

长盛盛杰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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2021年9月22日

清算报告公告日期：2021年9月27日

一、重要提示

长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金于2017年1月10日获中国证监会证监许可[2017]50号文注册募集，于2017年5月2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”）。长盛盛杰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金变更注册而来。本基金的变更已经中国证监会2019年11月18日证监许可[2019]2380号文准予变更注册，并经长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会2020年7月23日表决通过。自2020年7月24日起，变更后的《长盛盛杰混合型证券投资基金基金合同》生效，原《长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金合同》同日失效。

根据《长盛盛杰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”中“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”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个工作日出现前述情形的，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8月30日日终，本基金已连续50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《基金合同》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8月30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8月31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8月31日刊登在《上海证券报》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盛杰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》。

本基金自2021年8月31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）和上海源泰律师事务所于2021

年8月31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,上海源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	长盛盛杰混合型证券投资基金
基金简称	长盛盛杰混合
基金代码	A类: 009850 C类: 004466
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年7月24日
基金最后运作日（2021年8月30日）基金份额总额	7,144,558.17份
投资目标	通过优化的资产配置,前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会,在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<p>（一）大类资产配置</p> <p>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</p> <p>在股票投资方面,本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面,运用基金管理人的研究平台和股票估值体系,深入发掘股票内在价值,结合市场估值水平和股市投资环境,充分考虑行业景气程度、企业竞争优势等因素,有效识别并防范风险,以获取较好收益。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>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> <p>本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长</p>

	期稳定收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*15%+中证综合债指数收益率*85%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、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

长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金于2017年1月10日获中国证监会证监许可[2017]50号文注册募集，于2017年5月2日成立并正式运作，首次设立募集规模为362,274,064.11份基金份额（含利息结转份额）。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”）。长盛盛杰混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金变更注册而来。本基金的变更已经中国证监会2019年11月18日证监许可[2019]2380号文准予变更注册，并经长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会2020年7月23日表决通过。自2020年7月24日起，变更后的《长盛盛杰混合型证券投资基金基金合同》生效，原《长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金合同》同日失效。

根据《基金合同》“第五部分 基金的存续”中“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”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个工作日出现前述情形的，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8月30日日终，本基金已连续50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《基金合同》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8月30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8月31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至最后运作日期间，本基金正常运作。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛盛杰混合型证券投资基金

报告截止日：2021年8月30日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2021年8月30日
资产：	
银行存款	16,702,208.23
结算备付金	121,560.64
存出保证金	9,047.00
交易性金融资产	1,363,825.80
其中：债券投资	1,363,825.80
应收证券清算款	3,147,526.69
应收利息	15,034.66
应收申购款	3,110.00
资产总计	21,362,313.02
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	12,042,655.54
应付管理人报酬	14,035.34
应付托管费	3,508.83
应付销售服务费	1,717.85
应付交易费用	23,021.66
应交税费	195.35
其他负债	89,241.58
负债合计	12,174,376.15

所有者权益：	
实收基金	7,144,558.17
未分配利润	2,043,378.70
所有者权益合计	9,187,936.87
负债和所有者权益总计	21,362,313.02

注：报告截止日2021年8月30日(基金最后运作日)，长盛盛杰混合型证券投资基金基金份额总额为7,144,558.17份，其中长盛盛杰混合型证券投资基金A类基金份额净值1.2864元，基金份额39,905.72份；长盛盛杰混合型证券投资基金C类基金份额净值1.2860元，基金份额7,104,652.45份。

五、清算情况

自2021年8月31日至2021年9月22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，本基金清算费用中律师费部分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) 本基金最后运作日应收利息人民币15,034.66元，其中应收银行存款利息为人民币1,291.01元，应收结算备付金利息为人民币583.78元，应收存出保证金利息为人民币28.44元，应收债券利息为人民币13,131.43元。应收债券利息已于清算期内随同债券资产处置变现，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于2021年9月21日结息后，余额共计为168.69元。该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人将于本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) 本基金最后运作日结算备付金人民币121,560.64元，2021年9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74,555.62元，余额为人民币47,005.02元。该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人将于本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。

(3) 本基金最后运作日存出保证金人民币9,047.00元，2021年9月2日从托管账户划入中国证券登记结算有限责任公司人民币1,237.67元，余额为10,284.67元。该款项由基金管理人长盛基金管理有限公司在清算款划出前以自有资金垫付至本基金托管账户，基金管理人将于本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。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币1,363,825.80元，全部为债券投资，明细如下：

单位：人民币元

交易平台	债券名称	债券代码	最后运作日 估值单价	数量 (单位:张)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额	最后运作日 应收利息
上交所	长久转债	113519	104.62	5090	517,394.80	532,515.80	3,313.38
上交所	天合转债	118002	100.00	180	18,000.00	18,000.00	2.13
上交所	18中油EB	132015	102.87	3000	309,387.05	308,610.00	1,942.36
上交所	国开1702	018006	100.94	5000	508,441.36	504,700.00	7,873.56
合计					1,353,223.21	1,363,825.80	13,131.43

以上债券资产已于清算期间内处置变现，处置损益人民币13,902.17元，交易费用人民币1.33元，清算期债券利息收入人民币74.87元，变现产生的证券清算款为人民币1,390,932.94元，已于清算期间内划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币3,147,526.69元，该款项已于2021年8月31日划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收申购款为人民币3,110.00元，于2021年8月30日提出申请并于2021年8月31日确认的基金申购及转入款为319.99元，上述款项已划付至本基金托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币12,042,655.54元，于2021年8月30日提出申请并于2021年8月31日确认的基金赎回及转出金额为820,381.52元，该款项已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币14,035.34元、应付托管费人民币3,508.83元、应付销售服务费人民币1,717.85元、应付交易费用人民币23,021.66元已于清算期间内支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币89,241.58元，其中，应付赎回费0.02元已于清算期间内支付；预提信息披露费为人民币53,041.56元，经与报社协商将按50,000.00元结算，于完成相关支付流程后支付，多预提的3,041.56元已于清算期间内冲回至基金剩余资产；审计费为人民币30,000.00元，该款项将于完成相关支付流程后支付；账户维护费为人民币6,200.00元，该款项已于清算期间内支付。

(7) 本基金最后运作日应交税费为人民币195.35元，该款项将于税务局指定时间支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年8月31日 至2021年9月22日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	3,162.84
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	13,902.17
信息披露费冲回	3,041.56
清算期间收益小计	20,106.57
二、清算期间支出	
银行划款费	521.00
债券交易费用	1.33
补缴股息红利税	112.60
清算期间支出小计	634.93
三、清算期间净收益	19,471.64

注1：利息收入系计提的2021年8月31日至2021年9月22日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息、债券利息和回购利息。

注2: 处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出债券成交金额减去卖出债券最后运作日估值总额和截至变现日应收债券利息后的差额。

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8月30日基金净资产	9,187,936.87
加：清算期间净收益	19,471.64
减：基金净赎回金额（于2021年8月31日确认的投资者申购、赎回申请）	820,061.53
二、2021年9月22日基金净资产	8,387,346.98

资产处置及负债清偿后，于2021年9月22日本基金剩余财产为人民币8,387,346.98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。

自清算起始日（2021年8月31日）至清算结束日（2021年9月22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（2021年9月23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）《长盛盛杰混合型证券投资基金清算审计报告》

(2)《上海源泰律师事务所关于长盛盛杰混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》

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。

长盛盛杰混合型证券投资基金基金财产清算小组

2021年9月27日