

# 长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 第二次清算报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：徽商银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年9月9日

清算报告公告日：2019年9月26日

## 一、重要提示

长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“长盛盛鑫”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会《关于准予长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕2119号）和中国证监会证券投资基金机构监管部《关于长盛盛鑫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〕859号）准予募集，并于2016年7月13日成立并正式运作，基金托管人为徽商银行股份有限公司（以下简称“徽商银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）和《长盛盛鑫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》”）的有关规定，长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人徽商银行协商一致，由基金管理人召集，本基金基金份额持有人大会于2018年9月24日至2018年10月26日以通讯方式召开，并于2018年10月29日对本次基金份额持有人大会投票进行计票，大会审议通过了《关于终止长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，决定终止《基金合同》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。基金管理人于2018年10月30日在指定媒介和基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上发布了《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金自2018年10月30日起进入清算期，由基金管理人长盛基金管理有限公司、基金托管人徽商银行、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2018年10月30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。自2018年10月30日至2018年11月16日为本基金第一次清算期，基金管理人于2018年12月6日在指定媒介和基金管理人网站公告了《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金清算报告》，自2018年11月17日至2019年9月9日为本基金第二次清算期。

## 二、基金概况

1、基金名称：长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：长盛盛鑫混合。A类基金份额，基金代码：002089；C类基金份额，基金代码：002090）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2016年7月13日

4、2018年10月29日（基金最后运作日）基金份额总额：3,567,991.40份，其中A类基金份额3,227,272.86份，C类基金份额340,718.54份。

5、投资目标：通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在有效控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。

6、投资策略：本基金的投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。围绕着这三个层次的投资策略，基金管理人还将充分运用市场上各种金融投资工具，结合投资策略的需要，通过合理有效的金融模型分析，积极发掘低风险投资机会和锁定套利收益。

7、业绩比较基准： $50\% * \text{沪深300 指数收益率} + 50\% * \text{中证综合债指数收益率}$ 。

8、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。

9、基金管理人：长盛基金管理有限公司

10、基金托管人：徽商银行股份有限公司

### 三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕2119号）和中国证监会证券基金机构监管部《关于长盛盛鑫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〕859号）准予募集，由基金管理人于2016年7月8日至2016年7月11日向社会公开发行募集，《基金合同》于2016年7月13日正式生效，首次设立募集规模为200,797,066.85份基金份额（含利息结转份额）。自2016年7月13日至2018年10月29日期间，本基金按《基金合同》正常运作。

根据《基金法》《运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，本基金基金份

额持有人大会以通讯方式于2018年9月24日至2018年10月26日召开，并于2018年10月29日对本次持有人大会投票进行了统计，大会审议并通过了《关于终止长盛盛鑫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决议自该日起生效。基金管理人于2018年10月30日在指定媒介和基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上发布了《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金自2018年10月30日起进入清算期，自2018年10月30日至2018年11月16日为本基金第一次清算期，基金管理人于2018年12月6日发布《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金清算报告》，自2018年11月17日至2019年9月9日为本基金第二次清算期。

#### 四、财务会计报告

清算资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金

单位：人民币元

	二次清算结束日 (2019年9月9日)	一次清算结束日 (2018年11月16日)
<b>资产：</b>		
银行存款	1,511,369.39	2,173,213.61
结算备付金	0.00	115,000.00
结算保证金	58.69	0.00
交易性金融资产	0.00	1,614,344.11
其中：股票投资	0.00	1,614,344.11
应收利息	2,337.88	2,404.10
资产总计	1,513,765.96	3,904,961.82
<b>负债和所有者权益</b>		
<b>负 债：</b>		

应付交易费用	0.00	775.00
负债合计	0.00	775.00
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	3,568,065.19	3,568,065.19
未分配利润	-2,054,299.23	336,121.63
所有者权益合计	1,513,765.96	3,904,186.82
负债和所有者权益总计	1,513,765.96	3,904,961.82

## 五、清算事项说明

根据《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金清算报告》，本基金自2018年10月30日（清算起始日）起进入清算程序。

