

长盛价值发现股票型证券投资基金 清算报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2021年2月3日

清算报告公告日期：2021年2月5日

一、重要提示

长盛价值发现股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1503号文注册，并经2019年10月29日证监许可（2019）2088号文准予变更注册后募集，于2020年4月15日成立并正式运作，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

根据《长盛价值发现股票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”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50个工作日出现上述情形的，直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”截至2021年1月20日日终，本基金已连续50个工作日出现基金资产净值低于5,000万元，触发上述《基金合同》终止条款。为保护投资者利益，根据《基金合同》约定，基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”）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终止事由后依法履行基金财产清算程序。本基金管理人确定2021年1月20日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2021年1月21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2021年1月21日刊登在《证券时报》和本基金管理人网站（www.csfund.com.cn）上的《长盛基金管理有限公司关于长盛价值发现股票型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自2021年1月21日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人工商银行、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2021年1月21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	长盛价值发现股票型证券投资基金
基金简称	长盛价值发现
基金代码	008410
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年4月15日
基金最后运作日(2021年1月20日)基金份额总额	11,100,465.00份
投资目标	本基金通过定量分析方法精选质地优秀的上市公司，多维度发掘其中具有投资价值的股票构建投资组合，在控制风险的前提下，争取为投资者创造超越业绩基准的投资收益。
投资策略	<p>(一) 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，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，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>(二) 股票投资策略：本基金在综合分析国内外宏观经济市场形势、微观经济指标及货币财政政策的基础上，动态配置大类资产，在股票投资方面主要采用自下而上的个股精选方式，综合企业的垄断经营能力、核心技术优势、品牌效应、商业模式、持续盈利能力、产业发展前景、行业景气度等多个维度进行深入的案头研究，从成长型企业投资价值发现、低估值企业投资价值发现以及基于事件驱动的价值发现三个层面筛选具有投资价值的股票构建投资组合。</p> <p>(三) 债券投资策略：本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、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	中国工商银行股份有限公司
基金合同存续期	不定期

三、基金运作情况概述

长盛价值发现股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可〔2018〕1503号文注册，并经2019年10月29日证监许可〔2019〕2088号文准予变更注册后募集，于2020年4月15日成立并正式运作，首次设立募集规模为235,997,860.33份基金份额（含利息结转份额）。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”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50个工作日出现上述情形的，直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

截至2021年1月20日日终，本基金已连续50个工作日出现基金资产净值低于5,000万元，触发上述《基金合同》终止条款。为保护投资者利益，根据《基金合同》约定，基金管理人长盛基金决定终止《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终止事由后依法履行基金财产清算程序。本基金管理人确定2021年1月20日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一工作日（即2021年1月21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（2020年4月15日）至最后运作日（2021年1月20日）期间，本基金正常运作。

四、财务会计报告

长盛价值发现股票型证券投资基金

2021年1月20日(基金最后运作日)

资产负债表

单位：人民币元

	2021年1月20日 (基金最后运作日)
资产	
银行存款	2,276,749.42
结算备付金	49,859.98
存出保证金	21,140.38
交易性金融资产	11,664,313.00
其中：股票投资	11,664,313.00
应收证券清算款	582,864.74
应收利息	646.38
应收申购款	5,183.73
资产总计	14,600,757.63
负债	
应付赎回款	44,132.15
应付管理人报酬	13,987.06
应付托管费	2,331.17
应付交易费用	10,911.81
其他负债	50.73
负债合计	71,412.92
所有者权益	
实收基金	11,100,465.00
未分配利润	3,428,879.71
所有者权益合计	14,529,344.71
负债和所有者权益总计	14,600,757.63

注：报告截止日2021年1月20日(基金最后运作日)，基金份额净值1.3089元，基金份额总额11,100,465.00份。

长盛价值发现股票型证券投资基金

2020年4月15日(基金合同生效日)至2021年1月20日(基金最后运作日)止期间
 利润表

单位：人民币元

	2020年4月15日 (基金合同生效日) 至2021年1月20日 (基金最后运作日)止期间
收入	
利息收入	260,465.98
其中：存款利息收入	99,810.15
债券利息收入	17.09
买入返售金融资产利息收入	160,638.74
投资收益(损失以“-”填列)	14,508,019.11
其中：股票投资收益	13,711,061.95
债券投资收益	22,177.29
股利收益	774,779.87
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	1,677,418.28
其他收入	1,264,777.43
收入合计	17,710,680.80
费用	
管理人报酬	778,224.89
托管费	129,704.08
交易费用	751,482.02
税金及附加	0.07
其他费用	65,991.51
费用合计	1,725,402.57
利润总额(亏损总额以“-”号填列)	15,985,278.23
减：所得税费用	-
净利润(净亏损以“-”号填列)	15,985,278.23

