

长盛先进制造六个月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：中信银行股份有限公司

清算报告出具日期：2025 年 5 月 21 日

清算报告公告日期：2025 年 5 月 27 日

一、重要提示

长盛先进制造六个月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”）2021年12月13日《关于准予长盛先进制造六个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2021〕3906号文）注册募集，于2022年3月15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”），基金托管人为中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）。

根据《长盛先进制造六个月持有期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，基金管理人可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至2025年5月7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2025年5月7日，自最后运作日的下一日（即2025年5月8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2025年5月8日刊登在《上海证券报》和本基金管理人网站（www.csfund.com.cn）上的《长盛基金管理有限公司关于长盛先进制造六个月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2025年5月7日，自2025年5月8日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中信银行、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2025年5月8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	长盛先进制造六个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	长盛先进制造六个月持有混合
基金代码	A类：014695 C类：014696
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年3月15日
基金最后运作日（2025年5月7日）基金份额总额	50,060,061.62份
投资目标	本基金主要投资于先进制造相关行业的股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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（含创业板及其他依法发行上市股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据及其他经中国证监会允许基金投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、资产支持证券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。本基金投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为60%-95%，本基金投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的50%，投资于本基金界定的先进制造相关证券的比例不低于非现金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限</p>

	制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金将通过宏观、微观经济指标，市场指标，政策因素等，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。本基金所定义的先进制造是指在制造业中具备长期成长空间、产业拉动较广且对经济社会长远发展具有重大引领带动作用的行业领域，重点关注传统基础制造业中呈现电动化、电气化、自动化、信息化、智能化趋势的相关领域，以及代表新经济发展方向的战略新兴产业相关领域。这些行业长期成长空间较大且具有创新驱动动力，可实现核心技术突破或终端产品创新，具备全球国际化竞争力。具体相关行业主要包括：申银万国一级行业分类标准中的计算机、通信、电子、传媒、医药、机械设备、化工、有色、国防军工、汽车、电力设备、轻工制造、家电行业等。未来由于经济增长方式转变、产业结构升级、人口红利变化等因素，从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大，基金管理人在履行适当程序后可视实际情况对上述界定进行调整和修订。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。本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股指期货、国债期货、股票期权交易。
业绩比较基准	申银万国制造业指数收益率*60%+恒生综合指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。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。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

长盛先进制造六个月持有期混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会2021年12月13日《关于准予长盛先进制造六个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2021〕3906号文）注册募集，募集期自2022年2月21日至2022年3月11日止，《基金合同》于2022年3月15日生效，基金合同生效日的基金份额总

额为222,461,733.81份。

根据基金管理人于2025年5月8日发布的《长盛基金管理有限公司关于长盛先进制造六个月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》，截至2025年5月7日日终，本基金的基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元，已触发《基金合同》终止的情形，根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止基金合同。本基金的最后运作日为2025年5月7日，并于2025年5月8日起，本基金进入清算程序。

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：长盛先进制造六个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2025年5月7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 (2025年5月7日)
资产：	
银行存款	5,265,361.06
结算备付金	42,485.01
交易性金融资产	22,522,353.68
应收申购款	897.98
资产总计	27,831,097.73
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	3,695,493.63
应付管理人报酬	7,144.47
应付托管费	1,190.74
应付销售服务费	290.76
其他负债	41,068.06
负债合计	3,745,187.66
所有者权益：	
实收基金	50,060,061.62
未分配利润	-25,974,151.55

所有者权益合计	24,085,910.07
负债和所有者权益总计	27,831,097.73

注：截至2025年5月7日(基金最后运作日)，本基金基金份额总额50,060,061.62份，其中长盛先进制造六个月持有混合A基金份额净值0.4819元，份额总额37,711,810.00份；长盛先进制造六个月持有混合C基金份额净值0.4789元，份额总额12,348,251.62份。

五、清算情况

自2025年5月8日至2025年5月21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) 本基金最后运作日货币资金为人民币5,265,361.06元，其中包含银行存款人民币2,247,504.34元，应计银行存款利息人民币132.09元，券商结算资金人民币3,017,424.30元，应计券商结算资金利息人民币300.33元。清算期间产生变现交收、支付费用等资金变动共计增加银行存款人民币15,304,448.94元，减少券商结算资金人民币3,017,424.30元；清算期间增加计提的银行存款利息为人民币304.34元，增加计提的券商结算资金账户利息为人民币144.75元，收到券商结算资金账户利息人民币445.08元。截至清算期结束日，货币资金余额为人民币17,552,389.71元，其中银行存款为人民币17,551,953.28元，应计银行存款利息人民币436.43元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币42,485.01元，其中期货结算备付金为人民币42,469.84元，应计利息为人民币15.17元。清算期间期货结算备付金账户划

入托管账户人民币42,469.84元，期货结算备付金账户共增加利息人民币3.28元，收到期货结算备付金利息至托管账户人民币18.45元。截至清算期结束日，结算备付金无余额。

