

长信利盈灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2025年2月13日

清算报告公告日：2025年2月19日

§ 1 重要提示

长信利盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]919号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为270,946,626.82份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第1500367号验资报告。基金合同于2015年6月9日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据基金合同“第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定:“有下列情形之一的,并在履行相关程序后,《基金合同》应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的;”

根据基金管理人于2025年1月22日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》(以下简称“《决议生效公告》”),基金份额持有人大会于2025年1月20日表决通过了《关于终止长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。本基金最后运作日为2025年1月22日,自2025年1月23日起进入清算期。

由基金管理人长信基金管理有限责任公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2025年1月23日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由德勤华永会计师事务所(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。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长信利盈混合
基金主代码	519963
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月9日
报告期末(2025年1月22日)基金份额总额	3,133,709.98份
投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提

	下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。</p> <p>（2）个股投资策略</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>（3）存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的绝对收益。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。</p>	
业绩比较基准	银行一年期定期存款利率（税后）+3%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信利盈混合 A	长信利盈混合 C

下属分级基金的场内简称	利盈 A	利盈 C
下属分级基金的交易代码	519963	519962
报告期末下属分级基金的份额总额	1,131,211.05 份	2,002,498.93 份

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会以证监许可[2015]919 号文批准公开募集，基金合同于 2015 年 6 月 9 日生效，首次设立募集基金份额为 270,946,626.82 份，

因市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，本基金管理人根据《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》、《基金合同》等有关规定，经与基金托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。基金管理人于 2024 年 12 月 20 日 0:00 起至 2025 年 1 月 19 日 17:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议了《关于终止长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

本次基金份额持有人大会于 2025 年 1 月 20 日表决通过了《关于终止长信利盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。根据基金管理人于 2025 年 1 月 22 日发布的《决议生效公告》，自 2025 年 1 月 23 日起进入清算期。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同的约定正常运作。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表（经审计）

会计主体：长信利盈灵活配置混合型证券投资基金

单位：人民币元

资产	清算结束日 2025 年 1 月 27 日	最后运作日 2025 年 1 月 22 日
资产：		
银行存款	3,503,302.82	4,034,079.46
结算备付金	-	-
存出保证金	43.23	43.23
应收申购款	-	576,669.96
资产总计	3,503,346.05	4,610,792.65
负债和净资产	清算结束日 2025 年 1 月 27 日	最后运作日 2025 年 1 月 22 日
负债：		

应付赎回款	-	914,219.32
应付管理人报酬	-	13,310.67
应付托管费	-	161.59
应付销售服务费	-	284.38
应付交易佣金	-	56.83
其他负债	30,000.00	30,000.00
负债合计	30,000.00	958,032.79
净资产：		
实收基金	2,971,931.38	3,133,709.98
未分配利润	501,414.67	519,049.88
净资产合计	3,473,346.05	3,652,759.86
负债和净资产总计	3,503,346.05	4,610,792.65

注：本基金最后运作日 2025 年 1 月 22 日，长信利盈混合 A 份额净值人民币 1.2157 元，长信利盈混合 C 份额净值人民币 1.1374 元；基金份额总额为 3,133,709.98 份，其中长信利盈混合 A 份额 1,131,211.05 份，长信利盈混合 C 份额 2,002,498.93 份。

4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信利盈灵活配置混合型证券投资基金

单位：人民币元

项目	2025 年 1 月 23 日(清算开始日)至 2025 年 1 月 27 日(清算结束日)止期间
一、 收入	2,538.52
1、利息收入（注 1）	189.57
其中：存款利息收入	189.57
2、投资收益(损失以“-”填列)	-
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-
4、其他业务收入(损失以“-”填列)（注 2）	2,348.95
二、 费用	22.50
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、销售服务费	-
4、税金及附加	-
5、其他费用（注 3）	22.50
三、 利润总额	2,516.02
减：所得税费用	-
四、 净收益	2,516.02

注：1、利息收入系以当前适用利率预估计提的自 2025 年 1 月 23 日(清算开始日)至 2025 年 1 月 27 日(清算结束日)止期间的银行存款利息收入人民币 189.57 元。

2、其他业务收入系 2025 年 1 月 23 日(清算开始日)至 2025 年 1 月 27 日(清算结束日)止期间

的赎回费收入人民币 2,348.95 元。

3、其他费用系自 2025 年 1 月 23 日(清算开始日)至 2025 年 1 月 27 日(清算结束日)止期间支付费用产生的汇划费, 共计人民币 22.50 元。

4、本次清算期间产生的其他清算费用由本基金基金管理人承担。

§ 5 基金财产分配

自2025年1月23日至2025年1月27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:

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日银行存款为人民币 4,034,079.46 元, 其中活期存款人民币 4,031,144.63 元, 应计活期存款利息人民币 2,934.83 元; 于清算结束日(2025 年 1 月 27 日) 银行存款为人民币 3,503,302.82 元, 其中活期存款人民币 3,500,178.42 元, 应计活期存款利息人民币 3,124.40 元。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金为人民币 43.23 元, 其中存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金人民币 43.23 元。于清算结束日(2025 年 1 月 27 日) 存出保证金为人民币 43.23 元, 其中存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金人民币 43.23 元。

5.1.3 本基金最后运作日应收申购款为人民币 576,669.96 元, 该款项已于 2025 年 1 月 23 日划入托管户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 914,219.32 元, 该款项已于 2025 年 1 月 27 日前支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 13,310.67 元, 该款项已于 2025 年 1 月 27 日前支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 161.59 元, 该款项已于 2025 年 1 月 27 日前支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 284.38 元, 该款项已于 2025 年 1 月 27 日前支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付交易佣金为人民币56.83元，该款项已于2025年1月27日前支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债为人民币30,000.00元，为预提审计费人民币30,000.00元，将于2025年1月27日之后支付。

5.3 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（2025年1月22日）基金净资产	3,652,759.86
加：清算期间净收益	2,516.02
基金净申购转入金额 （于2025年1月23日确认的投资者净赎回申请）	223,024.62
减：基金净赎回转出金额 （于2025年1月23日确认的投资者净赎回申请）	404,954.45
二、2025年1月27日基金净资产	3,473,346.05

根据基金合同的约定，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。清算结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款及存出保证金孳生的利息归基金份额持有人所有。资产处置及部分负债清偿后，本基金截至2025年1月27日止的净资产为人民币3,473,346.05元，其中长信利盈混合A资产净值为人民币1,408,458.49元，长信利盈混合C资产净值为人民币2,064,887.56元。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付上述未结息金额及存出保证金，供清盘分配使用，待实际资金到账后再返还基金管理人，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

5.4 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，报监管备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

1、《长信利盈灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告》；

2、《上海源泰律师事务所关于长信利盈灵活配置混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信利盈灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2025年2月19日