长盛价值发现股票型证券投资基金

2020年4月15日(基金合同生效日)至2021年1月20日(基金最后运作日)止期间

所有者权益(基金净值)变动表

单位：人民币元

	2020年4月15日(基金合同生效日)至 2021年1月20日(基金最后运作日)止期间		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	235,997,860.33	-	235,997,860.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,985,278.23	15,985,278.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-224,897,395.33	-12,556,398.52	-237,453,793.85
其中：基金申购数	55,724,218.59	6,732,869.11	62,457,087.70
基金赎回款	-280,621,613.92	-19,289,267.63	-299,910,881.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	11,100,465.00	3,428,879.71	14,529,344.71

五、清算情况

自2021年1月21日至2021年2月3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,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) 本基金最后运作日结算备付金人民币49,859.98元,2021年2月2日中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户人民币25,998.69元,余额为23,861.29元。

该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司以自有资金垫付。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) 本基金最后运作日存出保证金人民币21,140.38元,2021年2月2日中国证券登记结算有限责任公司划入托管账户人民币6,807.94元,余额为14,332.44元。该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司以自有资金垫付。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。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币582,864.74元,于2021年1月21日与中国证券登记结算有限责任公司完成交收。

(4) 本基金最后运作日应收利息为人民币646.38元,分别为应收银行存款利息、应收结算备付金利息和应收存出保证金利息。该款项由基金管理人在清算款划出前以自有资金垫付至托管账户,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。

(5) 本基金最后运作日应收申购款人民币5,183.73元及2021年1月21日确认的应收申购款人民币2,805.83元,已于2021年1月22日前划入本基金托管账户。

(6) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币11,664,313.00元,其中股票投资人民币11,664,313.00元,于2021年1月21日前处置变现,处置损益人民币1,816,329.38元,变现产生的证券清算款为人民币11,790,373.85元,已于2021年1月22日前划入托管账户。交易费用为人民币23,842.39元,含应付佣金人民币10,992.14元,已在清算期内支付。股票明细如下:

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	最后运作日估值单价	数量(单位:股)	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
600036	招商银行	51.72	5,000	256,000.00	258,600.00
600346	恒力石化	38.85	20,000	623,674.00	777,000.00
600519	贵州茅台	2,040.63	500	862,437.00	1,020,315.00
601012	隆基股份	108.31	8,000	617,923.00	866,480.00
000001	平安银行	22.47	10,000	214,681.00	224,700.00
000157	中联重科	11.32	50,000	527,750.00	566,000.00

000333	美的集团	96.28	7,000	642,511.00	673,960.00
000858	五粮液	284.85	2,000	519,855.00	569,700.00
002352	顺丰控股	93.99	12,000	1,008,240.00	1,127,880.00
002475	立讯精密	56.21	13,000	732,809.00	730,730.00
002531	天顺风能	7.95	15,000	135,488.00	119,250.00
002594	比亚迪	222.00	4,000	721,325.78	888,000.00
300012	华测检测	26.86	30,000	798,332.14	805,800.00
300014	亿纬锂能	104.23	2,600	219,250.00	270,998.00
300244	迪安诊断	39.49	6,000	211,408.00	236,940.00
300285	国瓷材料	44.36	15,000	567,295.80	665,400.00
300450	先导智能	91.05	6,000	440,204.00	546,300.00
300750	宁德时代	391.40	2,000	413,320.00	782,800.00
300760	迈瑞医疗	444.55	1,200	474,391.00	533,460.00
合计				9,986,894.72	11,664,313.00

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款人民币44,132.15元，应付赎回费人民币50.73元及2021年1月21日确认的应付赎回款人民币95,474元，应付赎回费人民币207.58元已于2021年1月25日前支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币13,987.06元、应付托管费为人民币2,331.17元，该款项已于清算期内支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币10,911.81元，清算期间处置交易性金融资产产生的应付佣金人民币10,992.14元，共计21,903.95元，该款项已于清算期内支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年1月21日 至2021年2月3日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	1,791.61

处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	138,911.10
清算期间收益小计	140,702.71
二、清算期间支出	
银行划款费	75.00
交易费用	23,842.39
清算费用（注3）	-
清算期间支出小计	23,917.39
三、清算期间净损益	116,785.32

注1：利息收入系计提的2021年1月21日至2021年2月3日止清算期间的银行存款利息、结算备付金及存出保证金利息。

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的股票估值总额及交易费用后的差额。

注3：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。

5、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2021年1月20日基金净资产	14,529,344.71
加：清算期间净收益	116,785.32
减：基金净赎回金额（于2021年1月21日确认的投资者申购、赎回申请）	-51,112.29
二、2021年2月3日基金净资产	14,595,017.74

资产处置及负债清偿后，于2021年2月3日本基金剩余财产为人民币14,595,017.74元，根据本基金的基金合同约定，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。

清算起始日2021年1月21日至清算款划出日前一日的应收利息亦属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) 《长盛价值发现股票型证券投资基金 2020 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2021 年 1 月 20 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价值发现股票型证券投资基金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。

长盛价值发现股票型证券投资基金基金财产清算小组

2021年2月3日