

长信量化优选混合型证券投资基金（LOF） 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：国泰君安证券股份有限公司

清算报告出具日：2018年8月10日

清算报告公告日：2018年9月28日

§ 1 重要提示

长信量化优选混合型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)由长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF) (以下简称“长信中证上海改革发展指数(LOF)”) 变更投资范围及其相关事宜转型而成。长信中证上海改革发展指数(LOF)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》、《长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF)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[2015]2701号文和中国证监会证券基金机构监管部机构部函[2017]511号《关于长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF)延期募集备案的回函》批准公开募集,于2017年4月14日募集成立。首次设立募集基金份额为201,821,192.55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1700022号验资报告。

本基金获中国证监会《关于准予长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF)变更注册的批复》(证监许可[2017]1209号)后,由基金管理人于2017年8月29日起至2017年9月22日期间召开长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会,并于2017年9月25日审议通过了《关于长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金(LOF)修改法律文件的议案》,决定长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)法律文件于2017年9月28日起生效。

根据《长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“《基金合同》”)第二大部分“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;2、基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;3、《基金合同》约定的其他情形;4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”

根据基金管理人2018年8月6日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)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2018年8月2日表决通过了《关于终止长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)基金合同有关事项的议案》,大会决议自该日起生效。本基金最后运作日为2018年8月6日,自2018年8月7日起进入清算期。

由基金管理人长信基金管理有限责任公司、基金托管人国泰君安证券股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)、上海源泰律师事务所于2018年8月7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	长信量化优选混合（LOF）
场内简称	长信优选
基金主代码	501003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月28日
报告期末(2018年8月6日)基金份额总额	1,096,065.65份
投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期持续增值。
投资策略	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证500指数收益率*70%+中债综合指数收益率*30%
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	国泰君安证券股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会《关于准予长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）变更注册的批复》（证监许可[2017]1209号）准予变更注册后，于2017年9月28日正式由长信中证上海改革发展指数（LOF）转型而成。

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》、《基金合同》等有关规定，提议终止基金合同。本基金于2018年7月6日0:00起至2018年8月1日17:00止以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，会议期间审议了《关于终止长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于2018年8月2日表决通过了《关于终止长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

根据管理人2018年8月6日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金最后运作日为2018年8月6日，自2018

年8月7日起进入清算期。

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 清算资产负债表

会计主体：长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)

单位：人民币元

项目	2018年8月6日 (最后运作日)	2018年8月10日 (清算结束日)
资产：		
银行存款	363,405.67	1,042,413.44
结算备付金	437.35	437.35
存出保证金	303.76	303.76
交易性金融资产	693,223.00	-
其中：股票投资	693,223.00	-
应收利息	1,860.68	2,018.44
资产总计	1,059,230.46	1,045,172.99
负债和净资产		
负债：		
应付管理人报酬	202.47	-
应付托管费	25.32	-
应付交易费用	153.49	-
其他负债	65,000.00	40,000.00
负债合计	65,381.28	40,000.00
所有者权益：		
实收基金	1,096,065.65	1,096,065.65
未分配利润	-102,216.47	-90,892.66
所有者权益合计	993,849.18	1,005,172.99
负债和所有者权益总计	1,059,230.46	1,045,172.99

注：1、截至最后运作日2018年8月6日，基金份额净值人民币0.9067元，基金份额总额1,096,065.65份。

2、本财务报告已经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师曾浩、吴凌志

签字出具了德师报(审)字(18)第 S00414 号标准无保留意见的审计报告。

4.2 清算损益表

会计主体：长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)

单位：人民币元

项目	2018年8月7日 (清算开始日)至 2018年8月10日 (清算结束日)
一、 收入	11,546.67
1、利息收入(注1)	157.76
2、投资收益(注2)	-149,983.59
3、公允价值变动损益(注3)	161,372.50
4、其他收入	-
二、 费用	222.86
1、管理人报酬	-
2、基金托管费	-
3、交易费用(注4)	1,318.78
4、利息支出	-
5、税金及附加	-
6、其他费用(注5)	-1,095.92
三、 利润总额	11,323.81
减：所得税费用	-
四、 净收益	11,323.81

§ 5 基金财产分配

自 2018 年 8 月 7 日至 2018 年 8 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：

5.1 资产负债处置情况

5.1.1 本基金最后运作日持有股票投资为人民币 693,223.00 元，未持有暂时停牌等流通受限股票。该类资产已于 2018 年 8 月 7 日和 2018 年 8 月 8 日分别变现。

5.1.2 本基金最后运作日其他负债为人民币 65,000.00 元，该款项包含预提信息披露费人民币 50,000.00 元及预提审计费人民币 15,000.00 元。

5.1.3 清算期间利息收入系以当前适用利率预估计提的自 2018 年 8 月 7 日(清算开始日)至 2018 年 8 月 10 日(清算结束日)期间的银行存款利息收入人民币 157.60 元、清算备付金利息收入人民币 0.08 元和存出保证金利息收入人民币 0.08 元，共计人民币 157.76 元。（注 1）

5.1.4 清算期间投资收益系自 2018 年 8 月 7 日(清算开始日)至 2018 年 8 月 10 日(清算结束日)止清算期间买卖股票实现的差价收入和股票投资产生的股利收益。（注 2）

5.1.5 清算期间公允价值变动损益系最后运作停止日所持股票清算期间的公允价值变动损益。（注 3）

5.1.6 根据《长信基金管理有限责任公司关于长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金自 2018 年 8 月 7 日起，停止收取基金管理费、基金托管费。

5.1.7 清算期间交易费用系自 2018 年 8 月 7 日(清算开始日)至 2018 年 8 月 10 日(清算结束日)止清算期间发生的交易所市场交易费计人民币 1,318.78 元。（注 4）

5.1.8 清算期间其他费用系自 2018 年 8 月 7 日(清算开始日)至 2018 年 8 月 10 日(清算结束日)止清算期间依据上海证券报实际应收金额冲回的已计提的信息披露费。（注 5）

5.2 剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2018年8月6日基金净资产	993,849.18
加：清算期间净收益	11,323.81
二、2018年8月10日基金净资产	1,005,172.99

于2018年8月10日(清算结束日)，本基金剩余资产为人民币1,005,172.99元。根据本基金的基金合同约定，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(清算起始日2018年8月7日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有)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。

为保护委托人利益，加快清盘速度，管理人将垫付应收利息、交易所最低备付金及保证金，管理人垫付资金孳生的利息归管理人所有。

经与基金管理人确认，本次清算的律师费用由本基金管理人承担。

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，报中国证监会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、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）2018年8月6日（最后运作日）资产负债表、2018年8月10日（清算结束日）资产负债表及审计报告；
- 2、《长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）清算报告》的法律意见。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

长信基金管理有限公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）财产清算小组

2018年8月10日