

# 长盛多因子策略优选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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022年8月1日

清算报告公告日期：2022年8月5日

## 一、重要提示

长盛多因子策略优选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）2018年8月9日经中国证券监督管理委员会《关于准予长盛多因子策略优选股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】1287号）注册募集，于2018年11月23日成立并正式运作，基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《长盛多因子策略优选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”中“三、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60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。”截至2022年7月13日日终，本基金已连续60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2022年7月13日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2022年7月14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2022年7月14日刊登在《中国证券报》和本基金管理人网站（[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)）上的《长盛基金管理有限公司关于长盛多因子策略优选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》。

本基金最后运作日为2022年7月13日，自2022年7月14日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国银行、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所于2022年7月14日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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	长盛多因子策略优选股票型证券投资基金
基金简称	长盛多因子股票
基金代码	006478
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月23日
基金最后运作日（2022年7月13日）基金份额总额	4,671,823.05份
投资目标	本基金利用数量化分析方法，基于多因子量化模型，动态优选强势因子策略构建投资组合，满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	<p>本基金将充分发挥基金管理人的投资研究优势，运用科学严谨、规范化的资产配置方法，基于多因子量化模型，多维度监控市场投资机会，动态优选契合市场风格的投资策略，谋求基金资产的长期稳定增长。（一）大类资产配置策略</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>本基金以多因子模型为基础框架，构建多种因子组合，实时监控各组合的表现情况，优选表现强势的因子组合进行投资；并根据风险约束、交易成本、投资限制等情况的需要进行优化。</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>
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	中国银行股份有限公司

### 三、基金运作情况概述

长盛多因子策略优选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）2018年8月9日经中国证券监督管理委员会《关于准予长盛多因子策略优选股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】1287号）注册募集，于2018年11月23日成立并正式运作，基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、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60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。”

截至2022年7月13日日终，本基金已连续60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2022年7月13日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2022年7月14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：长盛多因子策略优选股票型证券投资基金

报告截止日：2022年7月13日（基金最后运作日）

科目名称	最后运作日 (2022年7月13日)
<b>资 产:</b>	
银行存款	1,706,455.55
结算备付金	43,507.06
存出保证金	38,486.72

交易性金融资产	5,076,976.29
应收证券清算款	857,563.99
资产总计	7,722,989.61
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负 债:</b>	
应付赎回款	1,280,449.85
应付管理人报酬	14,131.65
应付托管费	2,355.25
其他负债	98,650.39
负债合计	1,395,587.14
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	4,671,823.05
未分配利润	1,655,579.42
所有者权益合计	6,327,402.47
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>7,722,989.61</b>

注：截至2022年7月13日(基金最后运作日)，基金份额净值1.3544元，基金份额总额4,671,823.05份。

## 五、清算情况

自2022年7月14日至2022年8月1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) 本基金最后运作日银行存款为人民币1,706,455.55元，其中应计利息为人民币1,776.58元。清算期间银行存款变动金额为人民币4,481,796.00元，产生的计提利息为人民币1,066.67元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币6,188,251.55元，其中银行存款利息余额为人民币2,843.25元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币43,507.06元, 其中上海结算备付金为人民币38,432.19元, 深圳结算备付金为人民币4,995.18元, 应计利息共计人民币79.69元。截至清算期结束日, 结算备付金余额为人民币43,544.11元, 其中结算备付金利息余额为人民币116.74元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币38,486.72元, 其中上海存出保证金为人民币17,055.75元, 深圳存出保证金为人民币21,386.80元, 应计利息共计人民币44.17元。截至清算期结束日, 存出保证金余额为人民币38,519.59元, 其中存出保证金利息余额为人民币77.04元。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币857,563.99元, 该款项已于清算期间内划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币5,076,976.29元, 全部为股票投资, 于清算期间内处置变现, 处置损益为人民币-59,739.17元, 产生的交易费用为人民币9,108.23元。

股票明细如下:

金额单位: 人民币元

序号	股票名称	股票代码	数量 (股)	最后运作日估值单价	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额
1	江苏银行	600919	76,100.00	6.96	517,609.95	529,656.00
2	渝农商行	601077	138,700.00	3.65	550,879.73	506,255.00
3	华电国际	600027	99,300.00	4.94	461,165.42	490,542.00
4	国电电力	600795	111,200.00	4.39	460,792.40	488,168.00
5	浙能电力	600023	126,200.00	3.86	463,985.56	487,132.00
6	华能水电	600025	64,400.00	7.41	469,204.62	477,204.00
7	成都银行	601838	28,500.00	16.05	470,536.73	457,425.00
8	长江电力	600900	16,700.00	24.97	400,476.74	416,999.00
9	中国石油	601857	69,400.00	5.09	387,252.00	353,246.00
10	中国能建	601868	76,800.00	2.42	214,144.00	185,856.00
11	中国电建	601669	23,080.00	7.92	213,297.99	182,793.60
12	北京银行	601169	36,600.00	4.52	170,948.72	165,432.00
13	光大银行	601818	52,300.00	2.95	177,540.21	154,285.00
14	长沙银行	601577	18,000.00	7.68	141,038.21	138,240.00

15	天新药业	603235	321.00	47.8	11,838.48	15,343.80
16	益客食品	301116	433.00	18.48	4,936.20	8,001.84
17	诚达药业	301201	91.00	69.91	6,614.79	6,361.81
18	铜冠铜箔	301217	400.00	13.69	6,908.00	5,476.00
19	德石股份	301158	262.00	19.32	4,097.68	5,061.84
20	宝立食品	603170	348.00	10.05	3,497.40	3,497.40

### 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1,280,449.85元，应付管理人报酬为人民币14,131.65元，应付托管费为人民币2,355.25元，上述款项已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币98,650.39元，其中应付赎回费人民币1,044.14元和应付交易费用人民币36,127.25元已于清算期间内支付；预提2022年度信息披露费人民币61,479.00元将于完成付款流程后支付。

### 4、清算期间的清算损益情况

项目	自2022年7月14日 至2022年8月1日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	1,136.59
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	-59,739.17
清算期间收益小计	-58,602.58
二、清算期间支出	
银行划款费	96.62
股票交易费用	9,108.23
清算费用（注3）	0.00
清算期间支出小计	9,204.85
三、清算期间净收益	-67,807.43

注1：利息收入系计提的2022年7月14日至2022年8月1日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

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估值总额和股息红利税后的差额。

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

项目	金额
一、最后运作日2022年7月13日基金净资产	6,327,402.47
加：清算期间净收益	-67,807.43
减：基金净赎回金额（于2022年7月14日确认的投资者赎回、转出申请）	50,758.79
二、清算结束日2022年8月1日基金净资产	6,208,836.25

资产处置及负债清偿后，于2022年8月1日本基金剩余财产为人民币6,208,836.25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（2022年7月14日）至清算结束日（2022年8月1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（2022年8月2日）至清算款划出前一日期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）《长盛多因子策略优选股票型证券投资基金清算审计报告》；
- （2）《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛多因子策略优选股票型证券投资基金清算报告>之法律意见》。

### 2、存放地点

存放于基金管理人的办公地址。



### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内到基金管理人的办公地址免费查阅。

长盛多因子策略优选股票型证券投资基金基金财产清算小组

2022年8月5日