

长盛龙头双核驱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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022年4月8日

清算报告公告日期：2022年4月14日

一、重要提示

长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）2018年6月27日经中国证券监督管理委员会《关于准予长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2018】1054号）和2019年9月10日中国证监会证券投资基金机构监管部《关于长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函【2019】2227号）注册募集，于2019年11月4日成立并正式运作，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《长盛龙头双核驱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个工作日出现上述情形的，直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。”截至2022年3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。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现《基金合同》终止事由后依法履行基金财产清算程序。本基金管理人确定2022年3月18日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2022年3月19日）起本基金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2022年3月19日刊登在《证券日报》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龙头双核驱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》。

本基金自2022年3月19日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国银行、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2022年3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，上海源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	长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金
基金简称	长盛龙头双核混合
基金代码	006198
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年11月4日
基金最后运作日（2022年3月18日）基金份额总额	26,815,512.75份
投资目标	本基金通过综合评估市场份额占比情况、盈利能力、持续增长能力、抗风险能力、估值水平等指标，选取综合实力在行业中具有明显优势的龙头上市公司进行投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在综合分析国内外宏观经济市场形势、微观经济指标及货币财政政策的基础上，动态配置大类资产，同时在股票投资方面主要采用“双核驱动”投资策略精选市场最强龙头上市公司策略，双核驱动策略包括价值精选和趋势判断两个核心投资策略，即通过价值精选策略筛选出龙头上市公司，再通过趋势判断策略动态监控上市公司的价格变化趋势选择合适时机进行投资，最终通过综合评估机制确定投资组合并进行实时动态跟踪，根据市场变化及时调整组合配置。价值精选策略指通过基本面分析方法筛选价格低于其内在价值的上市公司股票进行投资；趋势判断策略使用技术面的指标，动态监控上市公司个股的成交量、换手率、波动率以及不同时间区间的价格动量趋势等方面，确定合适的投资时机。本基金的投资策略包含：大类资产配置策略、龙头公司的界定选择策略、行业和个股精选策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，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。基金管理人可根据本基金投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。本基金资产不超过50%的比例可能投资于港股，会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，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）2018年6月27日经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1054号文和2019年9月10日机构部函【2019】2227号文注册募集，于2019年11月4日成立并正式运作，首次设立募集规模为896,792,790.91份基金份额（含利息结转份额）。

根据《长盛龙头双核驱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个工作日出现上述情形的，直接终止《基金合同》，且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2022年3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。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现《基金合同》终止事由后依法进入基金财产清算程序。本基金管理人确定2022年3月18日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2022年3月19日）起本基金进入基金财产清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金

报告截止日：2022年3月18日（基金最后运作日）

科目名称	最后运作日 (2022年3月18日)
资 产：	
银行存款	13,321,691.33
结算备付金	81,529.31
存出保证金	43,193.87
交易性金融资产	23,649,201.37
应收证券清算款	530,822.72
资产总计	37,626,438.60
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	606,532.05
应付管理人报酬	31,797.52
应付托管费	5,299.58
应付证券清算款	62,118.21
其他负债	69,586.35
负债合计	775,333.71
所有者权益：	
实收基金	26,815,512.75
未分配利润	10,035,592.14
所有者权益合计	36,851,104.89
负债和所有者权益总计	37,626,438.60

注：截至2022年3月18日(基金最后运作日)，基金份额净值1.3742元，基金份额总额26,815,512.75份。

五、清算情况

自2022年3月19日至2022年4月8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，本基金清算费用将由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币13,321,691.33元，其中应计利息为人民币5,422.90元。清算期间银行存款变动金额为人民币3,124,330.45元，产生的计提利息为人民币2,958.51元，于2022年3月21日结息金额为人民币5,811.28元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币16,446,021.78元，其中银行存款利息余额为人民币2,570.13元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币81,529.31元，其中上海结算备付金为人民币41,526.35元，深圳结算备付金为人民币39,534.88元，应计利息共计人民币468.08元。清算期间转出上海结算备付金人民币30,995.45元，转出深圳结算备付金人民币25,701.46元，产生的计提利息共计人民币240.33元，于2022年3月21日结息金额为人民币479.03元。截至清算期结束日，结算备付金余额为人民币24,593.70元，其中结算备付金利息余额为人民币229.38元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币43,193.87元，其中上海存出保证金为人民币4,681.23元，深圳存出保证金为人民币5,891.44元，深港通风控资金为人民币32,586.84元，应计利息共计人民币34.36元。清算期间转入上海存出保证金人民币5,184.54元，转入深圳存出保证金人民币2,732.75元，转出深港通风控资金人民币32,586.84元，产生的计提利息共计人民币10.78元，于2022年3月21日结息金额为人民币35.80元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币18,499.30元，其中存出保证金利息余额为人民币9.34元。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币530,822.72元，该款项已于清算期间内划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币23,649,201.37元，全部为股票投资，于清算期间内处置变现，处置损益为人民币49,630.85元，产生的交易费用为人民币45,642.27元。