(3) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币22,522,353.68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)	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
东睦股份	600114 SH	18,600.00	21.04	405,179.00	391,344.00
旭光电子	600353 SH	54,900.00	9.12	460,444.00	500,688.00
联创光电	600363 SH	6,500.00	57.59	375,717.00	374,335.00
万朗磁塑	603150 SH	17,500.00	31.44	534,816.00	550,200.00
众辰科技	603275 SH	13,400.00	38.20	546,574.00	511,880.00
大业股份	603278 SH	62,400.00	10.29	731,237.00	642,096.00
顶点软件	603383 SH	6,800.00	41.53	287,732.00	282,404.00
信捷电气	603416 SH	13,300.00	60.67	504,205.80	806,911.00
科博达	603786 SH	22,900.00	54.16	1,431,514.00	1,240,264.00
国茂股份	603915 SH	9,900.00	16.65	189,761.00	164,835.00
神通科技	605228 SH	72,000.00	11.54	937,582.00	830,880.00
圣泉集团	605589 SH	5,400.00	27.29	129,340.55	147,366.00
中望软件	688083 SH	4,350.00	95.08	381,721.16	413,598.00
虹软科技	688088 SH	9,790.00	47.30	486,876.66	463,067.00
福昕软件	688095 SH	7,896.00	69.45	627,210.25	548,377.20
天奈科技	688116 SH	30,000.00	44.04	1,173,137.91	1,321,200.00
优刻得	688158 SH	9,153.00	22.86	285,945.37	209,237.58
联瑞新材	688300 SH	10,735.00	56.55	651,963.32	607,064.25
致远互联	688369 SH	17,496.00	29.86	508,534.48	522,430.56
合合信息	688615 SH	5,047.00	245.11	1,326,358.67	1,237,070.17
盛邦安全	688651 SH	12,050.00	34.00	475,745.82	409,700.00
海优新材	688680 SH	7,250.00	37.26	283,164.78	270,135.00
国光电气	688776 SH	7,938.00	90.40	534,572.44	717,595.20
智微智能	001339 SZ	5,800.00	54.85	310,558.00	318,130.00
奥飞娱乐	002292 SZ	61,100.00	8.87	604,170.00	541,957.00
焦点科技	002315 SZ	12,600.00	43.10	579,467.00	543,060.00
王子新材	002735 SZ	41,300.00	10.04	378,297.00	414,652.00
蓝黛科技	002765 SZ	39,500.00	15.79	392,067.00	623,705.00

微光股份	002801 SZ	10,200.00	34.40	326,326.00	350,880.00
科达利	002850 SZ	4,700.00	127.69	627,079.00	600,143.00
豆神教育	300010 SZ	50,000.00	7.65	395,650.00	382,500.00
迪安诊断	300244 SZ	30,000.00	14.80	549,015.00	444,000.00
卫宁健康	300253 SZ	40,800.00	10.30	480,211.00	420,240.00
鼎捷数智	300378 SZ	8,000.00	37.30	315,936.00	298,400.00
创业慧康	300451 SZ	97,800.00	5.81	629,389.00	568,218.00
深信服	300454 SZ	4,200.00	97.51	435,147.00	409,542.00
中科创达	300496 SZ	7,500.00	57.32	502,704.00	429,900.00
万兴科技	300624 SZ	4,700.00	60.80	367,672.00	285,760.00
龙磁科技	300835 SZ	10,600.00	35.87	423,726.00	380,222.00
首都在线	300846 SZ	10,200.00	19.93	286,368.00	203,286.00
易点天下	301171 SZ	9,600.00	27.43	288,858.00	263,328.00
朗威股份	301202 SZ	11,900.00	41.58	552,314.00	494,802.00
软通动力	301236 SZ	4,000.00	60.23	265,624.00	240,920.00
星源卓镁	301398 SZ	16,800.00	54.80	1,002,987.00	920,640.00
金蝶国际	00268 HK	18,000.00	12.52	221,866.86	225,390.72

以上股票投资于2025年5月8日至2025年5月21日清算期间处置变现,处置净损益为人民币2,950.77元。

(4) 本基金最后运作日应收申购款为人民币897.98元,已于清算期间收回。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款人民币3,695,493.63元、应付管理人报酬人民币7,144.47元、应付托管费人民币1,190.74元、应付销售服务费人民币290.76元。上述应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和应付销售服务费已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币41,068.06元,其中应付赎回费人民币3,632.20元、预提审计费人民币9,600.00元、预提信息披露费人民币27,835.86元。清算期间预提银行汇划费人民币597.97元,上述应付赎回费已于清算期间支付,预提审计费、预提信息披露费和预提银行汇划费将于完成相应流程后支付。

4、清算期间的清算损益情况

金额单位: 人民币元

项目	自2025年5月8日至2025年5月21日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	452.37
投资收益（注2）	2,950.77
清算期间收益小计	3,403.14
二、清算期间支出	
其他费用（注3）	597.97
清算期间支出小计	597.97
三、清算期间净损益	2,805.17

注1：利息收入系计提的2025年5月8日至2025年5月21日止清算期间的银行存款利息收入、券商结算资金账户利息收入、期货结算备付金利息收入。

注2：投资收益系清算期间交易性金融资产处置净损益。

注3：其他费用系根据托管户最新收费标准预提的银行汇划费，实际产生的金额可能与预估金额存在差异，差异部分由基金管理人承担。

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2025年5月7日基金净资产	24,085,910.07
加：清算期间净损益	2,805.17
减：基金净赎回金额（于2025年5月8日确认的投资者净赎回申请）	6,574,359.36
二、清算结束日2025年5月21日基金净资产	17,514,355.88

注：截至2025年5月21日(清算结束日)，本基金基金份额总额36,403,384.96份，其中长盛先进制造六个月持有混合A基金份额净值0.4820元，份额总额26,319,512.64份；长盛先进制造六个月持有混合C基金份额净值0.4789元，份额总额10,083,872.32份。

资产处置及负债清偿后，2025年5月21日本基金剩余财产为人民币17,514,355.88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（2025年5月8日）至清算结束日（2025年5月21日）的银行存款、券商结算资金账户、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（2025年5月22日）至清算款划出前一日的银行存款产生的利息亦归基金份额持有人所有。基金财产清算完毕之后所产生的其他任何费用由基金管理人承担。

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）《长盛先进制造六个月持有期混合型证券投资基金清算审计报告》；
- （2）《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛先进制造六个月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。

长盛先进制造六个月持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

报告出具日期：2025年5月21日

报告公告日期：2025年5月27日