

长盛精选行业轮动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：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日期：2023年3月28日

清算报告公告日期：2023年4月4日

一、重要提示

长盛精选行业轮动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2022年1月21日《关于准予长盛精选行业轮动混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2022〕192号文）注册募集，于2022年9月6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”），基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

根据《长盛精选行业轮动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50个工作日出现前述情形的，可直接终止《基金合同》，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2023年3月10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，已触发《基金合同》中约定的上述《基金合同》终止条款。本基金于2023年3月11日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2023年3月11日刊登在《证券时报》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精选行业轮动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》。

本基金最后运作日为2023年3月10日，自2023年3月11日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国农业银行、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2023年3月11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	长盛精选行业轮动混合型证券投资基金
基金简称	长盛精选行业轮动混合

基金代码	A类：015112 C类：015113
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年9月6日
基金最后运作日（2023年3月10日）基金份额总额	16,683,251.08份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过把握行业或主题轮换规律，动态调整权益资产在不同行业及主题之间的配置比例，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将通过宏观、微观经济指标，市场指标，政策因素等，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>本基金通过精选行业和行业轮动相结合的策略确定组合的行业配置，首先，精选行业策略是以宏观经济、产业投入情况和行业基本面分析为基础，精选景气度高或者趋势向好的行业；其次，行业轮动策略是通过深度挖掘经济周期规律，产业链上中下游传导机制等，对精选出的优势行业进行梯次权重配置，并动态监测宏观行业基本面、量化层面和技术层面三大指标体系的变化，及时调整行业间的权重配置，从而获得行业轮动效应的超额收益。</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>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略。</p> <p>本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股指期货、国债期货、股票期权交易。</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率×70%+人民币计价的恒生综合指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

长盛精选行业轮动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会2022年1月21日《关于准予长盛精选行业轮动混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2022〕192号文）注册募集，募集期自2022年7月19日始至2022年9月2日止，《基金合同》于2022年9月6日生效，基金合同生效日的基金份额总额为273,050,328.61份。自2022年9月6日至2023年3月10日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

根据《长盛精选行业轮动混合型证券投资基金基金合同》以及《长盛基金管理有限公司关于长盛精选行业轮动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》，自2023年3月11日起，本基金进入清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛精选行业轮动混合型证券投资基金

报告截止日：2023年3月10日（基金最后运作日）

金额单位：人民币元

科目名称	最后运作日 (2023年3月10日)
资产：	
银行存款	2,135,433.95
结算备付金	137,001.40
存出保证金	36,714.49
交易性金融资产	14,989,018.62
应收清算款	1,713,677.47
应收申购款	6,378.76
资产总计	19,018,224.69
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	2,847,442.77
应付管理人报酬	9,693.64
应付托管费	1,615.60
应付销售服务费	502.30
其他负债	123,122.97

负债合计	2,982,377.28
净资产:	
实收基金	16,683,251.08
未分配利润	-647,403.67
净资产合计	16,035,847.41
负债和净资产总计	19,018,224.69

注：截至2023年3月10日(基金最后运作日)，长盛精选行业轮动混合型证券投资基金份额总额16,683,251.08份，其中，长盛精选行业轮动混合A的基金份额净值为0.9616元，份额总额为13,370,393.38份；长盛精选行业轮动混合C的基金份额净值为0.9597元，份额总额为3,312,857.70份。