由于本基金最后运作日（2018年10月29日）持有的部分股票因停牌无法确定变现时间，本基金进行了两次清算，其中第一次清算期间为2018年10月30日至2018年11月16日，清算报告出具日为2018年11月16日，清算报告公告日为2018年12月6日。

本次清算为本基金第二次清算，清算期间为2018年11月17日至2019年9月9日。

## 六、清算情况

本基金第一次清算期间为2018年10月30日至2018年11月16日，自2018年11月17日至2019年9月9日为本基金第二次清算期，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，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

### 2、资产处置情况

(1) 截至本基金一次清算期结束日2018年11月16日结算备付金为人民币115,000.00元, 2018年12月4日划回结算备付金人民币115,000.00元至托管户, 结算备付金余额为0元。截至本次清算期结束日2019年9月9日结算保证金为人民币58.69元, 该款项由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管户, 基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(2) 截至本基金一次清算期结束日2018年11月16日应收利息为人民币2,404.10元, 清算期间应收利息增加8,446.89元, 银行结息转出8,513.11元, 截至本次清算期结束日2019年9月9日应收利息为人民币2,337.88元。该款项由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管户, 基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(3) 截至本基金一次清算结束日2018年11月16日, 本基金持有的因停牌而未变现的交易性金融资产估值总额为人民币1,614,344.11元, 明细如下:

金额单位: 人民币元

股票名称	股票代码	一次清算期结束日 估值单价	数量(股)	一次清算期结 束日 估值总额
*ST信威	600485	6.21	20,441	126,938.61
中天金融	000540	2.59	277,350	718,336.50
上海莱士	002252	12.67	60,700	769,069.00
合计				1,614,344.11

以上交易性金融资产分别于2018年12月19日、2019年1月4日、2019年8月23日处置, 实际清算金额合计为人民币1,501,965.32元, 已划入托管户。

### 3、负债清偿情况

截至本基金一次清算结束日2018年11月16日, 本基金应付交易费用775.00元, 为应付中国外汇交易中心交易手续费, 已于二次清算期内支付。

### 4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2018年11月17日 至2019年9月9日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
1、利息收入（注1）	8,446.54
2、处置交易性金融资产产生的净损益（注2）	-112,378.79
清算期间收益小计	-103,932.25
二、清算期间费用	-
三、清算期间净损益	-103,932.25

注1:利息收入系计提的自2018年11月17日至2019年9月9日止二次清算期间的银行存款利息和结算备付金利息。

注2:处置交易性金融资产产生的净损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交易费用后的差额。

#### 5、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、一次清算结束日2018年11月16日基金净资产	3,904,186.82
加：二次清算期间净损益	-103,932.25
减：划付一次清算金额	-2,286,488.61
二、二次清算结束日2019年9月9日账面基金净资产	1,513,765.96
减：基金管理人垫付一次清算款产生的利息收入	-
三、二次清算结束日2019年9月9日实际归属投资人的基金净资产	1,513,765.96

截至本次清算期结束日2019年9月9日，本基金剩余财产为人民币1,513,765.96元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组将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财产扣除基金财产清算费用（本基金的清算费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付）、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。

自本次清算期结束日次日（2019年9月10日）至本次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。以上利息均按实际适用的利率计算，由基金管理人以自有资金垫付并将于清算款划出前划入托管户，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

#### 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。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时对本基金剩余财产进行分配。

#### 七、其他说明事项

一次清算结束日次日至一次清算款划出日前一日及二次清算结束日次日至二次清算款划出日前一日的银行存款产生的利息均归基金份额持有人所有，期间的应收利息以实际适用的利率按日计算，结息金额以银行存款账户中属于基金份额持有人的实际结息金额为准。

二次清算期间为提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人拟将使用自有资金再次对应收利息中未结息部分进行垫付，基金管理人垫付资金需在相关机构实际划款后方能收回，由基金托管人扣除银行手续费等费用后偿付基金管理人垫付的资金。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

#### 八、备查文件

##### 1、备查文件目录

（1）长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金2018年10月30日(基金最后运作日次日)至2019年9月9日(基金第二次清算结束日)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<长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金第二次清算报告>之法律意见》

##### 2、存放地点



基金管理人的办公场所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2019年9月9日