

# 长江量化匠心甄选股票型证券投资基金

## 清算报告

基金管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年02月06日

清算报告公告日：2023年02月16日

## 一、重要提示

长江量化匠心甄选股票型证券投资基金（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【2018】2079号文《关于准予长江量化匠心甄选股票型证券投资基金注册的批复》准予注册，由长江证券（上海）资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规的规定和《长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的约定公开募集。经向中国证监会备案，《长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金合同》于2019年4月25日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券（上海）资产管理有限公司，本基金的基金托管人为平安银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条的规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。根据《长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金合同》“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的“二、《基金合同》的终止事由”中约定，“有下列情形之一的，《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《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人已于2022年12月21日刊登了《长江证券（上海）资产管理有限公司关于以通讯方式召开长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并分别于2022年12月22日、2022年12月23日刊登了《长江证券（上海）资产管理有限公司关于以通讯方式召开长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》和《长江证券（上海）资产管理有限公司关于以通

讯方式召开长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告》。本次基金份额持有人大会于2023年1月31日计票，表决通过了《关于终止长江量化匠心甄选股票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，基金管理人于2023年2月1日刊登了《长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金自2023年2月2日起进入清算期。由基金管理人长江证券（上海）资产管理有限公司、基金托管人平安银行股份有限公司、中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所成立的基金财产清算小组履行基金财产清算程序，基金财产清算报告由中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）审计并由上海市通力律师事务所出具法律意见书。

## 二、基金概况

基金简称	长江量化匠心甄选
基金主代码	006911
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年04月25日
基金最后运作日（2023年2月1日）基金份额总额	6,306,469.93 份
投资目标	本基金以量化模型为基础，在有效控制投资风险的前提下，力求实现健康、稳定的超越业绩比较基准的投资回报，追求资产的长期增值。
投资策略	本基金利用量化投资模型，在严格控制投资风险的前提下，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长江量化匠心甄选A	长江量化匠心甄选C
下属分级基金的交易代码	006911	006957
基金最后运作日（2023年2月1日）下属分级基金的份额总额	636,590.94 份	5,669,878.99 份

### 三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2018】2079号文注册募集。由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2019年2月20日至2019年4月18日期间向社会公开募集。基金合同于2019年4月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为214,889,356.08份，其中募集期间净认购资金折合基金份额214,868,981.20份，认购资金在募集期间产生的利息结转的份额20,374.88份。自2019年4月25日至2023年2月1日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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，经本基金基金份额持有人大会2023年1月31日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于2023年2月1日刊登了《长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金自2023年2月2日起进入清算期。

### 四、财务会计报告

#### 资产负债表（已经审计）

会计主体：长江量化匠心甄选股票型证券投资基金

报告截止日：2023年02月01日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日
----	-------

	2023年02月01日
<b>资产：</b>	
银行存款	719,978.40
结算备付金	42,695.58
存出保证金	6,180.00
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	6,544,232.76
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	7,313,086.74
<b>负债和净资产</b>	<b>最后运作日</b> <b>2023年02月01日</b>
<b>负债：</b>	
短期借款	-

交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	32,314.88
应付管理人报酬	9,446.35
应付托管费	1,259.51
应付销售服务费	3,389.65
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	64,725.69
负债合计	111,136.08
<b>净资产：</b>	
实收基金	6,306,469.93
其他综合收益	-
未分配利润	895,480.73
净资产合计	7,201,950.66
负债和净资产总计	7,313,086.74

注：报告截止日2023年2月1日(基金最后运作日)，基金份额总额6,306,469.93份，其中A类基金份额净值1.1680元，基金份额636,590.94份；C类基金份额净值1.1391元，基金份额5,669,878.99份。

## 五、清算情况

自2023年2月2日至2023年2月3日止为清算期间，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《长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金合同》“第十九部分

基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，“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。”考虑到基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，清算律师费和审计费由基金管理人承担。

## 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币42,695.58元（含应计利息），其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金人民币42,621.85元，该款项按照结算规则，于2023年2月8日划回基金托管户；应计结算备付金利息为人民币73.73元，预计于2023年3月21日季度结息日划至基金托管户，该款项将由基金管理人长江证券（上海）资产管理有限公司先行垫付，并于清算款划出日前划入托管户，垫付资金到账日起孳生的利息归长江证券（上海）资产管理有限公司所有。

(2) 本基金最后运作日结算保证金为人民币6,180.00元（含应计利息），其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金人民币6,170.34元，该款项按照结算规则，于2023年2月2日划回基金托管户；应计存出保证金利息为人民币9.66元，预计于2023年3月21日季度结息日划至基金托管户，该款项将由基金管理人长江证券（上海）资产管理有限公司先行垫付，并于清算款划出日前划入托管户，垫付资金到账日起孳生的利息归长江证券（上海）资产管理有限公司所有。

(3) 本基金最后运作日应计活期存款利息为人民币722.46元，上述款项预计于2023年3月21日季度结息日划至基金托管户。上述款项将由基金管理人长江证券（上海）资产管理有限公司先行垫付，并于清算款划出日前划入托管户，垫付资金到账日起孳生的利息归长江证券（上海）资产管理有限公司所有。

(4) 本基金最后运作日证券清算款为人民币6,544,232.76元，已于2023年2月2日划回基金托管户。

## 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32,314.88元，已于2023年2月2日支付完毕。

(2) 本基金最后运作日应付管理费为人民币9,446.35元,已于2023年2月2日支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,259.51元,已于2023年2月2日支付完毕。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费3,389.65元,已于2023年2月2日支付完毕。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用4,725.69元,已于2023年2月2日支付完毕。

(6) 本基金最后运作日预提费用为人民币60,000.00元,系2022年产品年审费用,已于2023年2月3日支付完毕。

#### 4、清算期间损益情况

单位:人民币元

项目	自2023年2月2日至2023年2月3日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注1)	143.12
清算收益小计	143.12
二、清算费用	
1、交易费用(注2)	576.00
清算费用小计	576.00
三、清算期间净收益	-432.88

注1:利息收入为自2023年2月2日至2023年2月3日止清算期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入和结算保证金利息收入。

注2:交易费用为自2023年2月2日至2023年2月3日止清算期间的股票红利补缴税费,已于2023年2月3日支付完成。

#### 5、资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位:人民币元

项目	金额
----	----



一、最后运作日2023年2月1日基金净资产	7,201,950.66
加：清算报告期间净收益	-432.88
减：2023年2月2日确认的赎回金额（含费用）	47,948.59
二、清算结束日2023年2月3日基金净资产	7,153,569.19

资产处置及负债清偿后，截至2023年2月3日本基金剩余财产为人民币7,153,569.19元。根据《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用（考虑到基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，清算律师费和审计费由基金管理人承担）、缴纳所欠税款并清偿基金债务后，将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日2023年2月2日至清算款划出日前一日产生的存款利息亦属于基金份额持有人所有，以上利息均按当前适用的利率预估。基金管理人将于清算款划出日前以自有资金划入基金托管户用以垫付应收银行存款利息、应收结算备付金利息及应收结算保证金利息等，基金管理人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。

#### 6、基金财产清算的公告

本清算报告已经基金托管人复核，经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，将报中国证监会备案并公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- (1) 《长江量化匠心甄选股票型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈长江量化匠心甄选股票型证券投资基金清算报告〉的法律意见》。

### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

长江量化匠心甄选股票型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二三年二月十六日