

景顺长城泰申回报混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二三年八月十一日

清算报告公告日：二〇二三年八月十七日

目录

重要提示	3
一、基金概况	3
二、基金运作情况	4
三、财务会计报告	4
四、清算情况	5
五、备查文件	10

重要提示

景顺长城泰申回报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”）2019年11月19日证监许可【2019】2397号文准予募集注册，本基金基金合同于2020年3月18日正式生效。本基金基金管理人为景顺长城基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《景顺长城泰申回报混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，本基金出现了基金合同终止事由，基金管理人根据法律法规、《基金合同》的约定履行了基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2023年7月26日，并于2023年7月27日进入清算程序。由于本基金持有的锁定期股票无法确定变现时间，本基金计划将进行两次清算，其中第一次清算期间为2023年7月27日至2023年8月11日，第二次清算期间将根据锁定期股票的变现时间确定。

本基金的基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2023年7月27日成立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)对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

一、基金概况

基金名称	景顺长城泰申回报混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城泰申回报混合
基金主代码	008479
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年3月18日
基金管理人名称	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人名称	上海银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规以及《景顺长城泰申回报混合型证券投资基金基金合同》、《景顺长城泰申回报混合型证券投资基金招募说明书》

二、基金运作情况

本基金经中国证监会2019年11月19日证监许可【2019】2397号文准予募集注册，由基金管理人依照法律法规、《基金合同》等规定自2020年3月9日至2020年3月13日期间向社会公开募集。《基金合同》于2020年3月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为219,826,093.26份（含募集期间利息结转的份额，其中认购资金利息折合50,216.97份基金份额）。

根据《基金合同》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。基金合同存续期内，如果存在连续50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，基金管理人应当终止本基金合同，无需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至2023年7月26日，本基金已出现连续50个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，基金管理人在上述事由出现后依法履行了基金财产清算程序。本基金的最后运作日为2023年7月26日，并于2023年7月27日进入清算程序。

自《基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：景顺长城泰申回报混合型证券投资基金

报告截止日：2023年7月26日

单位：人民币元

资产	本期末 2023年7月26日(基金最后运作日)
资产：	
银行存款	413,711.76
结算备付金	231,504.21

存出保证金	96,290.74
交易性金融资产	145,084.15
其中：股票投资	145,084.15
应收清算款	647,360.19
资产总计	1,533,951.05
负债：	
应付赎回款	11,687.88
应付管理人报酬	1,857.37
应付托管费	309.57
其他负债	94,047.83
负债合计	107,902.65
所有者权益：	
实收基金	1,230,093.27
未分配利润	195,955.13
所有者权益合计	1,426,048.40
负债和所有者权益总计	1,533,951.05

注：1. 报告截止日 2023 年 7 月 26 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.1593 元，基金份额总额 1,230,093.27 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 26 日(基金最后运作日)。

四、清算情况

自2023年7月27日至2023年8月11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，具体清算情况如下：

(一) 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剩余财产中支付。

（二）资产处置情况

（1）本基金最后运作日的银行存款余额为人民币413,711.76元，其中包含应计银行活期存款利息人民币557.93元。银行存款本金部分由基金托管人负责保管，应计银行活期存款利息由基金管理人景顺长城基金管理有限公司先行垫付，待结息日返还给基金管理人。

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币231,504.21元，其中包含应计结算备付金利息人民币440.57元。

结算备付金的本金部分由中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“结算公司”或“登记公司”）上海、深圳分公司收取并保管，并由基金管理人景顺长城基金管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，基金管理人垫付的资金待结算公司返还后再归还基金管理人。因登记公司于每月第六个工作日根据基金上月的交易情况对其收取基金的结算备付金进行调整，基金管理人具体垫付的金额，以基金清算款划出日前一日结算公司收取的金额为准。截止2023年8月11日本基金结算备付金余额为30,999.48元，其中包含应计结算备付金利息人民币579.88元。

结算备付金的应计利息部分由基金管理人景顺长城基金管理有限公司先行垫付，待结息日返还给基金管理人。

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币96,290.74元，其中包含应计存出保证金利息人民币150.29元。

存出保证金的本金部分由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管，并由基金管理人景顺长城基金管理有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，基金管理人垫付的资金待结算公司返还后再归还基金管理人。因登记公司于每月第二个工作日根据基金上月的交易情况对其收取基金的存出保证金进行调整，基金管理人具体垫付的金额，以基金清算款划出日前一日结算公司收取的金额为准。截止2023年8月11日本基金存出保证金余额为180.53元，其中包含应计结算备付金利息人民币180.53元。