股票明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票代码	数量（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	隆基股份	601012	16,000.00	80.68	786,181.65	1,290,880.00
2	腾讯控股	00700	3,887.00	309.12	1,447,799.25	1,201,551.54
3	贵州茅台	600519	700.00	1,707.79	1,359,172.53	1,195,453.00
4	拓普集团	601689	20,200.00	58.31	1,079,563.50	1,177,862.00
5	立讯精密	002475	33,087.00	34.90	1,201,569.26	1,154,736.30
6	韦尔股份	603501	5,000.00	224.28	1,372,796.81	1,121,400.00
7	招商银行	600036	24,100.00	46.17	1,218,336.77	1,112,697.00
8	中天科技	600522	59,500.00	18.62	878,734.24	1,107,890.00
9	晶澳科技	002459	12,600.00	85.90	1,168,501.50	1,082,340.00
10	东方雨虹	002271	23,100.00	43.67	1,108,850.60	1,008,777.00
11	海格通信	002465	92,600.00	9.17	915,606.00	849,142.00
12	三峡水利	600116	74,600.00	11.32	850,280.89	844,472.00
13	药明康德	603259	7,900.00	103.62	993,132.66	818,598.00
14	宁德时代	300750	1,600.00	510.50	852,416.52	816,800.00
15	赣锋锂业	002460	6,200.00	127.01	904,042.67	787,462.00
16	时代电气	688187	11,096.00	68.36	733,379.44	758,522.56
17	山西汾酒	600809	2,700.00	274.34	832,717.95	740,718.00
18	金禾实业	002597	18,300.00	37.95	786,222.00	694,485.00
19	华鲁恒升	600426	21,500.00	32.25	712,384.74	693,375.00
20	闻泰科技	600745	6,500.00	103.71	710,716.12	674,115.00
21	苏博特	603916	26,700.00	21.45	706,363.00	572,715.00
22	大族激光	002008	14,500.00	39.36	723,271.16	570,720.00
23	中国移动	00941	12,500.00	42.92	512,641.92	536,498.58
24	天宇股份	300702	10,100.00	49.59	515,013.69	500,859.00
25	时代电气	03898	18,000.00	27.54	730,711.24	495,809.87
26	兖矿能源	600188	14,400.00	33.29	502,231.00	479,376.00
27	天合光能	688599	6,669.00	68.69	497,175.66	458,093.61
28	永兴材料	002756	3,300.00	124.44	484,973.00	410,652.00
29	天奈科技	688116	2,718.00	150.39	435,506.82	408,760.02
30	京东集团 - S W	09618	290.00	197.80	-	57,363.36
31	万控智造	603070	541.00	24.04	5,096.22	13,005.64
32	兴通股份	603209	425.00	21.52	9,146.00	9,146.00
33	鹿山新材	603051	191.00	25.79	4,925.89	4,925.89

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币606,532.05元，应付管理人报酬为人民币31,797.52元，应付托管费为人民币5,299.58元，应付证券清算款为人民币62,118.21元，该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69,586.35元，其中应付赎回费人民币186.35元和预提账户维护费人民币4,500.00元已于清算期间内支付；预提2021年度审计费人民币50,000.00元和预提信息披露费人民币14,900.00元将于完成付款流程后支付。

4、清算期间的清算损益情况

项目	自2022年3月19日 至2022年4月8日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	3,216.42
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	49,630.85
清算期间收益小计	52,847.27
二、清算期间支出	
银行划款费	325.00
股票交易费用	45,642.27
清算期间支出小计	45,967.27
三、清算期间净收益	6,880.00

注1：利息收入系计提的2022年3月19日至2022年4月8日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

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、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额
一、最后运作日2022年3月18日基金净资产	36,851,104.89
加：清算期间净收益	6,880.00
减：基金净赎回金额（于2022年3月21日确认的投资者赎回、转出申请）	20,433,790.11

二、清算结束日2022年4月8日基金净资产	16,424,194.78
-----------------------	---------------

资产处置及负债清偿后,2022年4月8日本基金剩余财产为人民币16,424,194.78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,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除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。

自清算起始日(2022年3月19日)至清算结束日(2022年4月8日)的银行存款等产生的利息已计入清算期间净收益,自清算期结束日次日(2022年4月9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,用以垫付应收利息及结算备付金等。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)《长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金清算审计报告》;
- (2)《上海源泰律师事务所关于长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》。

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。

长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金基金财产清算小组

2022年4月14日