

长信新利灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年5月29日

清算报告公告日：2024年6月12日

§ 1 重要提示

长信新利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信新利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”或“《基金合同》”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2014]913号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为697,321,010.82份,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为毕马威华振验字第1500361号验资报告。基金合同于2015年2月11日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金合同“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定:“有下列情形之一的,并在履行相关程序后,《基金合同》应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的;”

根据基金管理人于2024年4月26日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信新利灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》,本基金基金份额持有人大会于2024年4月25日表决通过了《关于终止长信新利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。根据《长信基金管理有限责任公司关于长信新利灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》,本基金最后运作日为2024年4月26日,自本基金最后运作日的下一日(2024年4月27日)起,本基金进入清算程序,本基金进入清算程序后,停止收取基金管理费、基金托管费。基金管理人不再接受基金份额持有人提出的申购、赎回等业务申请。

由基金管理人长信基金管理有限责任公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2024年4月29日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长信新利混合
场内简称	长信新利
基金主代码	519969

交易代码	519969
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月11日
最后运作日（2024年4月26日）基金份额总额	3,266,140.30份
投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置，在有效控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。</p> <p>（2）个股投资策略</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>（3）存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制基金资产的整体风险。在个券的选择上，本基金将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。对于中小企业私募债券，本基金将重点关注发行人财务状况、个券增信措施等因素，以及对基金资产流动性的影响，在充分考虑信用风险、流动性风险的基础上，进行投资决策。</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2014]913号《关于准予长信新利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集。基金合同于2015年2月11日生效，首次设立募集规模为697,321,010.82份基金份额。

因市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，本基金管理人根据《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》、《基金合同》等有关规定，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。基金管理人于2024年3月29日0:00起至2024年4月24日17:00止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决时间于2024年4月24日17:00截止，会议期间审议了《关于终止长信新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

本次基金份额持有人大会于2024年4月25日表决通过了《关于终止长信新利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。本次基金份额持有人大会决议生效后，根据《长信基金管理有限责任公司关于长信新利灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金最后运作日为2024年4月26日，自本基金最后运作日的下一日（2024年4月27日）起，本基金进入清算程序，本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费。基金管理人不再接受基金份额持有人提出的申购、赎回等业务申请。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表（经审计）

会计主体：长信新利灵活配置混合型证券投资基金

单位：人民币元

资产	清算结束日 2024年5月22日	最后运作日 2024年4月26日
资产：		
银行存款	2,472,605.76	2,591,931.22
结算备付金	3,905.56	20,162.43
存出保证金	6,924.05	6,303.40

应收股利	-	-
交易性金融资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,483,435.37	2,618,397.05
负债和净资产	清算结束日	最后运作日
	2024年5月22日	2024年4月26日
负债:		
应付赎回款	-	592.26
应付管理人报酬	-	2,423.30
应付托管费	-	807.74
其他负债	15,000.00	19,858.48
负债合计	15,000.00	23,681.78
净资产:		
实收基金	3,105,647.47	3,266,140.30
未分配利润	-637,212.10	-671,425.03
净资产合计	2,468,435.37	2,594,715.27
负债和净资产总计	2,483,435.37	2,618,397.05

注：本基金最后运作日 2024 年 4 月 26 日，长信新利灵活配置混合型证券投资基金份额净值人民币 0.794 元，基金份额总额 3,266,140.30 份。

4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信新利灵活配置混合型证券投资基金

清算损益表

单位：人民币元

项目	2024年4月27日(清算开始日)至 2024年5月22日(清算结束日)止期间
一、 收入	660.39
1、利息收入（注1）	660.35
2、投资收益(损失以“-”填列)	-
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-
4、其他收入(损失以“-”填列)（注2）	0.04
二、 费用	-491.00
1、管理人报酬（注3）	-
2、基金托管费（注3）	-
3、税金及附加	-
4、其他费用（注4）	-491.00
三、 利润总额	1,151.39
减：所得税费用	-
四、 净收益	1,151.39

注：1、利息收入共计人民币 660.35 元，系以适用利率预估计提的自 2024 年 4 月 27 日(清算开始日)至 2024 年 5 月 22 日(清算结束日)止期间的银行存款利息收入人民币 635.62 元，结算备付金利息收入人民币 17.00 元和存出保证金利息收入人民币 7.73 元。

