

长信合利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：2023年8月14日

清算报告公告日：2023年8月22日

§ 1 重要提示

长信合利混合型证券投资基金(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》、《长信合利混合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[2018]1808号文注册公开募集。本基金为契约型开放式基金,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228,884,553.15份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(19)第00011号验资报告。基金合同于2019年6月11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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金合同“第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”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;”

根据基金管理人于2023年8月2日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信合利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2023年7月31日表决通过了《关于终止长信合利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,本基金最后运作日为2023年8月2日,自2023年8月3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2023年8月3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	长信合利混合
基金主代码	005305
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年6月11日
报告期末(2023年8月2日)基金份额总额	1,281,741.12份
投资目标	本基金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,力争为投资者提供稳定增长的投资收

	益。	
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	中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，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	长信合利混合 A	长信合利混合 C
下属分级基金的交易代码	005305	005306
报告期末下属分级基金的份额总额	1,098,518.52 份	183,222.60 份

§ 3 基金运作情况概述

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”)以证监许可[2018]1808号文注册公开募集,基金合同于2019年6月11日正式生效,首次设立募集基金份额为228,884,553.15份。

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2023年7月6日0:00起至2023年7月30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《关于终止长信合利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2023年7月31日表决通过了《关于终止长信合利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2023年8月2日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信合利混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》,自2023年8月3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：长信合利混合型证券投资基金

单位：人民币元

资产	清算结束日 2023年8月8日	最后运作日 2023年8月2日
资产：		
银行存款	665,518.06	1,128,183.35
结算备付金	59,475.89	19,784.53
存出保证金	28,935.45	28,927.65
应收清算款	-	202,562.74
资产总计	753,929.40	1,379,458.27
负债和净资产	清算结束日 2023年8月8日	最后运作日 2023年8月2日
负债：		
应付赎回款	-	11,079.26
应付管理人报酬	-	71.52
应付托管费	-	14.30
应付销售服务费	-	6.22
应交税费	-	113.92
其他负债	60,000.00	60,001.57
负债合计	60,000.00	71,286.79
净资产：		
实收基金	678,505.24	1,281,741.12
未分配利润	15,424.16	26,430.36
净资产合计	693,929.40	1,308,171.48
负债和净资产总计	753,929.40	1,379,458.27

注：本基金最后运作日 2023 年 8 月 2 日，长信合利混合 A 份额净值人民币 1.0184 元，长信合利混合 C 份额净值人民币 1.0340 元，基金份额总额为 1,281,741.12 份，其中长信合利混合 A 份额 1,098,518.52 份，长信合利混合 C 份额 183,222.60 份。

4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信合利混合型证券投资基金

清算损益表

单位：人民币元

项目	2023年8月3日
----	-----------

	(清算开始日)至 2023年8月8日 (清算结束日)止期间
一、 收入	117.96
1、利息收入(注1)	82.25
其中:存款利息收入	82.25
2、投资收益(损失以“-”填列)	-
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-
4、其他收入(损失以“-”填列)(注2)	35.71
二、 费用	29.00
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、销售服务费	-
4、税金及附加	-
5、其他费用(注3)	29.00
三、 利润总额	88.96
减:所得税费用	-
四、 净收益	88.96

注:1、利息收入系以当前适用利率预估计提的自2023年8月3日(清算开始日)至2023年8月8日(清算结束日)止期间的银行存款利息收入人民币69.23元、结算备付金利息收入人民币5.22元和存出保证金利息收入人民币7.80元,共计人民币82.25元。

2、其他收入系2023年8月2日的赎回申请,于2023年8月3日的赎回确认后产生的基金赎回费收入共计人民币35.71元。

3、其他费用系自2023年8月3日(清算开始日)至2023年8月8日(清算结束日)止期间支付费用产生的汇划费,共计人民币29.00元。

4、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2023年8月3日至2023年8月8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1,128,183.35元,其中活期存款人民币1,127,746.11元,应计活期存款利息人民币437.24元;上述活期存款在清算期支付了赎回款、管

理费、托管费、销售服务费和增值税及其附加税、调整了最低结算备付金及存出保证金后,于清算结束日(2023年8月8日)银行存款为人民币665,518.06元,其中活期存款人民币665,011.59元,应计活期存款利息人民币506.47元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币19,784.53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17,613.10元,应计结算备付金利息人民币325.59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1,843.62元,应计结算备付金利息人民币2.22元。上述结算备付金于2023年8月8日根据中国结算业务规则进行调整后,于清算结束日(2023年8月8日)结算备付金为人民币59,475.89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59,142.86元,应计结算备付金利息人民币330.33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已划入托管户,应计结算备付金利息人民币2.70元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币28,927.65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10,565.67元,应计存出保证金利息人民币34.51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18,274.59元,应计存出保证金利息人民币52.88元。上述存出保证金于清算结束日(2023年8月8日)存出保证金为人民币28,935.45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10,565.67元,应计存出保证金利息人民币37.39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18,274.59元,应计存出保证金利息人民币57.80元。

5.1.4 本基金最后运作日应收清算款为人民币202,562.74元,该款项已于2023年8月3日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币11,079.26元,该款项已于2023年8月4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71.52元,该款项已于2023年8月3日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币14.30元,该款项已于2023年8月3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6.22元,该款项已于2023年8月3日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应交税费为人民币113.92元,该款项已于2023年8月3日支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债为人民币60,001.57元,其中应付赎回费为人民币1.57元,该款项已于2023年8月4日支付;预提清算审计费人民币15,000.00元,预提信息披露费45,000.00

元，上述款项将于2023年8月8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（2023年8月2日）基金净资产	1,308,171.48
加：清算期间净收益	88.96
减：基金净赎回转出金额 （于2023年8月3日确认的投资者净赎回转出申请）	614,331.04
二、2023年8月8日基金净资产	693,929.40

注：根据本基金的基金合同及基金管理人于2023年8月2日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信合利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。清算结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金及存出保证金孳生的利息归基金份额持有人所有。

截至2023年8月8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665,011.59元。

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、结算备付金及存出保证金，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2023年8月8日止的净资产为人民币693,929.40元，其中长信合利混合A资产净值为504,160.97元，长信合利混合C资产净值为189,768.43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、长信合利混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告；

2、《长信合利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>。

长信合利混合型证券投资基金财产清算小组

2023年8月22日