

长盛同锦研究精选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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日期：2022年6月17日

清算报告公告日期：2022年6月24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。

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
基金最后运作日（2022年6月8日）基金份额总额	5,100,763.92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

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8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 (2022年6月8日)
资 产：	
银行存款	742,288.90
结算备付金	42,240.93
存出保证金	70,014.20
交易性金融资产	7,045,834.35
应收证券清算款	134,814.42
应收申购款	8,434.59
资产总计	8,043,627.39
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	294,217.98
应付管理人报酬	2,898.47
应付托管费	483.08
应付证券清算款	49,861.42
其他负债	47,657.36
负债合计	395,118.31
所有者权益：	
实收基金	5,100,763.92

未分配利润	2,547,745.16
所有者权益合计	7,648,509.08
负债和所有者权益总计	8,043,627.39

注：截至2022年6月8日(基金最后运作日)，基金份额净值1.4995元，基金份额总额5,100,763.92份。

五、清算情况

由于本基金截至第一次清算期结束日(2022年6月15日)仍持有尚无法变现资产，经基金财产清算小组一致同意，本基金将进行二次清算。其中第一次清算期间为2022年6月9日至2022年6月15日，第二次清算期间将根据交易性金融资产的变现时间确定。

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。管理人编制本清算报表是为了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报送长盛同锦研究精选混合型证券投资基金全体持有人以及中国证券监督管理委员会使用。因此，本清算报表不适用于其他用途。

自2022年6月9日至2022年6月15日止第一次清算期间，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) 本基金最后运作日银行存款为人民币742,288.90元，其中包含应计利息为人民币4,061.53元。第一次清算期间银行存款增加人民币6,489,127.55元，其中应计利息增加人民币178.72元。截至第一次清算期结束日，银行存款余额为人民币

7,231,416.45元，其中银行存款利息余额为人民币4,240.25元。应计银行存款利息将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币42,240.93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112.46元；深圳结算备付金为人民币13,702.69元，应计利息为人民币135.83元。第一次清算期间应计利息增加人民币13.23元。截至第一次清算期结束日，结算备付金余额为人民币42,254.16元，其中结算备付金利息余额为人民币261.52元。该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币70,014.20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135.19元，深圳存出保证金为人民币41,927.56元，应计利息为人民币223.36元。第一次清算期间应计利息增加人民币21.98元。截至第一次清算期结束日，存出保证金余额为人民币70,036.18元，其中存出保证金利息余额为人民币380.53元。该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币134,814.42元，已于第一次清算期间内划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币7,045,834.35元，全部为股票投资。

其中截至第一次清算期结束日已变现的股票明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票代码	数量 (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	伊力特	600197 SH	2,700.00	28.79	76,301.00	77,733.00
2	恒生电子	600570 SH	1,900.00	42.84	76,700.00	81,396.00
3	舍得酒业	600702 SH	500.00	173.28	84,125.00	86,640.00
4	闻泰科技	600745 SH	1,300.00	68.06	82,355.00	88,478.00
5	水井坊	600779 SH	1,100.00	81.31	83,325.00	89,441.00
6	上机数控	603185 SH	3,060.00	123.54	294,809.14	378,032.40

