款利息为人民币 9,048.66 元；

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币 2,663.30 元，其中上交所最低结算备付金为人民币 2,398.99 元，应计上交所最低结算备付金利息为人民币 264.31 元；

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币 28,289.06 元，其中上交所存出保证金为人民币 28,274.60 元，应计上交所存出保证金利息为人民币 14.46 元；

（4）本基金最后运作日债券投资为人民币 504,488.77 元，截至 2026 年 5 月 14 日全部变现，变现金额为人民币 504,554.67 元。

3、负债清偿情况

（1）本基金最后运作日卖出回购金融资产款为人民币 10,000.29 元，该笔卖出回购金融资产款到期日为 2026 年 5 月 14 日，到期结算资金（含利息）10,000.58 元已于 2026 年 5 月 15 日支付；

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 58.14 元，该款项于实际支付时扣除；

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币 19.36 元，该款项于实际支付时扣除；

（4）本基金最后运作日应交税费为人民币 23.77 元，该款项于实际支付时扣除；

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 38,000.00 元，其中应付审计费为人民币 8,000.00 元，该款项于实际支付时扣除；应付信息披露费为人民币 30,000.00 元，该款项于实际支付时扣除。

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 2026 年 5 月 13 日基金净资产 | 505,827.70 |
| 加：清算期间（2026 年 5 月 14 日至 2026 年 5 月 20 日）收入 | 71.59 |
| 其中：利息收入-活期存款利息收入（注 1） | 4.21 |
| 利息收入-结算备付金利息收入（注 1） | 0.14 |
| 利息收入-存出保证金利息收入（注 1） | 1.89 |
| 交易性金融资产投资收益 | 65.35 |
| 减：清算期间（2026 年 5 月 14 日至 2026 年 5 月 20 日）支出 | 0.36 |
| 其中：利息支出-卖出回购金融资产利息支出 | 0.29 |
| 税金及附加 | 0.07 |
| 二、清算结束日（2026 年 5 月 20 日）基金资产净值（注 2） | 505,898.93 |

注 1：利息收入系以当前适用利率预估，该金额可能与实际结息金额存在略微差异。

注 2：资产处置及负债清偿后，截至 2026 年 5 月 20 日本基金剩余财产为人民币 505,898.93 元，根据本基金《基金合同》的约定，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。清算期结束日次日至清算款划出日前一日的资金账户孳生的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，基金管理人将在清算付款日以自有资金先行垫付上述结算备付金、存出保证金和未结息金额，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，利息收入预估金额与实际结算金额的差额由基金管理人承担。

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，在经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 《宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式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宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的住所和/或办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的住所和/或办公场所或在基金管理人网站免费查阅。

宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2026年5月29日（清算报告出具日）