

长信价值优选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：国泰君安证券股份有限公司

清算报告出具日：2024年7月12日

清算报告公告日：2024年7月19日

§ 1 重要提示

长信价值优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)(以下简称“长信中证能源互联网指数(LOF)”)变更注册而来。长信中证能源互联网指数(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》、《长信中证能源互联网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]2703号文注册并准予公开募集,于2016年1月21日募集成立。长信中证能源互联网指数(LOF)为上市契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为242,530,801.91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1600092号验资报告。长信中证能源互联网指数(LOF)的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

长信中证能源互联网指数(LOF)自2019年1月2日0:00至2019年1月18日17:00期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会审议了《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》(以下简称“《议案》”),并由参加大会的基金份额持有人及其代理人对《议案》表决通过,决议于2019年1月21日生效。长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)变更为长信价值优选混合型证券投资基金,变更注册后的《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2019年2月26日生效。本基金的基金管理人和基金托管人保持不变。

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,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;”。

根据基金管理人于2024年6月28日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信价值优选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2024年6月27日表决通过了《关于终止长信价值优选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。本基金最后运作日为2024年6月28日,自本基金最后运作日的下一日(2024年6月29日)起,本基金即进入清算程序,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）和上海源泰律师事务所于 2024 年 7 月 1 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	长信价值优选混合
基金主代码	501002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 2 月 26 日
最后运作日（2024 年 6 月 28 日）基金份额总额	45,332,543.38 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过精选具有估值优势和成长优势的上市公司股票和优质债券进行投资，力争以较低的风险获得中高水平的收益，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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，并追求稳健的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债券指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
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

本基金由长信中证能源互联网指数 (LOF) 变更注册而来，长信中证能源互联网指数 (LOF) 经中国证监会以证监许可[2015]2703 号文注册并准予公开募集，于 2016 年 1 月 21 日募集成立。首次设立募集规模为 242,530,801.91 份基金份额。

长信中证能源互联网指数(LOF)自2019年1月2日0:00至2019年1月18日17:00期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会审议了《关于长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》(以下简称“《议案》”),并由参加大会的基金份额持有人及其代理人对《议案》表决通过,决议于2019年1月21日生效。长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)变更为长信价值优选混合型证券投资基金,变更注册后的《长信价值优选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2019年2月26日生效。本基金的基金管理人和基金托管人保持不变。

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,经与基金托管人国泰君安证券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5月28日0:00起至2024年6月26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《关于终止长信价值优选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6月27日表决通过了《关于终止长信价值优选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。本基金最后运作日为2024年6月28日,自本基金最后运作日的下一日(2024年6月29日)起,本基金即进入清算程序,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:长信价值优选混合型证券投资基金

单位:人民币元

资产	清算结束日 2024年7月3日	最后运作日 2024年6月28日
资产:		
货币资金	19,982,468.34	31,365,941.43
结算备付金	172,384.58	172,345.83
存出保证金	53,446.70	48,946.42
应收股利	9,508.78	21,368.78

资产总计	20,217,808.40	31,608,602.46
负债和净资产	清算结束日	最后运作日
	2024年7月3日	2024年6月28日
负债:		
应付赎回款	-	1,039.72
应付管理人报酬	-	39,058.05
应付托管费	-	3,254.86
其他负债	89,589.80	89,591.22
负债合计	89,589.80	132,943.85
净资产:		
实收基金	28,979,872.34	45,332,543.38
未分配利润	-8,851,653.74	-13,856,884.77
净资产合计	20,128,218.60	31,475,658.61
负债和净资产总计	20,217,808.40	31,608,602.46

注：本基金最后运作日 2024 年 6 月 28 日，长信价值优选混合型证券投资基金份额净值人民币 0.6943 元，基金份额总额 45,332,543.38 份。

