

长盛安悦一年持有期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：2024年12月25日

清算报告公告日期：2024年12月27日

重要提示

长盛安悦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”）2022年11月15日《关于准予长盛安悦一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2022〕2856号文）注册募集，于2023年7月25日成立并正式运作，基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

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50个工作日出现前述情形的，可直接终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。”

截至2024年11月20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，触发《基金合同》中约定的《基金合同》终止条款。本基金最后运作日为2024年11月20日，自最后运作日的下一日（即2024年11月21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2024年11月21日刊登在《上海证券报》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安悦一年持有期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》。

本基金最后运作日为2024年11月20日，自2024年11月21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）和上海市海华永泰律师事务所于2024年11月21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。

二、基金概况

基金名称	长盛安悦一年持有期混合型证券投资基金
------	--------------------

基金简称	长盛安悦一年持有
基金代码	A类：017713 C类：017714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年7月25日
基金最后运作日（2024年11月20日）基金份额总额	11,138,357.75份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他依法发行上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的投资组合比例为：股票、可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）资产投资占基金资产的比例为10%-30%(其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的50%)；同业存单投资占基金资产的比例不超过20%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。</p>
主要投资策略	在大类资产配置中，本基金将主要考虑：宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，并借鉴组合保险策略确

	<p>定并调整基金资产的配置比例。本基金的资产配置是一个动态过程，在投资组合保险策略的基础上，同时结合股债收益差，深入分析市场走势，对基金投资组合情况进行动态评估，对基金资产配置情况进行不定期调整。</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>本基金的股票投资通过对经济发展趋势、产业政策、行业景气度及股债收益比等方面研究，深度挖掘行业周期轮动规律，并结合红利策略，动态配置于优势行业中的优势上市公司。为降低组合中长期回撤和收益振幅、提升投资者体验，本基金对单一行业的权重进行动态跟踪和合理约束。</p> <p>股指期货、国债期货投资将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合对期货合约的估值定价，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率×15%+中证综合债指数收益率×80%+恒生综合指数收益率×5%
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。</p> <p>本基金如果投资港股通标的股票，需承担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。</p>
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

长盛安悦一年持有期混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会2022年11月15日《关于准予长盛安悦一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2022〕2856号文）注册募集，募集期自2023年5月12日至2023年7月21日止，《基金合同》于2023年7月25日生效，基金合同生效日的基金份额总额为250,564,946.77份。自2023年7月25日至2024年11月20日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

根据《基金合同》以及《长盛基金管理有限公司关于长盛安悦一年持有期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》，自2024年11月21日起，本基金进入清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛安悦一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024年11月20日（基金最后运作日）

金额单位：人民币元

科目名称	最后运作日 (2024年11月20日)
资产：	
银行存款	145,118.09
结算备付金	106,003.06
存出保证金	28,755.35
交易性金融资产	17,256,274.74
应收证券清算款	2,062,679.76
资产总计	19,598,831.00
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	7,703,756.45
应付管理人报酬	8,640.83
应付托管费	1,152.10
应付销售服务费	2,101.59
应交税费	346.02
其他负债	121,646.89
负债合计	7,837,643.88
所有者权益：	
实收基金	11,138,357.75
未分配利润	622,829.37
所有者权益合计	11,761,187.12
负债和所有者权益总计	19,598,831.00

注：截至2024年11月20日(基金最后运作日)，本基金基金份额总额11,138,357.75份，其中长盛安悦一年持有混合A基金份额净值1.0584元，份额总额5,397,252.84份；长盛安悦一年持有混合C基金份额净值1.0536元，份额总额5,741,104.91份。

五、清算情况

自2024年11月21日至2024年12月25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，本基金清算费用中的律师费部分由基金管理人承担，不从基金财产中支付。其他清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币145,118.09元，其中应计利息为人民币592.90元。清算期间银行存款变动金额为人民币10,090,716.19元，清算期间增加的银行存款利息为人民币1,974.88元，收到银行存款利息人民币2,169.74元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币10,235,834.28元，其中银行存款应计利息余额为人民币398.04元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币106,003.06元，其中上海结算备付金为人民币100,229.22元，应计利息为人民币203.40元；深圳结算备付金为人民币5,557.60元，应计利息为人民币12.84元。清算期间自上海结算备付金账户划入托管账户人民币50,121.08元，自深圳结算备付金账户划入托管账户人民币3,007.21元，结算备付金共增加利息人民币128.41元，收到结算备付金利息至托管账户人民币335.21元。截至清算期结束日，结算备付金余额为人民币52,667.97元，其中结算备付金应计利息为人民币9.44元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币28,755.35元，其中上海存出保证金为人民币21,626.39元，应计利息人民币38.50元；深圳存出保证金为人民币7,075.76元，应计利息人民币14.70元。清算期间自托管账户划入上海存出保证金账户人民币5,210.18元，自深圳存出保证金账户划入托管账户人民币275.83元，存出保证金共增加利息人民币50.27元，收到存出保证金利息至托管账户人民币97.39元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币33,642.58元，其中存出保证金利息余额为人民币