存出保证金的应计利息部分由基金管理人景顺长城基金管理有限公司先行垫付，待结息日返还给基金管理人。

（4）本基金最后运作日交易性金融资产为股票投资，市值为人民币145,084.15元。截至2023年7月26日，除因尚处于锁定期内而无法卖出的股票投资外，本

基金持有的其他交易性金融资产-股票投资已于2023年8月10日前卖出，收回金额合计人民币52,695.27元。截至2023年8月11日，锁定期股票市值为96,583.06元（该金额为锁定期股票截至2023年8月11日的估值金额，与锁定期结束后实际变现金额可能存在差异），该部分股票预计于锁定期结束后卖出并进入二次清算程序，届时将根据变现情况在第二次清算期间按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

（5）本基金最后运作日应收清算款为人民币647,360.19元，该款项已于2023年7月27日划入基金托管户，由基金托管人负责保管。

（三）负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付赎回款为人民币11,687.88元，该款项已于2023年7月28日前支付。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,857.37元，该款项已于2023年8月3日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币309.57元，该款项已于2023年8月3日支付。

（4）本基金最后运作日其他负债为人民币94,047.83元，由预提费用人民币93,282.92元、应付销售费人民币0.08元、应付交易费用人民币764.83元构成。

预提费用为预提审计费、信息披露费和银行间账户维护费。其中预提审计费用人民币30,245.92元，该款项按照付款通知书已于2023年7月31日支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）；预提信息披露费人民币60,493.68元，按照信息披露合同该款项已于2023年8月8日支付给证券时报；预提银行间账户维护费为2,543.32元，按照缴款通知书本基金应支付3,100.00元，该款项已于2023年8月1日分别支付给中央国债登记结算公司和银行间市场清算所，基金计提不足部分由基金管理人景顺长城基金管理有限公司承担，基金管理人将在剩余财产划付日前将基金先行垫付部分资金及对应利息归还基金资产。

应付销售费用已于2023年7月28日随应付赎回款划付时一并支付。

应付交易费用已于2023年8月10日完成支付。

（四）资产负债表日后事项处理

（1）自2023年7月27日本基金进入清算程序起至2023年8月11日止第一次清算期间，经本基金管理人登记系统确认的基金赎回交易为于2023年7月26日提出申

请并于2023年7月27日确认的赎回(含转换)交易。上述基金赎回(含转换)交易中申请基金份额为575.16份,赎回(含转换)时本基金份额净值为人民币1.1593元,确认赎回(含转换)金额为人民币666.79元,扣除赎回费用人民币0.04元后的赎回(含转换)金额为人民币666.75元;该款项已于2023年7月31日返还投资者。

(2) 截止2023年8月11日,本基金管理人登记系统记录本基金剩余基金份额总额为1,229,518.11份。

(五) 清算期间的剩余资产情况

单位:人民币元

项 目	金 额
一、2023年7月26日(基金最后运作日)基金净资产	1,426,048.40
加:清算期间(2023年7月27日至2023年8月11日)收入	511.83
存款利息收入(注1)	511.81
其他收入(注2)	0.02
加:公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-13,907.02
加:清算期间资产负债表日后事项处理支出	17,998.69
投资收益(损失以“-”填列)(注3)	17,998.69
减:清算期间确认的基金份额赎回减少净资产	666.79
支付清算期间确认的基金赎回份额对应赎回款	666.79
二、2023年8月11日基金净资产(注4)	1,429,985.11

注:1、利息收入为暂以当前适用的利率预估计提的自2023年7月27日至2023年8月11日止清算期间的银行存款、结算备付金和存出保证金利息。

2、其他收入为清算期间赎回费收入。

3、投资收益为清算期间变现股票资产的收益。

4、截止2023年8月11日本基金的净资产情况详见(六)

(六) 截至2023年8月11日本基金的净资产情况如截止当日的资产负债表所示:

会计主体:景顺长城泰申回报混合型证券投资基金

报告截止日:2023年8月11日

单位：人民币元

资产	本期末 2023年8月11日
资产：	
银行存款	1,301,617.36
结算备付金	30,999.48
存出保证金	180.53
交易性金融资产	96,583.06
其中：股票投资	96,583.06
其他应收款	604.68
资产合计：	1,429,985.11
负债和所有者权益	本期末 2023年8月11日
负债：	
负债合计	0.00
所有者权益：	
实收基金	1,229,518.11
未分配利润	200,467.00
所有者权益合计	1,429,985.11
负债与持有人权益总计：	1,429,985.11

资产处置及负债清偿后，于2023年8月11日本基金剩余财产为人民币1,429,985.11元，其中未变现的锁定期股票市值为人民币96,583.06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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2023年8月11日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人景顺长城基金管理有限公司将先行垫付该笔款项(该金额可能与实际结息金额存在略微差异)，供清盘分配使用，待结息日回款后再返还给基金管理人。

(七) 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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

五、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金清算审计报告
- 2、上海市通力律师事务所关于《景顺长城泰申回报混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

(二) 存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

(三) 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

景顺长城泰申回报混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二三年八月十一日