

长信利广灵活配置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：广发证券股份有限公司

清算报告出具日：2024 年 12 月 24 日

清算报告公告日：2024 年 12 月 31 日

§ 1 重要提示

长信利广灵活配置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〔2015〕986号文《关于准予长信利广灵活配置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2015年6月12日正式生效，首次设立募集规模为261,102,567.29份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。根据《关于长信利广灵活配置混合型证券投资基金变更部分基金份额的注册登记机构的公告》，自2019年12月25日起，原通过长信基金管理有限责任公司直销渠道销售的基金份额的注册登记机构由中国证券登记结算有限责任公司转移回长信基金管理有限责任公司。转移完成后，其他渠道销售的基金份额注册登记机构仍为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《长信利广灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《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11月20日发布的《关于长信利广灵活配置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11月18日表决通过了《关于终止长信利广灵活配置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11月20日，自2024年11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、基金托管人广发证券股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2024年11月21日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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	长信利广混合
基金主代码	519961
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月12日
报告期末(2024年11月20日)基金份额总额	5,505,726.88份

投资目标	本基金为混合型基金，通过积极灵活的资产配置，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。 2、股票投资策略 （1）行业配置策略 在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。 （2）个股投资策略 本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。 （3）存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的绝对收益。 4、其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。	
业绩比较基准	银行一年期定期存款利率（税后）+3%	
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	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信利广混合 A	长信利广混合 C
下属分级基金的交易代码	519961	519960
报告期末下属分级基金的份额总额	5,480,444.52 份	25,282.36 份

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证券监督管理委员会证监许可〔2015〕986 号文《关于准予长信利广灵活配置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业募集，基金合同于 2015 年 6 月 12 日正式生效，首次设立募集规模为 261,102,567.29 份基金份额。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人利益，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，经与基金托管人广发证券股份有限公司协商一致，提议终止基金合同。本基金自2024年10月22日0:00起至2024年11月17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《关于终止长信利广灵活配置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11月18日表决通过了《关于终止长信利广灵活配置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2024年11月20日发布的《关于长信利广灵活配置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11月20日，自2024年11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：长信利广灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2024 年 11 月 20 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2024 年 11 月 20 日
资 产：	
货币资金	4,691,802.48
结算备付金	1,393,104.86
存出保证金	49,805.86
买入返售金融资产	20,000.00
应收清算款	1,980,102.47
应收申购款	259.78
资产总计	8,135,075.45

负债和所有者权益	最后运作日 2024 年 11 月 20 日
负 债：	
应付赎回款	10,319.41
应付管理人报酬	3,847.51
应付托管费	961.90
应付销售服务费	5.49
应交税费	72.37
其他负债	15,242.19
负债合计	30,448.87
所有者权益：	
实收基金	5,505,726.88
未分配利润	2,598,899.70
所有者权益合计	8,104,626.58
负债和所有者权益总计	8,135,075.45

注：截至最后运作日，长信利广混合 A 资产净值为 8,067,937.43 元，长信利广混合 C 资产净值为 36,689.15 元。

§ 5 基金财产分配

自2024年11月21日至2024年11月28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4,691,802.48元，其中存放于托管账户人民币4,679,946.74元，应计银行存款利息人民币11,855.74元。截至2024年11月28日，货币资金为人民币5,590,705.36元，其中存放于托管账户人民币5,578,411.89元，应计银行存款利息人民币12,293.47元。
- 5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币1,393,104.86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1,363,333.33元，应计结算备付金利息人民币1,985.64元，该款项将于2024年11月28日后划入托管账户；存放于长江期货股份有限公司的期货备付金人民币12,472.46元，应计结算备付金利息人民币37.18元，该款项已于2024年11月27日划入托管账户；存放于上海中期期货股份有限公司的期货备付金人民币15,264.52元，应计结算备付金利息人民币11.73元，该款项已于2024年11月27日划入托管账户。
- 5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币49,805.86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28,029.81元，应计存出保证金利息人民币83.00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21,616.09元，应计存出保证金利息人民币76.96元。上述款项将于2024年11月28日后划入托管账户。

5.1.4 本基金最后运作日买入返售金融资产为人民币20,000.00元，已于清算期间全部到期收回资金。

5.1.5 本基金最后运作日应收清算款为人民币1,980,102.47元，该款项已于2024年11月21日划入托管账户。

5.1.6 本基金最后运作日应收申购款为人民币259.78元，该款项已于2024年11月21日划入托管账户。

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10,319.41元，该款项已于2024年11月21日支付人民币7,580.68元，于2024年11月22日支付人民币2,738.73元。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币3,847.51元，该款项已于2024年11月25日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币961.90元，该款项已于2024年11月25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5.49元，该款项已于2024年11月25日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应交税费为人民币72.37元，该款项已于2024年11月26日支付。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债为人民币15,242.19元，其中应付赎回费人民币2.19元，该款项已于2024年11月21日支付人民币1.86元，于2024年11月22日支付人民币0.33元；预提审计费用人民币15,000.00元，该款项将于2024年11月28日后支付；预提银行账户管理费人民币240.00元，该款项将于2024年11月28日后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2024年11月21日至2024年11月28日止 清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注）	1,074.20
其中：存款利息收入	952.00

买入返售金融资产利息收入	122.20
2、基金赎回费收入	176.28
清算收益小计	1,250.48
二、清算费用	
1、税金及附加	0.45
清算费用小计	0.45
三、清算净收益	1,250.03

注：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2024 年 11 月 21 日至 2024 年 11 月 28 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，以及买入返售金融资产利息收入。上述利息收入产生的应交增值税已于 2024 年 11 月 26 日支付。2024 年 11 月 28 日后至清算款划出日前的银行存款应计利息、结算备付金应计利息及存出保证金应计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，上述所有利息于剩余资产分配日之前未划入托管账户的，将由基金管理人在剩余资产分配日以自有资金垫付，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。

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2024年11月20日基金净资产	8,104,626.58
加：清算期间净收益	1,250.03
基金净申购转入金额 （于2024年11月21日确认的投资者申购转入申请）	731.35
减：基金净赎回转出金额 （于2024年11月21日确认的投资者赎回转出申请）	1,115,509.13
二、2024年11月28日基金净资产	6,991,098.83

根据本基金的基金合同及《关于长信利广灵活配置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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2024 年 11 月 28 日的剩余财产为人民币 6,991,098.83 元，其中长信利广混合 A 资产净值为 6,957,250.97 元，长信利广混合 C 资产净值为 33,847.86 元。

截至 2024 年 11 月 28 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共人民币 5,578,411.89 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、长信利广灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告；
- 2、《长信利广灵活配置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

长信基金管理有限责任公司网站：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信利广灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2024 年 12 月 31 日