

长盛同享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11月9日

清算报告公告日期：2022年11月11日

一、重要提示

长盛同享灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”）担任基金管理人，由中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）担任基金托管人。本基金是由原长盛同享保本混合型证券投资基金（以下简称“长盛同享保本基金”）转型而来。长盛同享保本混合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”）证监许可〔2016〕885号文《关于准予长盛同享保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案，《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月28日正式生效。根据《关于长盛同享保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛同享灵活配置混合型证券投资基金及相关业务安排的公告》，长盛同享保本基金因未能符合保本基金存续条件，自2018年7月5日起转型为长盛同享灵活配置混合型证券投资基金。原《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《长盛同享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》”）自该日起生效。

根据《基金合同》“第五部分 基金的存续”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，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。”，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。因本基金连续超过60个工作日基金资产净值低于5000万元，触发《基金合同》约定的终止情形，为维护基金份额持有人利益，本基金管理人与基金托管人协商一致，确定2022年10月17日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2022年10月18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27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同享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10月17日，自2022年10月18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10月18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	长盛同享灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛同享混合
基金代码	A类：002789；C类：002790
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年7月5日
基金最后运作日（2022年10月17日）基金份额总额	19,813,611.18份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	1、大类资产配置策略：本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，确定并动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，从而实现基金资产的大类资产配置。2、股票投资策略：本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，通过对上市公司基本面的深入研究，选择具有长期持续增长能力的公司。3、债券组合管理策略：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。
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

长盛同享灵活配置混合型证券投资基金是由原长盛同享保本混合型证券投资基金(以下简称“长盛同享保本基金”)转型而来。长盛同享保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可〔2016〕885号文《关于准予长盛同享保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》公开募集，募集资金及其产生的利息共计4,734,480,303.02元，折合基金份额4,734,480,303.02份。经向中国证监会备案，《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月28日正式生效。

长盛同享保本混合型证券投资基金基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，第一个保本周期的担保人为安徽省信用担保集团有限公司。长盛同享保本混合型证券投资基金第一个保本周期为2年，为自《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》生效之日起至2个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日或2个公历年后无该对应日，则顺延至下一个工作日，因此长盛同享保本基金第一个保本周期届满日为2018年6月28日。由于第一个保本周期到期，长盛同享保本混合型证券投资基金不符合保本基金存续条件，根据《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，长盛同享保本基金在第一个保本周期到期后转型为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长盛同享灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《关于长盛同享保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛同享灵活配置混合型证券投资基金及相关业务安排的公告》，长盛同享保本混合型证券投资基金自2018年7月5日起转型为长盛同享灵活配置混合型证券投资基金，并相应修改基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等。原《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》失效，《长盛同享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同享灵活配置混合型证券投

资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0%-95%，债券投资占基金资产的比例为0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

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。

根据《长盛同享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 基金的存续”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，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16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10月17日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2022年10月18日）起本基金进入基金财产清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛同享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年10月17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10月17日)
资产:	
银行存款	33,793,961.95
结算备付金	138,859.79
存出保证金	8,248.33
交易性金融资产	399.30
应收证券清算款	268,489.35
资产总计	34,209,958.72
负债和所有者权益	
负债:	
应付清算款	214.83
应付赎回款	6,173,743.70
应付管理人报酬	22,849.51
应付托管费	3,808.26
应付销售服务费	843.82
其他负债	118,638.52
负债合计	6,320,098.64
所有者权益:	
实收基金	19,813,611.18
未分配利润	8,076,248.90
所有者权益合计	27,889,860.08
负债和所有者权益总计	34,209,958.72

注：截至2022年10月17日(基金最后运作日)，基金份额总额19,813,611.18份，其中A类基金份额总额为18,929,980.23份，基金份额净值1.411元；C类基金份额总额为883,630.95份，基金份额净值1.327元。

五、清算情况

自2022年10月18日至2022年11月09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33,793,961.95元，其中应计利息为人民币3,693.23元。清算期间银行存款变动金额为人民币-6,024,289.68元，其中包含新增银行存款应计利息人民币6,323.31元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币27,769,672.27元，其中银行存款应计利息余额为人民币10,016.54元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币138,859.79元，其中上海结算备付金为人民币83,749.73元，深圳结算备付金为人民币54,956.02元，应计利息共计人民币154.04元。清算期间新增结算备付金应计利息人民币100.47元，2022年11月02日结算备付金调整-136,669.87元。截至清算期结束日，结算备付金余额为人民币2,290.39元，其中结算备付金利息余额为人民币254.51元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币8,248.33元，其中上海存出保证金为人民币2,100.11元，深圳存出保证金为人民币6,140.20元，应计利息共计人民币8.02元。清算期间新增存出保证金应计利息人民币12.99元，2022年11月02日存出保证金调整14,164.35元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币22,425.67元，其中存出保证金利息余额为人民币21.01元。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币268,489.35元，该款项已于清算期间内划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币399.30元，全部为股票投资，自2022年10月18日至2022年11月09日止清算期间，本基金确认申购新股10,731.12元，以上股票均于清算期间内处置变现，处置损益为人民币2,877.47元，产生的交易费用为人民币28.18元。

股票明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票代码	数量（股）	最后运作日估值单价	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
1	欧晶科技	001269	10	39.93	156.50	399.30

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票代码	中签数量（股）	中签价格	中签金额
1	好上好	001298	241	35.32	8,512.12
2	箭牌家居	001322	175	12.68	2,219.00

3、负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付清算款为人民币214.83元，应付赎回款为人民币6,173,743.70元，应付管理人报酬为人民币22,849.51元，应付托管费为人民币3,808.26元，应付销售服务费为人民币843.82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118,638.52元，其中应付赎回费人民币97.45元、应付交易费用人民币24,978.87元、信息披露费人民币63,562.20元已于清算期间内支付；预提清算审计费人民币30,000.00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10月18日 至2022年11月09日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	6,436.77
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	2,877.47
清算期间收益小计	9,314.24
二、清算期间支出	
银行划款费	214.11
股票交易费用	28.18
清算期间支出小计	242.29
三、清算期间净收益	9,071.95

注1:利息收入系计提的2022年10月18日至2022年11月09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。

注2:处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票最后运作日估值总额和股息红利税后的差额。

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10月17日基金净资产	27,889,860.08
加：清算期间净收益	9,071.95
减：基金净赎回金额（于2022年10月18日确认的投资者赎回、转出申请）	134,543.70
二、清算结束日2022年11月09日基金净资产	27,764,388.33

资产处置及负债清偿后，2022年11月09日本基金剩余财产为人民币27,764,388.33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10月18日）至清算结束日（2022年11月09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11月10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) 《长盛同享灵活配置混合型证券投资基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 10 月 17 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<长盛同享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。

长盛同享灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2022年11月11日