7	湘油泵	603319 SH	7,800.00	16.10	102,543.00	125,580.00
8	东珠生态	603359 SH	10,500.00	11.06	137,563.26	116,130.00
9	傲农生物	603363 SH	5,400.00	15.48	83,322.00	83,592.00
10	韦尔股份	603501 SH	1,100.00	170.51	163,544.00	187,561.00
11	太平鸟	603877 SH	4,500.00	19.23	82,793.00	86,535.00
12	吉祥航空	603885 SH	8,900.00	13.90	113,701.39	123,710.00
13	晨光股份	603899 SH	3,582.00	51.18	202,550.34	183,326.76
14	克来机电	603960 SH	5,400.00	17.65	91,687.00	95,310.00
15	兆易创新	603986 SH	800.00	142.58	101,440.00	114,064.00
16	继峰股份	603997 SH	13,300.00	8.65	102,135.00	115,045.00
17	中际联合	605305 SH	2,708.00	43.71	109,561.00	118,366.68
18	杭可科技	688006 SH	2,110.00	68.16	101,623.70	143,817.60
19	安恒信息	688023 SH	902.00	133.39	114,260.99	120,317.78
20	南微医学	688029 SH	1,250.00	118.21	130,051.05	147,762.50
21	天宜上佳	688033 SH	4,137.00	20.27	77,781.46	83,856.99
22	传音控股	688036 SH	996.00	104.33	88,822.64	103,912.68
23	广大特材	688186 SH	3,147.00	27.77	83,804.61	87,392.19
24	道通科技	688208 SH	2,814.00	36.60	94,899.62	102,992.40
25	长阳科技	688299 SH	4,236.00	18.49	77,422.71	78,323.64
26	建龙微纳	688357 SH	766.00	115.20	84,125.68	88,243.20
27	泛亚微透	688386 SH	1,778.00	41.99	77,165.20	74,658.22
28	固德威	688390 SH	308.00	298.00	82,852.00	91,784.00
29	中信博	688408 SH	1,480.00	86.30	101,508.80	127,724.00
30	利元亨	688499 SH	416.00	206.99	77,542.40	86,107.84
31	奇安信	688561 SH	1,476.00	52.52	77,822.58	77,519.52
32	恒玄科技	688608 SH	800.00	160.87	93,714.00	128,696.00
33	杭州柯林	688611 SH	3,691.00	61.01	253,286.45	225,187.91
34	星球石墨	688633 SH	2,420.00	46.54	101,773.20	112,626.80
35	珠海冠宇	688772 SH	2,549.00	31.00	77,018.39	79,019.00
36	中兵红箭	000519 SZ	4,600.00	25.70	100,585.00	118,220.00

37	五粮液	000858 SZ	2,100.00	178.13	348,043.50	374,073.00
38	中鼎股份	000887 SZ	8,000.00	16.69	100,472.00	133,520.00
39	盾安环境	002011 SZ	9,600.00	9.73	83,579.00	93,408.00
40	中材科技	002080 SZ	5,200.00	22.89	114,875.00	119,028.00
41	银轮股份	002126 SZ	12,500.00	9.11	109,301.50	113,875.00
42	天润工业	002283 SZ	18,200.00	6.17	101,192.00	112,294.00
43	万里扬	002434 SZ	15,000.00	7.86	101,032.00	117,900.00
44	百润股份	002568 SZ	2,200.00	36.91	77,157.00	81,202.00
45	比亚迪	002594 SZ	500.00	327.41	143,895.00	163,705.00
46	三利谱	002876 SZ	3,000.00	32.85	83,939.00	98,550.00
47	长缆科技	002879 SZ	6,500.00	13.79	89,341.00	89,635.00
48	凌霄泵业	002884 SZ	7,800.00	20.01	176,332.43	156,078.00
49	宋城演艺	300144 SZ	12,300.00	12.89	171,959.06	158,547.00
50	阳光电源	300274 SZ	1,100.00	92.90	91,003.00	102,190.00
51	斯莱克	300382 SZ	6,500.00	15.41	82,745.00	100,165.00
52	蓝思科技	300433 SZ	7,900.00	10.37	83,819.00	81,923.00
53	金雷股份	300443 SZ	2,300.00	35.59	77,355.00	81,857.00
54	深信服	300454 SZ	1,300.00	102.54	114,219.00	133,302.00
55	捷佳伟创	300724 SZ	1,800.00	86.70	128,381.00	156,060.00
56	卓胜微	300782 SZ	500.00	208.80	104,750.00	104,400.00
57	泽宇智能	301179 SZ	84.00	41.50	3,695.16	3,486.00
58	光庭信息	301221 SZ	1,500.00	53.45	74,662.00	80,175.00
59	华研精机	301138 SZ	162.00	29.60	4,239.54	4,795.20
60	通灵股份	301168 SZ	115.00	34.59	4,494.20	3,977.85
61	迪阿股份	301177 SZ	80.00	71.63	9,350.40	5,730.40
62	家联科技	301193 SZ	149.00	25.78	4,578.77	3,841.22
合计					6,368,926.17	6,902,820.78

以上股票投资于第一次清算期间（2022年6月9日至2022年6月15日）处置变现，处置净损益为人民币-67,065.33元，处置期间产生的交易费用为人民币13,744.55元。

