

长盛同锦研究精选混合型证券投资基金

第二次清算报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022年8月25日

清算报告公告日期：2022年8月30日

一、重要提示

长盛同锦研究精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2018年6月27日经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1053号文准予募集注册，自2019年3月28日《长盛同锦研究精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）生效并正式运作，本基金基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

根据《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60个工作日出现前述情形的，可直接终止《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6月8日日终，本基金已连续60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。本基金管理人已于2022年6月9日在《证券日报》和基金管理人网站上（www.csfunds.com.cn）刊登了《长盛基金管理有限公司关于长盛同锦研究精选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》，具体详见基金管理人相关公告。

本基金最后运作日为2022年6月8日，自2022年6月9日（最后运作日的次日）起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国工商银行、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所于2022年6月9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，上海市海华永泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

本基金第一次清算期间为2022年6月9日至2022年6月15日。本基金的基金管理人于2022年6月24日对《长盛同锦研究精选混合型证券投资基金清算报告》进行了公告，并于2022年6月28日支付了第一次清算款。

本基金于2022年6月16日进入第二次清算期间，至2022年8月23日已完成所有资产变现，本次清算期间为2022年6月16日至2022年8月23日。

二、基金概况

基金名称	长盛同锦研究精选混合型证券投资基金
基金简称	长盛同锦混合
基金代码	006199
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年3月28日
第一次清算结束日（2022年6月15日）基金份额总额	4,984,282.62份
投资目标	本基金通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，臻选成长性和收入增长具有优势的行业和具有估值优势的个股，力争为投资者创造超过业绩基准的回报。
投资策略	本基金在传统的基本面分析框架的基础上，通过运用“三位一体”即3T投资方法论，对宏观基本面分析（Trend）、行业基本面分析（Theme）和个股基本面（Target）分析进行补充完善，臻选具有比较优势行业的投资价值较高的股票组建投资组合，并通过投研的双向反馈机制对股票初选池个股进行实时动态跟踪，根据市场变化及时调整组合配置。
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	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

长盛同锦研究精选混合型证券投资基金2018年6月27日经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1053号文准予注册募集，于2019年3月28日成立并正式运作，首次设立募集规模为329,686,082.58份基金份额（含利息结转份额）。

根据《长盛同锦研究精选混合型证券投资基金基金合同》“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60个工作日出现前述情形的，可直接终止《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6月8日日终，本基金已连续60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6月8日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2022年6月9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

第一次清算结束日资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛同锦研究精选混合型证券投资基金

报告截止日：2022年6月15日（第一次清算结束日）

金额单位：人民币元

科目名称	第一次清算结束日 (2022年6月15日)
资 产：	
银行存款	7,231,416.45
结算备付金	42,254.16
存出保证金	70,036.18
交易性金融资产	136,115.98
应收清算款	10,179.50
资产总计	7,490,002.27
负债和所有者权益	
负 债：	
其他负债	103,224.18
负债合计	103,224.18
所有者权益：	

实收基金	4,984,282.62
未分配利润	2,402,495.47
所有者权益合计	7,386,778.09
负债和所有者权益总计	7,490,002.27

注：截至2022年6月15日(第一次清算结束日)，基金份额净值1.4820元，基金份额总额4,984,282.62份。

五、清算情况

由于本基金于2022年6月15日（第一次清算结束日）仍持有处于锁定期内尚未变现的流通受限股票导致部分资产尚未变现，故需进行第二次清算。本次清算为本基金的第二次清算，清算期间为2022年6月16日至2022年8月23日。基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行第二次清算，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）本基金第一次清算结束日银行存款为人民币7,231,416.45元，其中包含应计利息人民币4,240.25元。第二次清算期间产生支付第一次清算款、变现交收以及支付税费等资金变动共计减少银行存款人民币6,930,570.74元；第二次清算期间计提的银行存款利息为人民币1,038.25元，并于2022年6月21日结息转出应计利息人民币4,662.68元。截至第二次清算期结束日，银行存款余额为人民币297,221.28元，其中应计银行存款利息人民币615.82元。该应计银行存款利息将于第二次清算期结束后由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）本基金第一次清算结束日结算备付金为人民币42,254.16元，其中上海结算备付金为人民币28,289.95元，应计利息为人民币121.35元；深圳结算备付金为人民