- 2、其他收入为人民币 0.04 元，系 2024 年 4 月 29 日产品赎回确认产生的基金赎回费收入人民币 0.04 元。
- 3、根据《长信基金管理有限责任公司关于长信新利灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金自 2024 年 4 月 27 日起，停止收取基金管理费、基金托管费。
- 4、其他费用为人民币-491.00 元，分别为自 2024 年 4 月 27 日(清算开始日)至 2024 年 5 月 22 日(清算结束日)止期间支付费用产生的汇划费 29.00 元；及因中债账户销户，无需支付的中债回购结算服务费，已回冲-520.00 元。

§ 5 基金财产分配

自2024年4月27日(清算开始日)至2024年5月22日(清算结束日)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：

5.1 资产处置及负债清偿情况

5.1.1 本基金最后运作日银行存款为人民币 2,591,931.22 元，其中活期存款人民币 2,591,278.80 元，应计活期存款利息人民币 652.42 元；上述活期存款在清算期支付了赎回款、管理费、托管费、调整了最低结算备付金及存出保证金后，于清算结束日（2024 年 5 月 22 日）银行存款为人民币 2,472,605.76 元，其中活期存款人民币 2,471,317.72 元，应计活期存款利息人民币 1,288.04 元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币 20,162.43 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币 7,031.57 元，应计结算备付金利息人民币 14.32 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金人民币 13,102.50 元，应计结算备付金利息人民币 14.04 元。经过 2024 年 5 月 13 日备付金调整后，于清算结束日（2024 年 5 月 22 日）结算备付金为人民币 3,905.56 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币 3,860.20 元，应计结算备付金利息人民币 21.29 元；存放于中国证券登

记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金已划入托管户，应计结算备付金利息人民币 24.07 元；

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币 6,303.40 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金人民币 3,124.05 元，应计存出保证金利息人民币 4.92 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金人民币 3,169.63 元，应计存出保证金利息人民币 4.80 元。经过 2024 年 5 月 7 日保证金调整后，于清算结束日（2024 年 5 月 22 日）剩余存出保证金为人民币 6,924.05 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金人民币 3,417.96 元，应计存出保证金利息人民币 8.71 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金人民币 3,488.64 元，应计存出保证金利息人民币 8.74 元。

5.1.4 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 592.26 元，已于 2024 年 5 月 22 日（清算结束日）前支付。

5.1.5 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 2,423.30 元，已于 2024 年 5 月 22 日（清算结束日）前支付。

5.1.6 本基金最后运作日应付托管费为人民币 807.74 元，已于 2024 年 5 月 22 日（清算结束日）前支付。

5.1.7 本基金最后运作日其他负债为人民币 19,858.48 元，其中：应付交易费用共计人民币 4,858.48 元，已于 2024 年 5 月 22 日（清算结束日）前支付；应付交易费用中，应付中债回购结算服务费 520.00 元经确认无需支付，已于 2024 年 5 月 22 日（清算结束日）前回冲；预提清算审计费共计人民币 15,000.00 元，将于 2024 年 5 月 22 日（清算结束日）后支付。

5.2 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2024年4月26日基金净资产	2,594,715.27
加：清算期间净收益	1,151.39
减：基金净赎回转出金额 （于2024年4月29日确认的投资者赎回转出申请）	127,431.29
二、2024年5月22日基金净资产	2,468,435.37

注：根据本基金的基金合同及基金管理人于 2024 年 4 月 26 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信新利灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，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。清算结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息亦属份额持有人所有。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人可以在清算付款日以自有资金先行垫付上述未结息金额，供清盘分配使用，待实际资金到账后再返还基金管理人，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

资产处置及部分负债清偿后，本基金截至 2024 年 5 月 22 日止的净资产为人民币 2,468,435.37 元。

截至 2024 年 5 月 22 日，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 2,472,605.76 元。

5.3 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，报监管备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、长信新利灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告；
- 2、《长信新利灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见书。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信新利灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2024 年 6 月 12 日