

长信均衡策略一年持有期混合型证券投资 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：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：2026 年 7 月 14 日

清算报告公告日：2026 年 7 月 17 日

§ 1 重要提示

长信均衡策略一年持有期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”)证监许可[2022]2000号《关于准予长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册,由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》和《长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币271,990,496.58元,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(22)第00584号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2022年12月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为272,014,483.02份基金份额,其中认购资金利息折合23,986.44份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

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,在履行适当程序后,《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2026年6月17日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》,基金份额持有人大会于2026年6月15日表决通过了《关于终止长信均衡策略一年持有期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。根据此次本基金基金份额持有人大会表决通过的前述议案以及《关于终止长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案的说明》,大会决议生效后,本基金管理人决定自2026年6月18日起安排5个工作日的赎回选择期,即2026年6月18日起至2026年6月25日止,在赎回选择期期间,投资人仅可以办理本基金的赎回及转换转出业务,不可办理申购(含转换转入、定期定额投资)业务。本基金最后运作日为2026年6月25日,自2026年6月26日起进入清算期。

基金管理人长信基金管理有限责任公司、基金托管人平安银行股份有限公司、立信会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2026年6月26日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由立信会计师事务所(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	长信均衡策略一年持有混合
基金主代码	016713
交易代码	016713
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 12 月 13 日
最后运作日（2026 年 6 月 25 日）基金份额总额	11,138,587.76 份
投资目标	本基金通过积极主动的资产管理，在严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+中债-综合指数收益率*30%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。本基金若投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2000号《关于准予长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集。基金合同于2022年12月13日正式生效，首次设立募集规模为272,014,483.02份基金份额。

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，经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。基金管理人以通讯方式召开了基金

份额持有人大会，投票表决时间自2026年5月28日0:00起至2026年6月14日17:00止，会议期间审议了《关于终止长信均衡策略一年持有期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2026年6月15日表决通过了《关于终止长信均衡策略一年持有期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。根据此次本基金基金份额持有人大会表决通过的前述议案以及《关于终止长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案的说明》，大会决议生效后，本基金管理人决定自2026年6月18日起安排5个工作日的赎回选择期，即2026年6月18日起至2026年6月25日止，在赎回选择期期间，投资人仅可以办理本基金的赎回及转换转出业务，不可办理申购（含转换转入、定期定额投资）业务。本基金最后运作日为2026年6月25日，自2026年6月26日起进入清算期。

自本基金基金合同生效日至本次大会决议生效并公告前，本基金按基金合同约定正常运作。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表（经审计）

会计主体：长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金

单位：人民币元

项目	2026年7月2日 (清算结束日)	2026年6月25日 (最后运作日)
资产：		
银行存款	10,664,069.51	5,514,267.94
结算备付金	—	—
存出保证金	—	—
交易性金融资产	—	7,900,742.83
其中：股票投资	—	7,395,591.19
债券投资	—	505,151.64
应收清算款	—	435,365.26
应收股利	5,510.74	5,510.74
应收申购款	323.40	323.40
资产总计	10,669,903.65	13,856,210.17
负债和净资产		
负债：		
应付赎回款	—	1,728,565.33
应付管理人报酬	—	23,999.32
应付托管费	—	3,999.91
应付销售服务费	—	10,057.54
应交税费	—	26.24

其他负债	-	29,987.57
负债合计	-	1,796,635.91
净资产：		
实收基金	9,994,496.21	11,138,587.76
未分配利润	675,407.44	920,986.50
净资产合计	10,669,903.65	12,059,574.26
负债和净资产总计	10,669,903.65	13,856,210.17

注：本基金最后运作日 2026 年 6 月 25 日，基金份额总额 11,138,587.76 份，其中 A 类基金份额净值 1.0976 元，份额总额 3,820,243.62 份；C 类基金份额净值 1.0749 元，份额总额 7,318,344.14 份。

§ 5 基金财产分配

2026年6月26日(清算开始日)至2026年7月2日(清算结束日)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 资产处置及负债清偿情况

5.1.1 本基金最后运作日银行存款项为人民币 5,514,267.94 元，其中活期存款本金为人民币 1,807,183.95 元，应计活期存款利息为人民币 204.78 元，存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金本金为人民币 3,706,842.15 元，应计备付金利息为人民币 37.06 元；本基金清算结束日银行存款为人民币 10,664,069.51 元，其中活期存款本金为人民币 10,663,115.61 元，应计活期存款利息为人民币 390.34 元，存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金本金为人民币 463.20 元，应计备付金利息为人民币 100.36 元。

5.1.2 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 7,900,742.83 元，其中交易性股票投资为人民币 7,395,591.19 元，交易性债券投资为人民币 505,151.64 元，上述交易性金融资产在清算期间已全部处置完毕。

5.1.3 本基金最后运作日应收清算款为人民币 435,365.26 元。截至清算结束日，应收清算款已交收。

5.1.4 本基金最后运作日应收股利为人民币 5,510.74 元，清算结束日应收股利为人民币 5,510.74 元，均为港股通应收股利。

5.1.5 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1,728,565.33 元。截至清算结束日，应付赎回款已支付。

5.1.6 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 23,999.32 元，应付托管费为人民币 3,999.91 元，应付销售服务费为人民币 10,057.54 元。上述应付款项已于清算期间支付。

5.1.7 本基金最后运作日其他负债为人民币 29,987.57 元，其中 29,813.24 元为提前到账的股票应收红利于 2026 年 6 月 26 日红利到账后冲销，其中应付佣金 174.33 元已于 2026 年 7 月 2 日(清算结束日)前支付。

5.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金

清算损益表

单位：人民币元

项目	2026 年 6 月 26 日(清算开始日)至 2026 年 7 月 2 日(清算结束日)止期间
一、营业总收入	-156,273.60
1. 利息收入	248.86
其中：存款利息收入	185.56
备付金利息收入	63.30
2. 投资收益(损失以“-”填列)	267,747.44
其中：股票投资收益	245,097.13
债券投资收益	-223.09
股利收益	22,873.40
3. 公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-424,269.90
二、营业总支出	1.63
税金及附加	0.26
其他费用	1.37
三、利润总额	-156,275.23
四、净利润	-156,275.23
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	-156,275.23

5.2.1 清算期间利息收入系以当前适用利率预估计提的自 2026 年 6 月 26 日(清算开始日)至 2026 年 7 月 2 日(清算结束日)止期间的存款利息收入为人民币 185.56 元，备付金利息收入为人民币 63.30 元。

5.2.2 清算期间投资收益金额为人民币 267,747.44 元，其中股票投资收益为人民币 245,097.13 元，债券投资收益为人民币-223.09 元，股利收益为人民币 22,873.40 元。

5.2.3 清算期间公允价值变动损益金额为人民币-424,269.90 元，系本基金清算期间卖出的股票和债券的估值结转。

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（2026年6月25日）基金净资产	12,059,574.26
加：清算期间净收益	-156,275.23
减：基金净赎回转出金额 （于2026年6月26日确认的投资者赎回转出申请）	1,233,395.38
二、清算结束日（2026年7月2日）基金净资产	10,669,903.65

注：根据本基金的基金合同及基金管理人于2026年6月17日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，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孳生的利息归基金份额持有人所有。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付应收存款利息、清算备付金及其应计利息、应收股利、应收申购款利息，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。

资产处置及部分负债清偿后，截至清算结束日（2026年7月2日）本基金的净资产为人民币10,669,903.65元。

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、长信均衡策略一年持有期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均衡策略一年持有期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

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

长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金财产清算小组

2026 年 7 月 17 日