

长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金  
清算报告

2018年11月16日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：徽商银行股份有限公司

公告日期：2018年12月6日

## 一、重要提示

长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“长盛盛鑫”或“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可〔2015〕2119号和中国证监会证券投资基金机构监管部《关于长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函〔2016〕859号）准予募集，并于2016年7月13日成立并正式运作，基金托管人为徽商银行股份有限公司（以下简称“徽商银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）和《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，长盛基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）经与本基金的基金托管人徽商银行协商一致，由基金管理人召集，本基金基金份额持有人大会于2018年9月24日至2018年10月26日以通讯方式召开，并于2018年10月29日对本次持有人大会投票进行了统计，大会审议通过了《关于终止长盛盛鑫灵活配置混合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2018年10月30日在指定媒介和基金管理人网站（[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)）上发布了《长盛盛鑫灵活配置混合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2018年10月30日起进入清算期，由基金管理人长盛基金管理有限公司、基金托管人徽商银行、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所于同日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所（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

1、基金名称：长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金（基金简称：长盛盛鑫混合。A类基金份额，基金代码：002089；C类基金份额，基金代码：002090）

2、基金运作方式：契约型开放式

3、基金合同生效日：2016年7月13日

4、2018年10月29日（基金最后运作日）基金份额总额：3,567,991.40份，其中A类基金份额3,227,272.86份，C类基金份额340,718.54份。

5、投资目标：通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在有效控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。

6、投资策略：本基金的投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。围绕着这三个层次的投资策略，基金管理人还将充分运用市场上各种金融投资工具，结合投资策略的需要，通过合理有效的金融模型分析，积极发掘低风险投资机会和锁定套利收益。

7、业绩比较基准：50%\*沪深300 指数收益率+50%\*中证综合债指数收益率。

8、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。

9、基金管理人：长盛基金管理有限公司

10、基金托管人：徽商银行股份有限公司

### 三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可〔2015〕2119号和中国证监会证券投资基金机构监管部《关于长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函〔2016〕859号）准予募集，由基金管理人于2016年7月8日至2016年7月11日向社会公开发行募集，《基金合同》于2016年7月13日正式生效，首次设立募集规模为200,797,066.85份基金份额（含利息结转份额）。自2016年7月13日至2018年10月29日期间，本基金按《基金合同》正常运作。

根据《基金法》《运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，本基金基金份额持有人大会以通讯方式于2018年9月24日至2018年10月26日召开，并于2018年10月29日对本次持有人大会投票进行了统计，大会审议并通过了《关于终止长盛盛鑫灵活配置混合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2018年10月30日在指定媒介和基金管理人网站

（[www.csfunds.com.cn](http://www.csfunds.com.cn)）上发布了《长盛盛鑫灵活配置混合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2018年10月30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：长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年10月29日

单位：人民币元

	最后运作日 2018年10月29日
<b>资 产：</b>	
银行存款	391,696.17
结算备付金	241,052.62
交易性金融资产	3,323,354.11
其中：股票投资	1,614,344.11
债券投资	1,709,010.00
应收利息	38,059.80
资产总计	3,994,162.70
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负 债：</b>	
应付管理人报酬	8,836.93
应付托管费	2,945.63
应付销售服务费	64.10
应付交易费用	6,562.60
其他负债	71,500.00
负债合计	89,909.26
<b>所有者权益：</b>	

实收基金	3,567,991.40
未分配利润	336,262.04
所有者权益合计	3,904,253.44
负债和所有者权益总计	3,994,162.70

## 五、清算情况

自2018年10月30日至2018年11月16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，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的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) 本基金最后运作日结算备付金为人民币241,052.62元，2018年11月2日划回结算备付金人民币126,052.62元至托管户，余额为人民币115,000.00元。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币38,059.80元，其中，应收债券利息为人民币36,443.34元，应收银行存款利息和应收结算备付金利息共计人民币1,616.46元。

(3) 本基金2018年10月30日确认应收申购款人民币199.70元，已于2018年10月31日划入托管户。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产余额为人民币3,323,354.11元，其中股票投资人民币1,614,344.11元，债券投资人民币1,709,010.00元。前述交易性金融资产明细及处置情况如下：

