

长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）

清算报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：2024 年 6 月 19 日

清算报告公告日期：2024 年 6 月 25 日

一、重要提示

长盛上证50指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”）担任基金管理人，由中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）担任基金托管人。长盛上证50指数证券投资基金（LOF）由长盛上证50指数分级证券投资基金转型而来。长盛上证50指数分级证券投资基金于2015年6月3日获中国证监会证监许可〔2015〕1128号文注册募集。经向中国证监会备案，《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》于2015年8月13日正式生效。

长盛上证50指数分级证券投资基金于2020年8月12日经中国证监会证监许可【2020】1794号文准予变更注册。自2020年9月28日至2020年10月28日，长盛上证50指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于2020年10月29日大会审议通过了《关于长盛上证50指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括调整基金名称、运作方式等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。原长盛上证50指数分级证券投资基金基金份额持有人持有的长盛上证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B份额均转换成长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金份额。自2020年12月4日起，长盛上证50指数分级证券投资基金转型为长盛上证50指数证券投资基金（LOF），《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）生效，《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

根据《基金合同》“第五部分 基金份额的存续”中“二、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，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。”截至2024年5月24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，触发《基金合同》约定的终止情形，为维护基金份额持有人利益，本基金管理人与基金托管人协商一致，决定终止《基金合同》并进行基金财产清算，且无需召开基金份额持有人大会。本基金管理人确定2024年6月5日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2024年6月6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2024年5月25日刊登在《证券时报》和本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《长盛基金管理有限公司关于长盛上证50指数证券投资基金（LOF）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2024年6月5日，自2024年6月6日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国银行、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2024年6月6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	长盛上证50指数证券投资基金（LOF）
基金场外简称	长盛上证50指数（LOF）
基金场内简称	上证50LOF基金
基金代码	502040
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月4日
基金最后运作日（2024年6月5日）基金份额总额	13,053,142.91份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对上证50指数的有效跟踪。
投资范围	本基金的标的指数为上证50指数。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、股指期货、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。 本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值

	的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 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。
主要投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、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	中国银行股份有限公司

注：本基金由“长盛上证50指数分级证券投资基金”转型而来，上述基金合同生效日为《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日。

三、基金运作情况概述

长盛上证50指数证券投资基金（LOF）由长盛基金担任基金管理人，由中国银行担任基金托管人。长盛上证50指数证券投资基金（LOF）由长盛上证50指数分级证券投资基金转型而来。长盛上证50指数分级证券投资基金于2015年6月3日获中国证监会证监许可〔2015〕1128号文准予注册，由长盛基金依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》公开募集，募集期自2015年6月29日至2015年8月7日止，募集资金及其产生的利息共计316,643,141.20元，折合基金份额316,643,141.20份。经向中国证监会备案，《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》于2015年8月13日正式生效。

长盛上证50指数分级证券投资基金于2020年8月12日经中国证监会证监许可【2020】1794号文准予变更注册。自2020年9月28日至2020年10月28日，长盛上证50指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于2020年10月29日大会审议通过了《关于长盛上证50指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括调整基金名称、运作方式等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。原长盛上证50指数分级证券投资基金基金份额持有人持有的长盛上

证50份额、长盛上证50A份额、长盛上证50B份额均转换成长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金份额。自2020年12月4日起，长盛上证50指数分级证券投资基金转型为长盛上证50指数证券投资基金（LOF），《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《长盛上证50指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、股指期货、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

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。

根据《长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金合同》“第五部分 基金份额的存续”中“二、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，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。”

截至2024年5月24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，本基金管理人与基金托管人协商一致，决定终止《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。本基金管理人与基金托管人协商一致，确定2024年6月5日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2024年6月6日）起本基金进入基金财产清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛上证50指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2024年6月5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 (2024年6月5日)
资产：	
银行存款	589,083.59
存出保证金	4,203.94
交易性金融资产	11,828,641.98
应收证券清算款	201,448.99
资产总计	12,623,378.50
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	297,463.69
应付管理人报酬	2,055.84
应付托管费	411.17
其他负债	93,108.82
负债合计	393,039.52
所有者权益：	
实收基金	7,803,672.27
未分配利润	4,426,666.71
所有者权益合计	12,230,338.98
负债和所有者权益总计	12,623,378.50