6.08元。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币17,256,274.74元，其中股票投资为人民币3,747,428.00元，债券投资为人民币13,508,846.74元。

股票投资明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票代码	数量 (单位：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	招商银行	600036	20,000.00	37.48	639,284.41	749,600.00
2	贵州茅台	600519	400.00	1,544.81	661,065.67	617,924.00
3	美的集团	000333	7,000.00	71.43	447,238.79	500,010.00
4	立讯精密	002475	10,000.00	38.59	310,579.83	385,900.00
5	中国移动	600941	3,000.00	103.88	300,500.83	311,640.00
6	中国太保	601601	8,000.00	35.12	304,809.09	280,960.00
7	山西汾酒	600809	1,000.00	210.00	230,707.15	210,000.00
8	德业股份	605117	1,200.00	93.84	105,917.00	112,608.00
9	宁德时代	300750	400.00	267.55	68,295.70	107,020.00
10	伯特利	603596	1,800.00	48.61	100,036.61	87,498.00
11	比亚迪	002594	300.00	288.46	63,062.40	86,538.00
12	山推股份	000680	7,000.00	9.77	64,016.84	68,390.00
13	中国电信	601728	10,000.00	6.63	64,210.61	66,300.00
14	新易盛	300502	400.00	126.47	50,061.14	50,588.00
15	伊之密	300415	1,800.00	22.73	44,597.37	40,914.00
16	润泽科技	300442	1,200.00	32.70	30,843.54	39,240.00
17	三环集团	300408	600.00	37.20	21,726.00	22,320.00
18	奥特维	688516	200.00	49.89	10,696.00	9,978.00

债券投资明细如下：

金额单位：人民币元

序号	债券名称	债券代码	数量	最后运作日 估值单价(含 应计利息)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额 (含应计利息)
1	24 国债 15	019749	40,000.00	100.43	3,999,773.00	4,017,335.89
2	24 国债 21	019758	30,000.00	100.08	2,998,136.00	3,002,351.51
3	24 国债 08	019739	13,000.00	102.74	1,315,405.00	1,335,563.01
4	24 国债 02	019733	11,000.00	101.71	1,102,878.07	1,118,820.55
5	华电 YK09	241616	10,000.00	100.08	1,000,106.52	1,000,813.97

6	23 鞍钢 KY04	148387	10,000.00	103.02	998,017.13	1,030,170.41
7	24 中建四局 MTN002(科创 票据)	102484532	10,000.00	100.38	1,000,014.74	1,003,809.81
8	24 华股 03	148839	10,000.00	100.00	1,000,088.55	999,981.59

以上交易性金融资产于2024年11月21日至2024年12月25日止清算期间内处置变现，其中，股票投资处置净损益为人民币47,491.82元，债券投资处置净损益为人民币8,053.54元，清算期间产生的利息收入为人民币4,076.53元。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币2,062,679.76元，该款项已于清算期间内划入托管账户。

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7,703,756.45元，应付管理人报酬为人民币8,640.83元，应付托管费为人民币1,152.10元，应付销售服务费人民币2,101.59元，应交税费人民币346.02元。上述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121,646.89元，其中预提账户维护费和上海清算所查询服务费为人民币6,200.00元、应付交易费用为人民币5,446.89元，已于清算期间内支付；预提审计费为人民币10,000.00元、预提信息披露费为人民币100,000.00将于完成付款流程后支付。

4、清算期间的清算损益情况

金额单位：人民币元

项目	自2024年11月21日 至2024年12月25日止清算 期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	2,153.56
投资收益（注2）	59,621.89
清算期间收益小计	61,775.45
二、清算期间支出	
税金及附加	1.52
银行汇划费	461.29
清算期间支出小计	462.81

三、清算期间净损益	61,312.64
-----------	-----------

注1:利息收入系计提的2024年11月21日至2024年12月25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存出保证金利息收入。

注2:投资收益系清算期间交易性金融资产处置净损益和债券投资利息收入。

5、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

金额单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2024年11月20日基金净资产	11,761,187.12
加：清算期间净损益	61,312.64
减：基金净赎回金额（于2024年11月21日确认的投资者净赎回申请）	1,610,569.93
二、清算结束日2024年12月25日基金净资产	10,211,929.83

注：截至2024年12月25日(清算结束日)，本基金基金份额总额9,614,840.30份，其中长盛安悦一年持有混合A基金份额净值1.0648元，份额总额4,273,935.64份；长盛安悦一年持有混合C基金份额净值1.0599元，份额总额5,340,904.66份。

资产处置及负债清偿后，2024年12月25日本基金剩余财产为人民币10,211,929.83元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组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基金财产清算费用（由本基金管理人承担的部分除外）、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（2024年11月21日）至清算结束日（2024年12月25日）的银行存款、存出保证金、结算备付金等资产产生的利息已计入清算期间净收益，自清算期结束日次日（2024年12月26日）至清算款划出前一日的银行存款、存出保证金、结算备付金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，用以垫付应计利息及存出保证金等。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) 《长盛安悦一年持有期混合型证券投资基金清算报表审计报告》；
- (2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛安悦一年持有期混合型证券投资基金清算报告>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。

长盛安悦一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年12月27日