

# 长信恒利优势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：中国建设银行股份有限公司

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

长信恒利优势混合型证券投资基金(原名长信恒利优势股票型证券投资基金,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》、《长信恒利优势股票型证券投资基金基金合同》(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[2009]439号文核准公开募集。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984,485,380.44份,经上海众华沪银会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为沪众会字(2009)第3646号验资报告。基金合同于2009年7月30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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据基金合同“十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“(二)本基金合同的终止”的约定:“有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止: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恒利优势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日以现场方式表决通过了《关于终止长信恒利优势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恒利优势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、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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	长信恒利优势混合
场内简称	长信恒利
基金主代码	519987

交易代码	519987
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月30日
最后运作日（2024年4月26日） 基金份额总额	16,673,479.93份
投资目标	把握经济及产业发展趋势和市场运行特征，充分利用产业升级和产业结构调整的机会，挖掘在经济发展以及市场运行不同阶段中优势产业内所蕴含的投资机会，重点投向受益于产业增长和兼具优质品质的个股，力争获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金实行风险管理下的主动投资策略，即采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，自上而下是以战略的角度强调资产配置和组合管理，自下而上是以战术的角度强调精选个股。具体而言，在资产配置和组合管理方面，利用组合管理技术和金融工程相结合的方法，严格控制及监测组合的风险和保持组合流动性。在股票组合方面，自上而下通过深入研究宏观经济环境、市场环境、产业特征等因素，优选增长前景良好和增长动力充分，具备价值增值优势的产业作为重点投资对象，并结合自下而上的对上市公司的深入分析，投资于精选出来的个股，为投资者获取优势产业增长所能带来的最佳投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数*70%+上证国债指数*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	中国建设银行股份有限公司

### § 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2009]439号《关于核准长信恒利优势股票型证券投资基金募集的批复》核准募集，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2009年7月30日正式生效，首次设立募集规模为984,485,380.44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建设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4月25日上午10时00分以现场方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议了《关于终止长信恒利优势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《关于终止长信恒利优势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恒利优势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：长信恒利优势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
<b>资产：</b>		
银行存款	14,448,347.76	3,996,650.44
结算备付金	15,055.95	85,725.74
存出保证金	7,995.14	6,453.81
应收股利	-	-
交易性金融资产	-	11,474,453.94
其他资产	-	-
资产总计	14,471,398.85	15,563,283.93
负债和净资产	清算结束日 2024年5月22日	最后运作日 2024年4月26日
<b>负债：</b>		
应付赎回款	-	3,899.97
应付管理人报酬	-	14,997.13
应付托管费	-	2,499.49
其他负债	15,000.00	17,695.95
负债合计	15,000.00	39,092.54
<b>净资产：</b>		
实收基金	15,622,907.17	16,673,479.93
未分配利润	-1,166,508.32	-1,149,288.54
净资产合计	14,456,398.85	15,524,191.39
负债和净资产总计	14,471,398.85	15,563,283.93

注：本基金最后运作日2024年4月26日，长信恒利优势混合型证券投资基金份额净值人民币0.931元，基金份额总额16,673,479.93份。

## 4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信恒利优势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
<b>一、 收入</b>	<b>-89,709.31</b>
1、利息收入（注1）	3,402.68
2、投资收益(损失以“-”填列)（注2）	410,489.47
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)（注3）	-504,042.74
4、其他收入(损失以“-”填列)（注4）	441.28
<b>二、 费用</b>	<b>-</b>
1、管理人报酬（注5）	-
2、基金托管费（注5）	-
3、税金及附加	-
4、其他费用	-
<b>三、 利润总额</b>	<b>-89,709.31</b>
减：所得税费用	-
<b>四、 净收益</b>	<b>-89,709.31</b>

注：1、利息收入共计人民币3,402.68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3,325.72元，结算备付金利息收入人民币68.30元和存出保证金利息收入人民币8.66元。

- 2、投资收益系自2024年4月27日(清算开始日)至2024年5月22日(清算结束日)止清算期间处置交易性金融资产（包括债券、股票）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、股票）在清算期间的公允价值变动损益。
- 4、其他收入系2024年4月26日的赎回申请，于2024年4月29日赎回确认后产生的基金赎回费收入共计人民币441.28元。
- 5、根据《长信基金管理有限责任公司关于长信恒利优势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。

## §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3,996,650.44元，其中活期存款人民币3,993,581.71元，应计活期存款利息人民币3,068.73元；上述活期存款在清算期支付了赎回款、管理费、托管费等费用、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14,448,347.76元，其中活期存款人民币14,441,953.31元，应计活期存款利息人民币6,394.45元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币85,725.74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56,099.19元，应计结算备付金利息人民币61.84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29,515.50元，应计结算备付金利息人民币49.21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15,055.95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7,523.37元，应计结算备付金利息人民币105.56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7,353.23元，应计结算备付金利息人民币73.79元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币6,453.81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2,759.88元，应计存出保证金利息人民币4.20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3,684.04元，应计存出保证金利息人民币5.69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7,995.14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4,002.58元，应计存出保证金利息人民币8.28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3,974.01元，应计存出保证金利息人民币10.27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11,474,453.94元，该款项包含股票投资人民币10,563,134.90元，债券投资人民币911,319.04元，所有投资已于2024年5月22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3,899.97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管理人报酬为人民币 14,997.13 元,已于 2024 年 5 月 22 日(清算结束日)前支付。

5.1.7 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,499.49 元,已于 2024 年 5 月 22 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 17,695.95 元,其中:应付赎回费共计人民币 1.51 元,已于 2024 年 5 月 22 日(清算结束日)前支付;应付交易费用共计人民币 2,694.44 元,已于 2024 年 5 月 22 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 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	15,524,191.39
加:清算期间净收益	-89,709.31
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)	978,083.23
二、2024年5月22日基金净资产	14,456,398.85

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恒利优势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归基金份额持有人所有,在此期间产生所有费用由基金管理人承担。

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产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 日的净资产为人民币 14,456,398.85 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、长信恒利优势混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告；
- 2、《长信恒利优势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>。

长信恒利优势混合型证券投资基金财产清算小组

2024年6月12日