4.2 清算损益表（经审计）

会计主体：长信价值优选混合型证券投资基金

单位：人民币元

项目	2024年6月29日(清算开始日)至2024年7月3日(清算结束日)止期间
一、收入	6,219.50
1、利息收入(注1)	6,095.63
2、投资收益(损失以“-”填列)	-
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-
2、其他收入(损失以“-”填列)(注2)	123.87
二、费用	-
1、管理人报酬(注3)	-
2、基金托管费(注3)	-
3、税金及附加	-
三、利润总额	6,219.50
减：所得税费用	-
四、净收益	6,219.50

注：1、利息收入共计人民币 6,095.63 元，系以当前适用利率预估计提的自 2024 年 6 月 29 日(清算开始日)至 2024 年 7 月 3 日(清算结束日)止期间的银行存款利息收入人民币 6,045.48 元，结算备付金利息收入人民币 38.75 元和存出保证金利息收入人民币 11.40 元。

2、其他收入为人民币 123.87 元，系 2024 年 7 月 1 日产品赎回确认产生的基金赎回费收入人民币 123.87 元。

3、根据《长信基金管理有限责任公司关于长信价值优选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6月29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6月29日至2024年7月3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 本基金最后运作日货币资金为人民币31,365,941.43元，其中活期存款人民币31,355,726.10元，应计活期存款利息人民币10,215.33元；上述活期存款在清算期支付了赎回款、赎回费、管理费、托管费、收到了部分应收股利、调整了存出保证金后，于清算结束日（2024年7月3日）货币资金为人民币19,982,468.34元，其中活期存款人民币19,966,207.53元，应计活期存款利息人民币16,260.81元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币172,345.83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163,596.95元，应计结算备付金利息人民币58.88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8,686.88元，应计结算备付金利息人民币3.12元。于清算结束日（2024年7月3日）结算备付金为人民币172,384.58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163,596.95元，应计结算备付金利息人民币95.68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8,686.88元，应计结算备付金利息人民币5.07元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币48,946.42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34,246.99元，应计存出保证金利息人民币12.32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14,681.83元，应计存出保证金利息人民币5.28元。经过2024年7月2日保证金调整后，于清算结束日（2024年7月3日）存出保证金为人民币53,446.70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38,239.51元，应计存出保证金利息人民币20.38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15,178.19元，应计

存出保证金利息人民币8.62元。

5.1.4 本基金最后运作日应收股利为人民币21,368.78元，其中通过港股通购买的建滔集团股票应收股利人民币3,016.60元；中国海洋石油股票应收股利人民币6,492.18元；中远海控股票应收股利人民币9,844.00元；中海油田服务股票应收股利人民币2,016.00元；清算期间收到了中远海控股票应收股利人民币9,844.00元和中海油田服务股票应收股利人民币2,016.00元；于清算结束日（2024年7月3日）应收股利为人民币9,508.78元，其中建滔集团股票应收股利人民币3,016.60元；中国海洋石油股票应收股利人民币6,492.18元。

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1,039.72元，该款项已于2024年7月3日前支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币39,058.05元，该款项已于2024年7月3日前支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币3,254.86元，该款项已于2024年7月3日前支付。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债为人民币89,591.22元，其中应付赎回费为人民币1.42元，已于2024年7月3日前支付；预提审计费人民币15,000.00元，预提律师费40,000.00元，预提持有人大会费用10,000.00元，预提信息披露费24,589.80元，上述款项将于2024年7月3日之后支付。

5.3 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6月28日基金净资产	31,475,658.61
加：清算期间净收益	6,219.50
减：基金净赎回转出金额 （于2024年7月1日确认的投资者赎回转出申请）	11,353,659.51
二、2024年7月3日基金净资产	20,128,218.60

注：根据本基金的基金合同及基金管理人于2024年6月28日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信价值优选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

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、结算备付金和存出保证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 2024 年 7 月 3 日的净资产为人民币 20,128,218.60 元。

截至 2024 年 7 月 3 日，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（含应计活期存款利息）共人民币 19,982,468.34 元。

5.4 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、长信价值优选混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告；
- 2、《长信价值优选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>。

长信价值优选混合型证券投资基金财产清算小组

2024 年 7 月 19 日