

长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2022年11月23日

清算报告公告日：2022年12月1日

§ 1 重要提示

长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2017]2053号《关于准予长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，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2018年8月16日正式生效，首次设立募集基金份额为210,134,676.66份。本基金为契约型、定期开放式，存续期限不定期。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《长信价值蓝筹两年定期开放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，并在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；”

根据管理人于2022年11月3日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合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2022年11月1日表决通过了《关于终止长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合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。根据此次本基金基金份额持有人大会表决通过的前述议案，大会决议生效后，本基金管理人决定自2022年11月4日起安排5个工作日的赎回选择期，即2022年11月4日起至2022年11月10日止，在赎回选择期期间，投资人仅可以办理本基金的赎回业务，不可办理申购业务。本基金最后运作日为2022年11月10日，自2022年11月11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、基金托管人中国工商银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2022年11月11日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（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	长信价值蓝筹两年定开混合
基金主代码	005392
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018年8月16日
报告期末（2022年11月10日）基金份	5,830,942.61份

额总额		
投资目标	通过积极主动的资产管理，在严格控制基金资产风险的前提下，精选各个行业的优质企业进行投资，追求长期稳健的回报。	
投资策略	本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并追求稳健的绝对收益。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称：	长信价值蓝筹两年定开混合 A	长信价值蓝筹两年定开混合 C
下属分级基金的交易代码：	005392	009911
报告期末（2022 年 11 月 10 日）下属分级基金的份额总额	5,418,823.98 份	412,118.63 份

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2017]2053号《关于准予长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，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2018年8月16日正式生效，首次设立募集规模为210,134,676.66份基金份额。

因市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，本基金管理人根据《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，经与基金托管人中国工商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2022年9月30日0:00起至2022年10月31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《关于终止长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合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2022年11月1日表决通过了《关于终止长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合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2022年11月3日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信价值蓝筹两年定期开放灵活

配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，大会决议生效后，本基金管理人决定自2022年11月4日起安排5个工作日的赎回选择期，即2022年11月4日起至2022年11月10日止，在赎回选择期期间，投资人仅可以办理本基金的赎回业务，不可办理申购业务。本基金最后运作日为2022年11月10日，自2022年11月11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：长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

单位：人民币元

资产	清算结束日 2022年11月16日	最后运作日 2022年11月10日
资产：		
银行存款	5,256,670.37	11,846,461.58
结算备付金	1,260.20	1,260.20
存出保证金	154,520.09	154,478.51
资产总计	5,412,450.66	12,002,200.29
负债和净资产	清算结束日 2022年11月16日	最后运作日 2022年11月10日
负债：		
应付赎回款	-	6,383,528.62
应付管理人报酬	-	4,763.13
应付托管费	-	635.09
应付销售服务费	-	877.95
其他负债	98,048.00	98,000.00
负债合计	98,048.00	6,487,804.79
净资产：		
实收基金	5,617,311.21	5,830,942.61
未分配利润	-302,908.55	-316,547.11
净资产合计	5,314,402.66	5,514,395.50
负债和净资产总计	5,412,450.66	12,002,200.29

注：本基金最后运作日2022年11月10日，长信价值蓝筹两年定开混合A份额净值人民币0.9464元，基金份额总额5,418,823.98份；长信价值蓝筹两年定开混合C份额净值人民币0.9370元，基金份额总额412,118.63份；总份额合计5,830,942.61份。

4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

单位：人民币元

项目	2022年11月11日(清算开始日)至2022年11月16日(清算结束日)止期间
一、收入	
1、利息收入（注1）	419.99
其中：存款利息收入	419.99
二、费用	
1、其他费用（注2）	237.40
三、利润总额	182.59
减：所得税费用	-
四、净收益	182.59

注：1、利息收入系以当前适用利率预估计提的自2022年11月11日(清算开始日)至2022年11月16日(清算结束日)止期间的银行存款利息收入人民币378.41元和存出保证金利息收入人民币41.58元，共计人民币419.99元。

2、其他费用系自2022年11月11日(清算开始日)至2022年11月16日(清算结束日)止期间支付费用产生的汇划费人民币189.40元和预提的汇划费人民币48.00元。

3、本次清算期间产生的其他清算费用由本基金基金管理人承担。

§ 5 基金财产分配

自2022年11月11日至2022年11月16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 本基金最后运作日银行存款为人民币11,846,461.58元，其中活期存款人民币11,840,916.21元，应计活期存款利息人民币5,545.37元；上述活期存款在清算期支付了赎回款、管理费、托管费和销售服务费后，于清算结束日(2022年11月16日)银行存款为人民币5,256,670.37元，其中活期存款人民币5,250,746.59元，应计活期存款利息人民币5,923.78元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币1,260.20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0.00元，应计结算备付金利息人民币1,117.80元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金人民币0.00元，应计结算备付金利息人

民币142.40元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币154,478.51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存出保证金人民币96,715.36元，应计存出保证金利息人民币210.92元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金人民币57,375.37元，应计存出保证金利息人民币176.86元。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币6,383,528.62元，该款项已于2022年11月11日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币4,763.13元，该款项已于2022年11月15日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币635.09元，该款项已于2022年11月15日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币877.95元，该款项已于2022年11月15日支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币98,000.00元，其中预提清算审计费人民币15,000.00元，预提中债账户维护费人民币3,000.00元，预提信息披露费80,000.00元，上述款项将于2022年11月16日之后支付。

5.3 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2022年11月10日基金净资产	5,514,395.50
加：清算期间净收益	182.59
减：基金净赎回转出金额 (于2022年11月11日确认的投资者赎回转出申请)	200,175.43
二、2022年11月16日基金净资产	5,314,402.66

注：根据本基金的基金合同及基金管理人于2022年11月3日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合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。清算期结束日次日至清算款划出前一日的银行存款、存出保证金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，基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付上述未结息金额，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，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

资产处置及部分负债清偿后，本基金截至 2022 年 11 月 16 日止的净资产为人民币 5,314,402.66 元，其中长信价值蓝筹两年定开混合 A 资产净值为 5,128,147.58 元，长信价值蓝筹两年定开混合 C 资产净值为 186,255.08 元。

截至 2022 年 11 月 16 日止，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 5,250,746.59 元。

5.4 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、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告；
- 2、《长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见书。

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>。

长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2022 年 11 月 23 日