

长信稳利资产配置一年持有期混合型基金 中基金（FOF）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：2023年10月30日

清算报告公告日：2023年11月2日

§ 1 重要提示

长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)(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》、《长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》(以下简称“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[2020]289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。本基金首次设立募集基金份额为675,052,622.64份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(20)第00433号验资报告。基金合同于2020年8月24日正式生效。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,在履行适当程序后,《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2023年9月13日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)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2023年9月11日表决通过了《关于终止长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)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2023年9月14日起安排5个工作日的赎回选择期,即2023年9月14日起至2023年9月20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2023年9月20日,自2023年9月21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2023年9月21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 | 长信稳利一年持有混合(FOF) |
| 基金主代码 | 009209 |
| 交易代码 | 009209 |

| | |
|-------------------------|--|
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020年8月24日 |
| 最后运作日（2023年9月20日）基金份额总额 | 6,748,776.41份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于公开募集的基金产品，通过稳定的资产配置和精细化优选基金，在严格控制投资风险和保障资产流动性的基础上，力争提供持续稳定的回报。 |
| 投资策略 | 本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的基金选择相结合的主动投资策略，资产配置包含了大类资产配置策略和基金优选策略。 |
| 业绩比较基准 | 20%*中证股票型基金指数收益率+80%*中证债券型基金指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，预期收益和风险水平低于股票型基金、股票型基金中基金，高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金、货币型基金中基金。 |
| 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[2020]289号《关于准予长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)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2020年8月24日正式生效，首次设立募集规模为675,052,622.64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。基金管理人以通讯方式召开了基金份额持有人大会，投票表决时间自2023年8月14日0:00起至2023年9月10日17:00止，会议期间审议了《关于终止长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同有关事项的议案》。

本次基金份额持有人大会于2023年9月11日表决通过了《关于终止长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)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2023年9月14日起安排5个工作日的赎回选择期，即2023年9月14日起至2023年9月20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 2023 年 9 月 20 日，自 2023 年 9 月 21 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 资产负债表（经审计）

会计主体：长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)

单位：人民币元

| 资 产 | 清算结束日 2023 年 10 月 16 日 | 最后运作日 2023 年 9 月 20 日 |
|---------------|---------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 7,147,435.22 | 5,338,077.68 |
| 结算备付金 | 24.75 | 22,070.92 |
| 存出保证金 | 1.52 | 1,797.52 |
| 应收股利 | - | 99.67 |
| 交易性金融资产 | - | 6,164,174.04 |
| 其他资产 | - | 280.72 |
| 资产总计 | 7,147,461.49 | 11,526,500.55 |
| 负 债 和 净 资 产 | 清算结束日 2023 年 10 月 16 日 | 最后运作日 2023 年 9 月 20 日 |
| 负 债： | | |
| 应付赎回款 | - | 4,364,834.87 |
| 应付管理人报酬 | - | 3,251.05 |
| 应付托管费 | - | 1,084.84 |
| 其他负债 | 15,000.00 | 27,948.94 |
| 负债合计 | 15,000.00 | 4,397,119.70 |
| 净 资 产： | | |
| 实收基金 | 6,743,796.80 | 6,748,776.41 |
| 未分配利润 | 388,664.69 | 380,604.44 |
| 净资产合计 | 7,132,461.49 | 7,129,380.85 |
| 负债和净资产总计 | 7,147,461.49 | 11,526,500.55 |

注：本基金最后运作日 2023 年 9 月 20 日，长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）份额净值人民币 1.0564 元，基金份额总额 6,748,776.41 份。

4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金(FOF)

清算损益表

单位：人民币元

| 项目 | 2023年9月21日(清算开始日)至 2023年10月16日(清算结束日)止期间 |
|--------------------------|---|
| 一、 收入 | 8,492.97 |
| 1、利息收入（注1） | 670.46 |
| 2、投资收益(损失以“-”填列)（注2） | 19,325.56 |
| 3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)（注3） | -11,503.05 |
| 4、其他收入(损失以“-”填列) | - |
| 二、 费用 | 151.87 |
| 1、管理人报酬（注4） | - |
| 2、基金托管费（注4） | - |
| 3、税金及附加 | - |
| 4、其他费用（注5） | 151.87 |
| 三、 利润总额 | 8,341.10 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、 净收益 | 8,341.10 |

