

# 长信先利半年定期开放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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2022年10月20日

清算报告公告日：2022年11月10日

## § 1 重要提示

长信先利半年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1575号《关于准予长信先利半年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》的注册,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2016年9月7日生效。首次设立募集规模为1,131,247,451.06份基金份额。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定期。本基金的基金管理人和注册登记机构为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《长信先利半年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《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”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定:“有下列情形之一的,并在经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的;”

根据管理人于2022年9月21日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信先利半年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》,基金份额持有人大会于2022年9月19日表决通过了《关于终止长信先利半年定期开放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。根据此次本基金基金份额持有人大会表决通过的前述议案,大会决议生效后,本基金管理人决定自2022年9月22日起安排5个工作日的赎回选择期,即2022年9月22日起至2022年9月28日止,在赎回选择期期间,投资人仅可以办理本基金的赎回业务,不可办理申购业务。本基金最后运作日为2022年9月28日,自2022年9月29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、基金托管人招商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2022年9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                   | 长信先利半年定开混合     |
| 基金主代码                  | 003059         |
| 基金运作方式                 | 契约型开放式         |
| 基金合同生效日                | 2016年9月7日      |
| 报告期末(2022年9月28日)基金份额总额 | 10,494,673.08份 |

|                 |   |              |
|-----------------|---|--------------|
| 投资目标            | 本基金通过积极主动的资产管理，在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。   |              |
| 投资策略            | <p>(一) 封闭期投资策略</p> <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，并追求稳健的绝对收益。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> |              |
| 业绩比较基准          | 中证综合债指数收益率*80%+中证 500 指数收益率*20%   |              |
| 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           | 招商银行股份有限公司  |              |
| 下属分级基金的基金简称：    | 长信先利半年定开混合 A  | 长信先利半年定开混合 C |
| 下属分级基金的交易代码：    | 003059  | 008041       |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,494,144.31 份   | 528.77 份     |

### § 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2016]1575号《关于准予长信先利半年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》的注册，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2016年9月7日生效。首次设立募集规模为1,131,247,451.06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，经与基金托管人招商股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。基金管理人于2022年8月19日0:00起至2022年9月18日17:00止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议了《关于终止长信先利半年定期开放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2022年9月19日表决通过了《关于终止长信先利半年定期开放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。根据基金管理人2022年9月21日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信先利半年定期开放混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，根据此次本基金基金份额持有人大会表决通过的前述议案，大会决议生效后，本基金管理人决定自2022年9月22日起安排5个工作日的赎回选择期，即2022年9月22日起至2022年9月28日止，在赎回选择期期间，投资人仅可以办理本基金的赎回业务，不可办理申购业务。本基金最后运作日为2022年9月28日，自2022年9月29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 长信先利半年定期开放混合型证券投资基金 2022 年 9 月 28 日(基金最后运作日) 资产负债表（经审计）

会计主体：长信先利半年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 9 月 28 日

单位：人民币元

| 资产          | 最后运作日<br>2022 年 9 月 28 日 |
|-------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>  |                          |
| 银行存款        | 13,094,992.70            |
| 结算备付金       | 348,036.99               |
| 存出保证金       | 2,569.56                 |
| 资产总计        | 13,445,599.25            |
| 负债和净资产      | 最后运作日<br>2022 年 9 月 28 日 |
| <b>负债：</b>  |                          |
| 应付赎回款       | 998,455.94               |
| 应付管理人报酬     | 23,312.29                |
| 应付托管费       | 3,885.38                 |
| 应付销售服务费     | 883.37                   |
| 应交税费        | 216.64                   |
| 其他负债        | 36,594.00                |
| 负债合计        | 1,063,347.62             |
| <b>净资产：</b> |                          |
| 实收基金        | 10,494,673.08            |
| 未分配利润       | 1,887,578.55             |

|          |               |
|----------|---------------|
| 净资产合计    | 12,382,251.63 |
| 负债和净资产总计 | 13,445,599.25 |