①最后运作日（2018年10月29日）股票投资明细如下：

金额单位：人民币元

股票名称	股票代码	最后运作日 估值单价	数量（股）	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
信威集团	600485	6.21	20,441	313,123.00	126,938.61
中天金融	000540	2.59	277,350	1,203,695.18	718,336.50
上海莱士	002252	12.67	60,700	1,289,287.00	769,069.00
合计				2,806,105.18	1,614,344.11

②最后运作日（2018年10月29日）债券投资明细如下：

金额单位：人民币元

交易 平台	债券 名称	债券代 码	最后运 作日估 值单价	数量 （张）	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额	最后运作 日应收利 息
上交 所	国开 1701	018005	100.53	17,000	1,703,060.00	1,709,010.00	36,443.34

以上债券于2018年10月31日处置变现，处置损益为人民币-1,191.75元，清算期债券利息收入为人民币352.11元，变现产生的证券清算款为人民币1,744,613.70元，已于2018年11月1日划入托管账户。

③截止清算期结束日（2018年11月16日），本基金持有的交易性金融资产均为因停牌而未变现的股票，明细如下：

金额单位：人民币元

股票名称	股票代码	清算期结束日 估值单价	数量（股）	清算期结束日 估值总额
信威集团	600485	6.21	20,441	126,938.61
中天金融	000540	2.59	277,350	718,336.50
上海莱士	002252	12.67	60,700	769,069.00
合计				1,614,344.11

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金2018年10月30日确认应付赎回款人民币114.32元，已于清算期内支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理费人民币8,836.93元、应付托管费人民币2,945.63元、应付销售服务费人民币64.10元，应付交易费用人民币6,562.60元，除应付中国外汇交易中心交易手续费775.00元待收到缴费单后支付外，已于清算期内支付。

(3) 本基金最后运作日其他负债为人民币71,500.00元，其中人民币70,000.00元为信息披露费，人民币1,500.00元为银行间市场清算所账户维护费，已于清算期内支付。

### 4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2018年10月30日 至2018年11月16日止清算期 间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
1、利息收入（注1）	1,139.75
2、处置交易性金融资产产生的净损益（注2）	-1,191.75
清算期间收益小计	-52.00
二、清算期间费用	-
三、清算期间净损益	-52.00

注1：利息收入系计提的自2018年10月30日至2018年11月16日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和债券利息。

注2：处置交易性金融资产产生的净损益系清算期间卖出债券成交金额减去卖出债券最后运作日估值总额和截至变现日应收债券利息后的差额。

### 5、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2018年10月29日基金净资产	3,904,253.44
加：清算期间净损益	-52.00
加：基金净申购金额（于2018年10月30日确认的投资者申购赎回申请）	85.38
减：银行间市场清算所10月份查询服务费	100.00
二、2018年11月16日基金净资产	3,904,186.82

截至本次清算期结束日2018年11月16日，本基金剩余财产为人民币3,904,186.82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财产扣除基金财产清算费用（本基金的清算费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付）、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（2018年10月30日）至清算结束日（2018年11月16日）的银行存款等产生的利息已计入清算期间净损益，自清算期结束日次日（2018年11月17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。以上利息均按实际适用的利率计算。如由基金管理人以自有资金垫付并将于清算款划出前划入托管账户，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

截止2018年11月16日的基金净资产中所包含的备付金、应收利息和未能变现的金融资产（其中未能变现的金融资产为人民币1,614,344.11元，该金额为停牌股票最后运作日估值金额，与停牌股票资产实际变现金额可能存在差异），将在划付本次清算金额（含费用）后对基金剩余财产进行后续清算，直至全部基金财产清算完毕。上述剩余未变现的金融资产将根据变现情况在后续清算时按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 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。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时对本基金剩余财产



进行分配。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

(1) 长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金2018年1月1日至2018年10月29日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金清算报告>之法律意见》

### 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。

长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018年11月16日