

# 长盛沪港深优势精选灵活配置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：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日期：2023年4月10日

清算报告公告日期：2023年4月18日

## 一、重要提示

长盛沪港深优势精选灵活配置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”）2015年11月17日《关于准予长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕2643号文）注册募集，于2016年7月5日成立并正式运作。

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》和《长盛沪港深优势精选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，本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”或“基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议终止《基金合同》有关事项。本次基金份额持有人大会表决投票时间自2023年2月15日起至2023年3月16日17:00止，并于2023年3月17日表决通过了《关于终止长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金自2023年3月18日起进入清算程序，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国建设银行、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2023年3月18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

基金名称	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛沪港深混合
基金代码	002732
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月5日
基金最后运作日 (2023年3月17日)	1,416,781.26份

基金份额总额	
投资目标	通过把握国内宏观经济政策和市场发展趋势，深入发掘A股和港股两个市场上的高成长上市公司，全面把握中国经济的投资机会。
投资策略	<p>本基金将适时调整国内A股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略，主要依据包括但不限于宏观经济因素、政策因素、两地估值折溢价因素、资金利差、市场情绪以及流动性趋势等。</p> <p>A股投资策略：本基金主要突出“自下而上”的个股精选策略，通过定性分析和定量分析相结合的办法，挑选具备较大投资价值的上市公司。</p> <p>港股通标的股票投资策略：在对AH股溢价水平进行重点分析和趋势预测的前提下，本基金管理人将优选香港市场与国内A股在部分行业形成有效互补的行业和上市公司。</p> <p>最后，本基金将利用两地市场在估值水平、投资者群体结构、交易规则等方面的差异，通过估值套利、事件套利等多重策略获取收益。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	<p>本基金是混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中等风险收益特征的基金品种。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。</p>
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

### 三、基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2015年11月17日《关于准予长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕2643号文）注册募集，募集期自2016年5月9日至2016年7月1日止，《基金合同》于2016年7月5日生效，基金合同生效日的基金份额总额为322,529,979.43份。自2016年7月5日至2023年3月17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》和《长盛沪港深优势精选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，本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”或“基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议终止《基金合同》有关事项。本次基金份额持有人大会表决投票时间自2023年2月15日起至2023年3月16日17:00止，并于2023年3月17日表决通过了《关于终止长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

根据《长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及《长盛沪港深优势精选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》，自2023年3月18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：长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年3月17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 (2023年3月17日)
<b>资产：</b>	
银行存款	1,536,365.68
结算备付金	930.08
存出保证金	16,178.95
交易性金融资产	540,235.61
资产总计	2,093,710.32
<b>负债和所有者权益</b>	
<b>负债：</b>	
应付赎回款	40,314.17
应付管理人报酬	1,655.40

应付托管费	275.93
其他负债	168,566.29
负债合计	210,811.79
<b>净资产:</b>	
实收基金	1,416,781.26
未分配利润	466,117.27
净资产合计	1,882,898.53
<b>负债和净资产总计</b>	<b>2,093,710.32</b>

注：截至2023年3月17日(基金最后运作日)，长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金份额总额1,416,781.26份。

## 五、清算情况

自2023年3月18日至2023年4月10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1,536,365.68元，其中包含应计利息人民币1,543.05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510,130.39元；清算期间计提的银行存款利息为人民币411.68元，结息转出应计利息人民币1,602.35元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币2,045,305.40元，其中应计银行存款利息人民币352.38元。应计银行存款利息将于清算期结束后由管理人以自有资金先行垫付，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币930.08元，其中上海最低备付金应

计利息为人民币28.36元；深圳最低备付金为人民币890.28元，应计利息为人民币11.44元。清算期间共计提利息人民币0.96元，结息转出最低备付金利息人民币39.96元。截至清算期结束日，最低备付金余额为人民币891.08元，其中最低备付金应计利息为人民币0.80元。该款项将于清算期结束后由管理人以自有资金先行垫付，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币16,178.95元，其中上海存出保证金为人民币8,879.43元，应计利息为人民币42.46元；深圳存出保证金为人民币7,213.36元，应计利息为人民币43.70元。清算期间存出保证金共计提利息人民币16.38元，结息转出存出保证金利息人民币89.04元，2023年4月3日存出保证金调减人民币3,304.97元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币12,801.32元，其中存出保证金应计利息为人民币13.50元。该款项将于清算期结束后由管理人以自有资金先行垫付，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币540,235.61元，全部为股票投资。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	万华化学	600309	800.00	97.42	91,575.63	77,936.00
2	青岛啤酒	600600	700.00	108.29	59,810.89	75,803.00
3	安图生物	603658	1,100.00	60.95	64,975.38	67,045.00
4	海尔智家	600690	2,400.00	23.38	64,764.51	56,112.00
5	山西焦煤	000983	4,300.00	10.98	58,244.82	47,214.00
6	兴业银行	601166	2,500.00	16.72	47,863.58	41,800.00
7	海康威视	002415	900.00	40.35	33,826.76	36,315.00
8	赛意信息	300687	1,000.00	34.26	31,210.00	34,260.00
9	电科网安	002268	800.00	37.99	27,886.40	30,392.00
10	华锐精密	688059	220.00	136.23	30,224.90	29,970.60
11	三一重能	688349	639.00	33.99	21,791.63	21,719.61
12	中钨高新	000657	1,400.00	13.23	24,293.29	18,522.00
13	隆基绿能	601012	80.00	39.33	4,630.69	3,146.40

以上股票投资于2023年3月18日至2023年4月3日处置变现。处置净损益为人民币9,566.45元，处置期间产生的交易费用为人民币995.46元。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款人民币40,314.17元、应付管理人报酬人民币1,655.40元和应付托管费人民币275.93元,上述应付款项已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币168,566.29元,其中应付赎回费人民币0.59元、应付交易费用人民币1,386.70元、预提2022年度审计费人民币60,000.00元和预提2022年度信息披露费人民币107,179.00元。上述应付赎回费、应付交易费用已于清算期间支付,预提年度审计费和预提信息披露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	2023年3月18日至2023年4月10日止清算期间
一、清算期间收益(损失以“-”填列)	
利息收入(注1)	429.28
处置交易性金融资产产生的净损益(注2)	9,566.45
清算期间收益小计	9,995.73
二、清算期间费用	
股票交易费用	995.46
银行汇划费	157.83
清算期间费用小计	1,153.29
三、清算期间净损益	8,842.44

注1:利息收入系计提的自2023年3月18日至2023年4月10日止清算期间的银行存款利息收入、最低备付金利息收入及存出保证金利息收入。

注2:处置交易性金融资产产生的净损益系清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票最后运作日估值总额和股息红利税后的差额。

### 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2023年3月17日基金净资产	1,882,898.53
加:清算期间净损益	8,842.44

二、清算期结束日2023年4月10日基金净资产	1,891,740.97
-------------------------	--------------

资产处置及负债清偿后，2023年4月10日本基金剩余财产为人民币1,891,740.97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、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。

自清算期起始日（2023年3月18日）至清算期结束日（2023年4月10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（2023年4月11日）至清算款划出前一日（2023年4月10日）的银行存款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最低备付金等。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）《长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 17 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<长盛沪港深优势精选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

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。

长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023年4月18日