

# 长盛均衡回报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10月12日

清算报告公告日期：2023年10月16日

## 一、重要提示

长盛均衡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”）2022年4月15日《关于准予长盛均衡回报混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2022〕801号文）注册募集，于2023年1月17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《长盛均衡回报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，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9月18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《基金合同》终止条款。本基金于2023年9月19日起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9月19日刊登在《中国证券报》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均衡回报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9月18日，自2023年9月19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、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2023年9月19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	长盛均衡回报混合型证券投资基金
基金简称	长盛均衡回报混合

基金代码	A类：015737 C类：015738
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年1月17日
基金最后运作日（2023年9月18日）基金份额总额	3,447,906.95份
投资目标	在严格控制风险、保证基金资产流动性的前提下，通过对优质企业的全面深入研究，均衡兼顾价值和成长风格，精选优质上市公司，分享其在中国经济增长大背景下的可持续性增长，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他依法发行上市股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据及其他经中国证监会允许基金投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。</p>
主要投资策略	<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>本基金主要采取自上而下和自下而上相结合的选股策略，通过定量分析和定性分析相结合的方法挖掘优质上市公司，筛</p>

	<p>选其中安全边际较高的个股构建投资组合。</p> <p>在风格配置上，本基金采取均衡风格配置，兼顾价值和成长风格，密切关注市场风格切换带来的投资机会，追求最佳的风险收益比，以实现较好的中长期投资回报。</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

长盛均衡回报混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会2022年4月15日《关于准予长盛均衡回报混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2022〕801号文）注册募集，募集期自2022年10月14日至2023年1月13日止，《基金合同》于2023年1月17日生效，基金合同生效日的基金份额总额为413,897,842.53份。自2023年1月17日至2023年9月18日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

根据《长盛均衡回报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均衡回报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9月19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：长盛均衡回报混合型证券投资基金

报告截止日：2023年9月18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9月18日)
<b>资产：</b>	
银行存款	1,469,461.11
结算备付金	18,266.11
存出保证金	9,030.76
交易性金融资产	2,134,901.00
其中：股票投资	2,134,901.00
应收清算款	48,545.57
资产总计	3,680,204.55
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负债：</b>	
应付赎回款	111,980.29
应付管理人报酬	2,914.41
应付托管费	485.73
应付销售服务费	331.83
其他负债	28,783.52
负债合计	144,495.78
<b>净资产：</b>	
实收基金	3,447,906.95
未分配利润	87,801.82
净资产合计	3,535,708.77
<b>负债和净资产总计</b>	<b>3,680,204.55</b>

注：截至2023年9月18日(基金最后运作日)，长盛均衡回报混合型证券投资基金份额总额3,447,906.95份，其中，长盛均衡回报混合A的基金份额净值为1.0269元，基金份额总额为2,232,458.82份；长盛均衡回报混合C的基金份额净值为1.0228元，基金份额总额为1,215,448.13份。

## 五、清算情况

自2023年9月19日至2023年9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1,469,461.11元，其中包含应计利息人民币29,011.04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2,087,062.11元；清算期间计提的银行存款利息为人民币579.66元，结息转出应计利息人民币29,097.02元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币3,528,005.86元，其中应计银行存款利息人民币493.68元。应计银行存款利息将于清算期结束后由基金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18,266.11元，其中上海最低备付金为人民币7,029.51元，应计利息为人民币11,213.57元；深圳最低备付金为人民币0.00元，应计利息为人民币23.03元。清算期间共计提利息人民币3.20元，结息转出最低备付金利息人民币11,237.56元。截至清算期结束日，最低备付金余额为人民币7,031.75元，其中最低备付金应计利息为人民币2.24元。该款项将于清算期结束后由基金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9,030.76元，其中上海存出保证金为人民币7,160.08元，应计利息为人民币15.50元；深圳存出保证金为人民币1,848.90元，应计利息为人民币6.28元。清算期间存出保证金共计提利息人民币4.00元，结息转出存出保证金利息人民币22.98元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币9,011.78元，其中存出保证金应计利息为人民币2.80元。该款项将于清算期结束后由基金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2,134,901.00元，全部

为股票投资。明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	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	601939	建设银行	33,500.00	6.15	200,467.27	206,025.00
2	601398	工商银行	44,200.00	4.64	204,829.82	205,088.00
3	601088	中国神华	6,000.00	31.23	170,845.97	187,380.00
4	600025	华能水电	20,800.00	7.43	146,708.12	154,544.00
5	600900	长江电力	6,700.00	22.41	145,346.61	150,147.00
6	600050	中国联通	27,700.00	5.11	143,604.62	141,547.00
7	601985	中国核电	19,000.00	7.40	138,883.23	140,600.00
8	600018	上港集团	25,700.00	5.18	137,205.52	133,126.00
9	601628	中国人寿	3,700.00	35.95	137,028.57	133,015.00
10	600690	海尔智家	5,500.00	23.86	132,011.26	131,230.00
11	601319	中国人保	20,900.00	5.89	131,092.04	123,101.00
12	601225	陕西煤业	6,500.00	18.53	107,439.38	120,445.00
13	600104	上汽集团	8,000.00	14.84	118,595.87	118,720.00
14	601728	中国电信	16,500.00	6.01	95,535.00	99,165.00
15	601868	中国能建	25,000.00	2.26	58,575.00	56,500.00
16	601800	中国交建	1,200.00	9.09	13,268.85	10,908.00
17	601816	京沪高铁	1,800.00	5.06	9,950.86	9,108.00
18	601919	中远海控	900.00	9.88	8,912.18	8,892.00
19	601390	中国中铁	800.00	6.70	6,243.50	5,360.00

以上股票投资于2023年9月19日至2023年9月28日处置变现。处置净损益为人民币10,062.46元，处置期间产生的交易费用为人民币2,811.39元。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币48,545.57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111,980.29元、应付管理人报酬人民币2,914.41元、应付托管费人民币485.73元和应付销售服务费人民币331.83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28,783.52元，其中应付赎回费人民币0.64元、应付交易费用人民币25,782.88元及预提审计费人民币3,000.00元。其中应付赎回费、应付交易费用已于清算期间支付，预提审计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9月19日 至2023年9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）	588.87
处置交易性金融资产产生的净损益（注2）	10,062.46
清算期间收益小计	10,651.33
二、清算期间支出	
股票交易费用	2,811.39
银行汇划费	351.51
清算期间支出小计	3,162.90
三、清算期间净损益	7,488.43

注1:利息收入系计提的自2023年9月19日至2023年9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。

#### 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9月18日基金净资产	3,535,708.77
加：清算期间净损益	7,488.43
减：基金净赎回金额（于2023年9月19日确认的投资者净赎回申请）	2,223.66
二、清算期结束日2023年9月28日基金净资产	3,540,973.54

资产处置及负债清偿后，2023年9月28日本基金剩余财产为人民币3,540,973.54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（由本基金管理人承担的部分除外）、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9月19日）至清算期结束日（2023年9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9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)《长盛均衡回报混合型证券投资基金 2023 年 1 月 17 日(基金合同生效日)至 2023 年 9 月 18 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<长盛均衡回报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。

长盛均衡回报混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023年10月16日