五、清算情况

自2023年3月11日至2023年3月28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，本基金清算费用中的律师费部分由基金管理人承担，不从基金财产中支付。其他清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币2,135,433.95元，其中包含应计利息人民币10,072.75元。清算期间产生变现交收、支付费用等资金变动共计增加银行存款人民币9,773,865.58元；清算期间计提的银行存款利息为人民币3,461.68元，结息转出应计利息人民币11,868.54元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币11,900,892.67元，其中应计银行存款利息人民币1,665.89元。应计银行存款利息将于清算期结束后由管理人以自有资金先行垫付，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币137,001.40元，其中上海最低备付金为人民币88,284.91元，应计利息为人民币297.44元；深圳最低备付金为人民币48,044.90元，应计利息为人民币374.15元。清算期间共计提利息人民币110.34元，结息转出最低备付金利息人民币739.02元。截至清算期结束日，最低备付金余额为人民币136,372.72元，其中最低备付金应计利息为人民币42.91元。该款项将于清算期结束后由管理人以自有资金先行垫付，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币36,714.49元，其中上海存出保证金为人民币12,753.40元，应计利息为人民币31.38元；深圳存出保证金为人民币23,870.81元，应计利息为人民币58.90元。清算期间存出保证金共计提利息人民币29.52元，结息转出存出保证金利息人民币108.32元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币36,635.69元，其中存出保证金应计利息为人民币11.48元。该款项将于清算期结束后由管理人以自有资金先行垫付，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币14,989,018.62元，全部为股票投资。明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票代码	数量 (单位： 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	宁夏建材	600449 SH	50,000.00	14.56	759,855.00	728,000.00
2	涪陵电力	600452 SH	60,000.00	17.25	1,036,353.31	1,035,000.00
3	中国软件	600536 SH	11,700.00	73.99	894,492.32	865,683.00
4	中国移动	600941 SH	15,000.00	89.40	1,352,703.86	1,341,000.00
5	海量数据	603138 SH	20,000.00	24.17	470,510.80	483,400.00
6	能科科技	603859 SH	19,918.00	43.59	775,767.80	868,225.62
7	海光信息	688041 SH	19,000.00	52.35	956,901.36	994,650.00
8	龙芯中科	688047 SH	8,000.00	110.61	730,811.60	884,880.00
9	金山办公	688111 SH	6,000.00	302.88	1,668,104.49	1,817,280.00
10	道通科技	688208 SH	20,000.00	33.30	830,850.03	666,000.00
11	国芯科技	688262 SH	5,000.00	58.00	287,720.19	290,000.00
12	海天瑞声	688787 SH	4,000.00	183.00	935,771.28	732,000.00

13	太极股份	002368 SZ	30,000.00	42.48	835,819.76	1,274,400.00
14	久远银海	002777 SZ	50,000.00	18.57	956,639.50	928,500.00
15	天孚通信	300394 SZ	25,000.00	38.78	985,603.33	969,500.00
16	博思软件	300525 SZ	50,000.00	22.21	1,055,634.00	1,110,500.00

以上股票投资于2023年3月11日至2023年3月28日处置变现。处置净损益为人民币641,566.48元，处置期间产生的交易费用为人民币28,291.84元。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币1,713,677.47元，已于清算期间收回。

(6) 本基金最后运作日应收申购款为人民币6,378.76元，已于清算期间收回。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款人民币2,847,442.77元、应付管理人报酬人民币9,693.64元、应付托管费人民币1,615.60元和应付销售服务费人民币502.30元。上述应付赎回款已于清算期间支付，应付管理人报酬、应付托管费和应付销售服务费将于完成相应流程后支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币123,122.97元，其中应付赎回费人民币1,079.70元、应付交易费用人民币66,920.27元、预提年度审计费人民币40,000.00元和预提信息披露费人民币15,123.00元。上述应付赎回费已于清算期间支付，应付交易费用、预提年度审计费和预提信息披露费将于完成相应流程后支付。

4、清算期间的清算损益情况

金额单位：人民币元

项目	自2023年3月11日 至2023年3月28日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	3,601.35
处置交易性金融资产产生的净损益（注2）	641,566.48
清算期间收益小计	645,167.83
二、清算期间费用	
股票交易费用	28,291.84
银行汇划费	660.07
清算期间费用小计	28,951.91

三、清算期间净损益	616,215.92
-----------	------------

注1:利息收入系计提的自2023年3月11日至2023年3月28日止清算期间的银行存款利息收入、最低备付金利息收入及存出保证金利息收入。

注2:处置交易性金融资产产生的净损益系清算期间交易性金融资产变现损益人民币641,566.48元。

5、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

金额单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2023年3月10日基金净资产	16,035,847.41
加：清算期间净损益	616,215.92
减：基金净赎回金额（于2023年3月13日确认的投资者净赎回申请）	4,723,707.77
二、清算期结束日2023年3月28日基金净资产	11,928,355.56

资产处置及负债清偿后，2023年3月28日本基金剩余财产为人民币11,928,355.56元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组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。

自清算期起始日（2023年3月11日）至清算期结束日（2023年3月28日）的银行存款等产生的利息已计入清算期间净损益，自清算期结束日次日（2023年3月29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，用以垫付应计利息及最低备付金等。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) 《长盛精选行业轮动混合型证券投资基金清算报表审计报告 2023 年 3 月 28 日》；

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛精选行业轮动混合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。

长盛精选行业轮动混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023年4月4日