注：报告截止日 2022 年 9 月 28 日（基金最后运作日），基金份额总额 10,494,673.08 份，其中 A 类基金份额净值 1.1799 元，基金份额 10,494,144.31 份；C 类基金份额净值 1.1779 元，基金份额 528.77 份。

## § 5 基金财产分配

自 2022 年 9 月 29 日至 2022 年 10 月 20 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 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金为人民币 348,036.99 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 347,911.71 元，应计备付金利息人民币 125.28 元。上述结算备付金已于 2022 年 10 月 11 日将其中的 276,483.14 元划入至托管账户，其余款项及应计备付金利息将于 2022 年 10 月 20 日之后划入托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金为人民币 2,569.56 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存出保证金人民币 1,804.40 元，应计存出保证金利息人民币 0.64 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 764.28 元，应计存出保证金利息人民币 0.24 元。上述存出保证金已于 2022 年 10 月 11 日全部划入托管账户，应计存出保证金利息将于 2022 年 10 月 20 日之后划入托管账户。

### 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 998,455.94 元，该款项已于 2022 年 9 月 29 日、2022 年 9 月 30 日分笔支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 23,312.29 元，该款项已于 2022 年 10 月 11 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,885.38 元，该款项已于 2022 年 10 月 11 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 883.37 元，该款项已于 2022 年 10 月 11 日支

付。

5.2.5 本基金最后运作日应交税费为人民币 216.64 元，该款项已于 2022 年 10 月 11 日支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债为人民币 36,594.00 元，其中预提中债账户维护费人民币 4,500.00 元，已于 2022 年 10 月 11 日支付；预提上清债账户维护费人民币 4,800.00 元，已于 2022 年 10 月 11 日支付；应付交易费为人民币 2,614.00 元，已于 2022 年 10 月 11 日、2022 年 10 月 12 日分笔支付；预提划款手续费人民币 680.00 元，已于 2022 年 10 月 14 日支付；预提年度审计费人民币 24,000.00 元将于 2022 年 10 月 20 日之后支付。

### 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目           | 自2022年9月29日至2022年10月20日止清算期间 |
|--------------|------------------------------|
| 一、清算收益       |                              |
| 1、利息收入（注1）   | 2,768.84                     |
| 2、其他业务收入（注2） | 4,444.76                     |
| 清算收益小计       | 7,213.60                     |
| 二、清算费用       |                              |
| 1、划款手续费（注3）  | 105.00                       |
| 清算费用小计（注4）   | 105.00                       |
| 三、清算净收益      | 7,108.60                     |

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2022 年 9 月 29 日至 2022 年 10 月 20 日止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。该利息将于 2022 年 10 月 20 日之后或下一个结息日划入托管账户。

2、其他业务收入系 2022 年 9 月 28 日的赎回申请，于 2022 年 9 月 29 日赎回确认后所得赎回费收入。

3、划款手续费系清算期间支付费用产生，其中 35 元已于 2022 年 10 月 14 日支付，剩余 70 元将于 2022 年 10 月 20 日之后或托管行下一个扣款日划出托管账户。

4、本次清算期间产生的其他清算费用由本基金基金管理人承担。

### 5.4 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2022年9月28日基金净资产 | 12,382,251.63 |

|  |               |
|--|---------------|
| 加：清算期间净收益                                | 7,108.60      |
| 减：基金净赎回转出金额<br>(于2022年9月29日确认的投资者赎回转出申请) | 634,730.14    |
| 二、2022年10月20日基金净资产                       | 11,754,630.09 |

注：根据本基金的基金合同及基金管理人于2022年9月21日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信先利半年定期开放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。清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金孳生的利息归基金份额持有人所有。

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到账的结算备付金及未结息金额，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2022年10月20日止的净资产为人民币11,754,630.09元，其中长信先利半年定开混合A资产净值为11,754,006.83元，长信长信先利半年定开混合C资产净值为623.26元。

截至2022年10月20日止，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11,702,527.77元。

## 5.5 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、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金财务报表及审计报告；
- 2、《长信先利半年定期开放混合型证券投资基金清算报告》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：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信先利半年定期开放混合型证券投资基金财产清算小组

2022年10月20日