注：截至2024年6月5日(基金最后运作日)，基金份额总额13,053,142.91份，基金份额净值0.9370元。

五、清算情况

自2024年6月6日至2024年6月19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》“第二十部分 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589,083.59元，其中应计利息为人民币690.82元。清算期间银行存款变动金额为人民币10,841,263.51元，其中包含新增银行存款应计利息为人民币636.94元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币11,430,347.10元，其中银行存款应计利息余额为人民币1,327.76元。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币4,203.94元，其中上海存出保证金为人民币4,199.26元，应计利息人民币4.68元。清算期间新增存出保证金应计利息为人民币2.66元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币4,206.60元，其中存出保证金利息余额为人民币7.34元。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币201,448.99元，该款项已于清算期间内划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币11,828,641.98元，其中股票投资为人民币11,524,326.50元，债券投资为人民币304,315.48元。自2024年6月6日至2024年6月19日止清算期间，股票投资和债券投资均于清算期间内处置变现，其中，股票投资处置净损益为人民币-247,400.87元，债券投资处置净损益为人民币0.00元，清算期间产生的利息收入为人民币108.50元。

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 (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	中国石化	600028	32,200.00	6.26	164,295.95	201,572.00
2	中信证券	600030	16,563.00	18.54	381,709.36	307,078.02

3	三一重工	600031	10,134.00	15.77	203,937.27	159,813.18
4	招商银行	600036	21,000.00	33.99	858,098.27	713,790.00
5	保利发展	600048	12,300.00	10.33	171,252.56	127,059.00
6	中国联通	600050	32,400.00	4.54	164,954.97	147,096.00
7	特变电工	600089	8,670.00	14.67	143,734.74	127,188.90
8	上汽集团	600104	8,000.00	14.17	154,423.03	113,360.00
9	北方稀土	600111	4,300.00	18.34	157,740.12	78,862.00
10	中国船舶	600150	3,800.00	37.74	105,949.44	143,412.00
11	恒瑞医药	600276	7,550.00	43.92	413,891.70	331,596.00
12	万华化学	600309	3,300.00	88.14	259,018.61	290,862.00
13	国电南瑞	600406	6,760.00	23.81	141,462.33	160,955.60
14	片仔癀	600436	700.00	232.08	306,134.14	162,456.00
15	通威股份	600438	4,700.00	22.79	196,091.28	107,113.00
16	贵州茅台	600519	1,049.00	1,644.00	1,546,961.63	1,724,556.00
17	海尔智家	600690	6,400.00	29.90	141,486.00	191,360.00
18	山西汾酒	600809	960.00	243.96	294,881.39	234,201.60
19	伊利股份	600887	10,900.00	27.32	354,847.62	297,788.00
20	航发动力	600893	2,200.00	37.80	120,728.13	83,160.00
21	长江电力	600900	16,500.00	27.96	360,988.42	461,340.00
22	三峡能源	600905	24,400.00	4.63	138,303.79	112,972.00
23	隆基绿能	601012	10,532.00	18.28	352,882.56	192,524.96
24	中国神华	601088	5,500.00	42.75	119,450.25	235,125.00
25	兴业银行	601166	24,800.00	17.55	454,573.30	435,240.00
26	陕西煤业	601225	6,600.00	25.72	123,734.87	169,752.00
27	农业银行	601288	54,000.00	4.44	175,974.93	239,760.00
28	中国平安	601318	18,202.00	43.08	1,116,795.87	784,142.16