注：1、利息收入共计人民币 670.46 元，系以适用利率预估计提的自 2023 年 9 月 21 日(清算开始日)至 2023 年 10 月 16 日(清算结束日)止期间的银行存款利息收入人民币 642.98 元，结算备付金利息收入人民币 25.61 元和交易保证金利息收入人民币 1.87 元。

2、投资收益系自 2023 年 9 月 21 日(清算开始日)至 2023 年 10 月 16 日(清算结束日)止清算期间处置交易性金融资产（包括债券、基金）实现的差价收入和基金投资产生的红利收益。

3、公允价值变动损益系最后运作日所持交易性金融资产（包括债券、基金）清算期间的公允价值变动损益。

4、根据《长信基金管理有限责任公司关于长信稳利资产配置一年持有期混合型证券投资基金（FOF）基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金自 2023 年 9 月 21 日起，停止收取基金管理费、基金托管费。

5、其他费用为人民币 151.87 元，系自 2023 年 9 月 21 日(清算开始日)至 2023 年 10 月 16 日(清算结束日)止期间支付费用产生的汇划费。

§ 5 基金财产分配

自2023年9月21日(清算开始日)至2023年10月16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 5,338,077.68 元，其中活期存款人民币 5,337,015.90 元，应计活期存款利息人民币 1,061.78 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（2023 年 10 月 16 日）银行存款为人民币 7,147,435.22 元，其中活期存款人民币 7,146,844.10 元，应计活期存款利息人民币 591.12 元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币 22,070.92 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 15,643.79 元，应计结算备付金利息人民币 33.09 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 6,390.27 元，应计结算备付金利息人民币 3.77 元。经过 2023 年 10 月 16 日备付金调整后，于清算结束日（2023 年 10 月 16 日）剩余上海最低备付金利息人民币 17.50 元，应计深圳最低备付金利息人民币 7.25 元；

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币 1,797.52 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 1,400.30 元，应计存出保证金利息人民币 4.71 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 390.27 元，应计存出保证金利息人民币 2.24 元。经过 2023 年 10 月 10 日保证金调整后，于清算结束日（2023 年 10 月 16 日）剩余上海存出保证金利息人民币 1.14 元，应计深圳存出保证金利息人民币 0.38 元。

5.1.4 本基金最后运作日持有交易性金融资产为人民币 6,164,174.04 元，该款项包含债券投资人民币 709,733.48 元，基金投资人民币 5,454,440.56 元，所有投资已于 2023 年 10 月 16 日（清算结束日）前处置。

5.1.5 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 4,364,834.87 元，已于 2023 年 10 月 16 日（清算结束日）前支付。

5.1.6 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,251.05 元，已于 2023 年 10 月 16 日（清算结束日）前支付。

5.1.7 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,084.84 元，已于 2023 年 10 月 16 日（清算结束日）前支付。

5.1.8 本基金最后运作日其他负债为人民币 27,948.94 元，其中：应付赎回费共计人民币 5378.76 元，已于 2023 年 10 月 16 日（清算结束日）前支付；应付交易费用共计人民币 3070.18 元，已于 2023 年 10 月 16 日（清算结束日）前支付；预提中债账户维护费共计人民币 4,500.00 元，已于 2023 年 10 月 16 日（清算结束日）前支付；预提清算审计费共计人民币 15,000.00 元，将于 2023 年 10 月 16 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2023年9月20日基金净资产 | 7,129,380.85 |
| 加：清算期间净收益 | 8,341.10 |
| 减：基金净赎回转出金额 （于2023年9月21日确认的投资者赎回转出申请） | 5,260.46 |
| 二、2023年10月16日基金净资产 | 7,132,461.49 |

注：根据本基金的基金合同及基金管理人于2023年9月13日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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2023年10月16日止的净资产为人民币7,132,461.49元。

截至2023年10月16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7,146,844.10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、长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）清算财务报表及审计报告；
- 2、《长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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>。

长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）财产清算小组

2023年10月30日