币13,702.69元，应计利息为人民币140.17元。第二次清算期间上海结算备付金转入基金托管户人民币28,289.95元，深圳结算备付金转入托管户13,702.69元，共计提利息人民币47.80元，并于2022年6月21日结息转出结算备付金利息人民币272.86元。截至第二次清算期结束日，结算备付金余额为人民币36.46元，全部为应计结算备付金利息。该款项将于第二次清算期结束后由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) 本基金第一次清算结束日存出保证金为人民币70,036.18元，其中上海存出保证金为人民币27,728.09元，应计利息为人民币143.94元；深圳存出保证金为人民币41,927.56元，应计利息为人民币236.59元。第二次清算期间上海存出保证金转入基金托管户人民币27,728.09元，深圳存出保证金转入基金托管户人民币41,927.56元；共计提利息人民币59.66元，并于2022年6月21日结息转出存出保证金利息人民币399.37元。截至第二次清算期结束日，存出保证金余额为人民币40.82元，全部为应计存出保证金利息。该款项将于第二次清算期结束后由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) 本基金第一次清算结束日持有的交易性金融资产为人民币 136,115.98 元，全部为股票投资。明细如下：

金额单位：人民币元

股票名称	股票代码	数量 (单位：股)	第一次清算 结束日估值 单价	第一次清算结 束日成本总额	第一次清算结 束日估值总额
亚信安全	688225 SH	1,871.00	20.00	57,084.21	37,420.00
创耀科技	688259 SH	559.00	81.03	37,229.40	45,295.77
中触媒	688267 SH	808.00	34.06	33,855.20	27,520.48
百诚医药	301096 SZ	48.00	69.46	3,820.80	3,334.08
风光股份	301100 SZ	176.00	22.00	4,894.56	3,872.00
明月镜片	301101 SZ	193.00	46.79	5,193.63	9,030.47
亨迪药业	301211 SZ	261.00	20.38	6,733.80	5,319.18
光庭信息	301221 SZ	80.00	54.05	5,591.20	4,324.00

以上股票投资于 2022 年 6 月 16 日至 2022 年 8 月 23 日处置变现。处置净损益为人民币-3020.78 元，处置期间产生的交易费用为人民币 266.12 元。

(5) 本基金第一次清算结束日应收清算款为人民币10,179.50元，已于第二次清

算期间收回。

3、负债清偿情况

本基金第一次清算结束日其他负债为人民币103,224.18元,其中应付交易费用人民币56,224.18元、预提信息披露费人民币47,000.00元。截至第二次清算期结束日,上述应付交易费用已于第二次清算期间支付,预提信息披露费将于本次清算结束后支付。

4、第二次清算期间的清算损益情况

金额单位:人民币元

项目	自2022年6月16日 至2022年8月23日止的第二次 清算期间
一、第二次清算期间收益 (损失以“-”填列)	
利息收入(注1)	1,145.11
处置交易性金融资产产生的净损益(注2)	-3,020.78
第二次清算期间收益小计	-1,875.67
二、第二次清算期间支出	
银行划款费	206.22
股票交易费用	266.12
第二次清算期间支出小计	472.34
三、第二次清算期间净损益	-2,348.01

注1:利息收入系计提的自2022年6月16日至2022年8月23日止第二次清算期间的银行存款利息收入、结算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损益系第二次清算期间交易性金融资产变现损益人民币-3,710.34元、第二次清算期间交易性金融资产分红派息人民币791.48元和红利补税人民币-101.92元。

5、截至本次清算期结束日的剩余资产分配情况

金额单位:人民币元

项目	金额
一、第一次清算结束日2022年6月15日基金净资产	7,386,778.09
加:第二次清算期间净损益	-2,348.01

减：划付第一次清算金额	7,134,131.52
二、第二次清算期结束日2022年8月23日基金净资产	250,298.56

截至第二次清算期结束日 2022 年 8 月 23 日，本基金剩余财产为人民币 250,298.56 元，根据本基金的基金合同约定，基金财产清算小组将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。

自第二次清算期起始日（2022 年 6 月 16 日）至第二次清算期结束日（2022 年 8 月 23 日）的银行存款等产生的利息已计入第二次清算期间净损益，自第二次清算期结束日次日（2022 年 8 月 24 日）至第二次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，用以垫付应计银行存款利息、应计结算备付金利息及应计存出保证金利息。基金管理人所垫付的资金及垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，并于第二次清算期后返还基金管理人，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) 《长盛同锦研究精选混合型证券投资基金第二次清算报表审计报告》；
- (2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛同锦研究精选混合型证券投资基金第二次清算报告>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。

长盛同锦研究精选混合型证券投资基金基金财产清算小组

2022年8月30日