29	中国中铁	601390	17,300.00	6.63	132,233.53	114,699.00
30	工商银行	601398	59,600.00	5.46	297,127.88	325,416.00
31	中国太保	601601	5,800.00	28.92	133,481.95	167,736.00
32	中国人寿	601628	2,812.00	31.70	85,939.01	89,140.40
33	长城汽车	601633	2,100.00	25.45	104,103.56	53,445.00
34	中国建筑	601668	36,200.00	5.58	188,407.57	201,996.00
35	中国电建	601669	14,700.00	5.35	94,877.35	78,645.00
36	中国电信	601728	26,200.00	5.87	157,974.94	153,794.00
37	中国石油	601857	19,700.00	9.77	113,829.50	192,469.00
38	中国中免	601888	1,800.00	73.34	287,070.93	132,012.00
39	紫金矿业	601899	28,500.00	17.05	306,761.45	485,925.00
40	中远海控	601919	10,800.00	16.58	190,944.50	179,064.00
41	药明康德	603259	3,485.00	42.90	339,390.38	149,506.50
42	海天味业	603288	2,921.00	36.02	248,771.20	105,214.42
43	韦尔股份	603501	1,295.00	100.42	246,536.12	130,043.90
44	华友钴业	603799	2,300.00	27.43	183,634.58	63,089.00
45	兆易创新	603986	1,280.00	84.77	173,512.00	108,505.60
46	海光信息	688041	1,754.00	70.87	141,731.10	124,305.98
47	金山办公	688111	507.00	267.78	211,890.11	135,764.46
48	天合光能	688599	1,882.00	21.49	103,499.23	40,444.18
49	中芯国际	688981	3,447.00	46.12	182,547.35	158,975.64

债券明细如下：

金额单位：人民币元

序号	债券名称	债券代码	数量	最后运作日估值单价（含应计利息）	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额（含应计利息）
----	------	------	----	------------------	-----------	------------------

1	23 国债 16	019709	3,000.00	101.44	298,662.56	304,315.48
---	----------	--------	----------	--------	------------	------------

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297,463.69元，应付管理人报酬为人民币2,055.84元，应付托管费为人民币411.17元，上述款项已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币93,108.82元，其中应付赎回费为人民币81.33元、应付交易费用为人民币4,763.79元，已于清算期间内支付；预提审计费为人民币52,000.00元、预提指数使用费为人民币36,263.70元，将于完成付款流程后支付。

4、清算期间的清算损益情况

金额单位：人民币元

项目	自2024年6月6日 至2024年6月19日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	639.60
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	-247,292.37
清算期间收益小计	-246,652.77
二、清算期间支出	
银行汇划费	315.00
清算期间支出小计	315.00
三、清算期间净收益	-246,967.77

注1：利息收入系计提的2024年6月6日至2024年6月19日止清算期间的银行存款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收益系清算期间卖出证券成交总额减去卖出证券最后运作日估值总额和股息红利税后的差额，以及卖出债券清算金额扣除卖出债券最后运作日估值总额和应计债券利息后的净额。

5、资产处置及负债清偿后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2024年6月5日基金净资产	12,230,338.98
加：清算期间净收益	-246,967.77
减：基金净赎回金额（于2024年6月6日确认的投资者赎回、转出申请）	637,301.21
二、清算结束日2024年6月19日基金净资产	11,346,070.00

注：截至2024年6月19日(清算结束日)，基金份额总额12,372,872.33份，基金份额净值0.9170元。

资产处置及负债清偿后，2024年6月19日本基金剩余财产为人民币11,346,070.00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。本清算报告公告后，基金管理人将根据上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的相关规定进行基金财产清算剩余资产的分配。

自清算起始日（2024年6月6日）至清算结束日（2024年6月19日）的银行存款、存出保证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（2024年6月20日）至清算款划出前一日的银行存款、存出保证金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存出保证金等。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) 《长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）清算报表审计报告》；

(2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛上证50指数证券投资基金（LOF）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。

长盛上证50指数证券投资基金（LOF）基金财产清算小组

2024年6月25日