

长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

清算报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022年9月30日

清算报告公告日期：2022年10月12日

一、重要提示

长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2015年11月25日《关于准予长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕2738号）和中国证监会证券投资基金机构监管部2016年9月28日《关于长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函〔2016〕2356号）注册募集，于2017年2月22日成立并正式运作，基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《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，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。”截至2022年9月14日日终，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人已与基金托管人协商一致，决定终止《基金合同》并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现《基金合同》终止事由后依法履行基金财产清算程序。本基金管理人与基金托管人协商一致，确定2022年9月14日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2022年9月15日）起本基金进入基金财产清算程序。《基金合同》终止及基金财产清算安排详见2022年9月15日刊登在《中国证券报》和本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《长盛基金管理有限公司关于长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金最后运作日为2022年9月14日，自2022年9月15日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国银行、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所于2022年9月15日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行

审计，上海市海华永泰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	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛量化多策略
基金代码	003658
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年2月22日
基金最后运作日（2022年9月14日）基金份额总额	7,281,057.25份
投资目标	通过对多种策略超额收益进行历史有效性验证和持续监控，深度挖掘具备阶段性成长机会的上市公司，满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	<p>本基金将充分发挥基金管理人的投资研究优势，运用科学严谨、规范化的资产配置方法，对不同策略的收益和风险回撤进行动态跟踪和策略敞口调整，谋求基金资产的长期稳定增长。</p> <p>（一）大类资产配置策略本基金管理人将综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，动态调整各资产类别的投资比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>（二）股票投资策略基金管理人主要根据上市公司基本面数据、二级市场交易价格特征、分析师预期信息和行为特征、上市公司行为等数据和信息构建多个量化选股策略，并对组合中的相关策略，定期采用等权重配置进行再平衡，并在此基础上进行优化和调整。</p> <p>（三）债券投资策略本基金在实际的投资管理运作中，将运用利率配置策略、类属配置策略、信用配置策略、相对价值策略及单个债券选择策略等多种策略，以获取债券市场的长期稳定收益。</p>

业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2015年11月25日《关于准予长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕2738号）和中国证监会证券基金机构监管部2016年9月28日《关于长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函〔2016〕2356号）注册募集，于2017年2月22日成立并正式运作，基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《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，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。”

截至2022年9月14日日终，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人已与基金托管人协商一致，决定终止《基金合同》并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。本基金管理人与基金托管人协商一致，确定2022年9月14日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2022年9月15日）起本基金进入基金财产清算程序。

自本基金《基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年9月14日（基金最后运作日）

金额单位：人民币元

科目名称	最后运作日 (2022年9月14日)
资产：	
银行存款	11,714,994.44
结算备付金	458,772.84
存出保证金	63,872.93
交易性金融资产	
应收证券清算款	204,108.94
资产总计	12,441,749.15
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	1,739,508.11
应付管理人报酬	7,724.39
应付托管费	1,287.39
其他负债	121,204.09
负债合计	1,869,723.98
所有者权益：	
实收基金	7,281,057.25
未分配利润	3,290,967.92
所有者权益合计	10,572,025.17
负债和所有者权益总计	12,441,749.15

注：截至2022年9月14日(基金最后运作日)，基金份额净值1.452元，基金份额总额7,281,057.25份。

五、清算情况

自2022年9月15日至2022年9月29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：

1、清算费用

按照《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”的约

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。

考虑到本基金清算的实际情况，并从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算费用中的律师费部分由基金管理人承担，不从基金财产中支付。其他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为人民币11,714,994.44元，其中应计利息为人民币8,564.45元。清算期间银行存款变动金额为人民币-1,703,876.64元，其中包含新增银行存款应计利息人民币1,484.10元，2022年9月21日结息冲减银行存款应计利息9,269.63元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币10,011,117.80元，其中银行存款应计利息余额为人民币778.92元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币458,772.84元，其中上海结算备付金为人民币434,514.00元，深圳结算备付金为人民币22,608.70元，应计利息共计人民币1650.14元。清算期间新增结算备付金应计利息人民币308.55元，2022年9月21日结息冲减结算备付金应计利息1,794.13元。截至清算期结束日，结算备付金余额为人民币457,287.26元，其中结算备付金利息余额为人民币164.56元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币63,872.93元，其中上海存出保证金为人民币55,991.92元，深圳存出保证金为人民币7,642.02元，北京存出保证金为人民币4.37元，应计利息共计人民币234.62元。清算期间新增存出保证金应计利息人民币42.90元，2022年9月21日结息冲减存出保证金应计利息254.64元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币63,661.19元，其中存出保证金利息余额为人民币22.88元。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币204,108.94元，该款项已于清算期间内划入托管账户。

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1,739,508.11元，应付管理人报酬为人民币7,724.39元，应付托管费为人民币1,287.39元，上述款项已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币121,204.09元，其中应付赎回费人民

币8.36元、应付交易费用人民币2,401.84元、账户维护费人民币9,300.00元和信息披露费84,493.89元已于清算期间内支付；预提清算审计费人民币25,000.00元将于完成付款流程后支付。

4、清算期间的清算损益情况

金额单位：人民币元

项目	自2022年9月15日 至2022年9月29日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	1,835.18
清算期间收益小计	1,835.18
二、清算期间支出	
银行划款费	309.45
清算期间支出小计	309.45
三、清算期间净收益	1,525.73

注1：利息收入系计提的2022年9月15日至2022年9月29日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

金额单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2022年9月14日基金净资产	10,572,025.17
加：清算期间净收益	1,525.73
减：基金净赎回金额（于2022年9月15日确认的投资者赎回、转出申请）	66,694.65
二、清算结束日2022年9月29日基金净资产	10,506,856.25

资产处置及负债清偿后，2022年9月29日本基金剩余财产为人民币10,506,856.25元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组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。

自清算起始日（2022年9月15日）至清算结束日（2022年9月29日）的银行存款等产生的利息已计入清算期间净收益，自清算期结束日次日（2022年9月30日）至清

算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。为便于及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息及结算备付金等。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，将于清算期后返还给基金管理人，基金财产清算完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

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) 《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 9 月 14 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》；

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金清算报告>之法律意见》。

2、存放地点

存放于基金管理人的办公地址。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内到基金管理人的办公地址免费查阅。

长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2022年10月12日