其中截至第一次清算期结束日（2022年6月15日）因处于锁定期内尚未变现的流

通受限股票明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票代码	数量 (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	第一次清算期 结束日 估值单价	第一次清算期 结束日 估值总额
1	亚信安全	688225 SH	1,871.00	21.61	57,084.21	40,432.31	20.00	37,420.00
2	创耀科技	688259 SH	559.00	84.43	37,229.40	47,196.37	81.03	45,295.77
3	中触媒	688267 SH	808.00	34.95	33,855.20	28,239.60	34.06	27,520.48
4	百诚医药	301096 SZ	48.00	69.01	3,820.80	3,312.48	69.46	3,334.08
5	风光股份	301100 SZ	176.00	22.90	4,894.56	4,030.40	22.00	3,872.00
6	明月镜片	301101 SZ	193.00	52.52	5,193.63	10,136.36	46.79	9,030.47
7	亨迪药业	301211 SZ	261.00	21.05	6,733.80	5,494.05	20.38	5,319.18
8	光庭信息	301221 SZ	80.00	52.15	5,591.20	4,172.00	54.05	4,324.00
合计					154,402.80	143,013.57		136,115.98

截至第一次清算期结束日（2022年6月15日），因处于锁定期内尚未变现的流通受限股票资产为人民币136,115.98元，第一次清算期间产生公允价值变动损益为人民币-6,897.59元。

（6）本基金最后运作日应收申购款为人民币8,434.59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为人民币294,217.98元，应付管理人报酬为人民币2,898.47元，应付托管费为人民币483.08元，已于第一次清算期间内支付。

（2）本基金最后运作日应付证券清算款为人民币49,861.42元，其中应付交易费用为人民币49,856.03元，将于第一次清算结束后支付；应付深圳清算资金人民币5.39元，已于第一次清算期间内支付。

（3）本基金最后运作日其他负债为人民币47,657.36元，其中应付赎回费人民币657.36元，已于第一次清算期间内支付；应付信息披露费为人民币47,000.00元，将于第一次清算结束后支付。

4、第一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9日 至2022年6月15日止的第一次 清算期间
一、第一次清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	213.93
处置交易性金融资产产生的净损益（注2）	-67,065.33
公允价值变动损益（注3）	-6,897.59
第一次清算期间收益小计	-73,748.99
二、第一次清算期间支出	
银行划款费	64.00
股票交易费用	13,744.55
清算费用（注4）	0.00
第一次清算期间支出小计	13,808.55
三、第一次清算期间净收益	-87,557.54

注1：利息收入系计提的2022年6月9日至2022年6月15日止的第一次清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

注2：处置交易性金融资产产生的净损益系第一次清算期间交易性金融资产变现损益为人民币-64,975.84元、第一次清算期间交易性金融资产分红派息为人民币1,331.22元和红利补税人民币-3,420.71元。

注3：公允价值变动损益系截至第一次清算期结束日（2022年6月15日）尚未处置的限售期锁定股票在第一次清算期间（2022年6月9日至2022年6月15日）产生。

注4：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。

5、第一次清算期间的剩余资产分配情况

金额单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2022年6月8日基金净资产	7,648,509.08
加：第一次清算期间净收益	-87,557.54
减：基金净赎回金额（于2022年6月9日确认的投资者申购、赎回、转出申请）	174,173.45
二、第一次清算期结束日2022年6月15日基金净资产	7,386,778.09

截至第一次清算期结束日（2022年6月15日），本基金剩余财产为人民币7,386,778.09元，扣除截至第一次清算期结束日（2022年6月15日）持有的未变现资产后，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。

由于本基金截至第一次清算期结束日（2022年6月15日）持有未变现资产，未变现资产包含结算备付金、存出保证金、应计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136,115.98元，该金额为首发流通受限股票于第一次清算结束日的估值金额，与该股票资产实际变现金额可能存在差异），本基金将根据变现情况进行后续二次清算流程，将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）、交纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行二次分配，直至全部基金财产清算完毕。

自第一次清算期结束日次日（2022年6月16日）至清算款划出日前一日的银行存款等产生的利息亦属基金份额持有人所有，将在第二次清算期间进行分配。

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。

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清算审计报告》；
- （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6月24日