

长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金

清算报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日期：2026年8月5日

清算报告公告日期：2026年8月10日

一、重要提示

长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2020年12月22日经中国证券监督管理委员会证监许可〔2020〕3642号文准予募集注册，自2021年8月17日《长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）生效并正式运作，本基金基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”），基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满 200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，可直接终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”截至2026年7月6日日终，本基金已连续50个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金终止《基金合同》并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。本基金管理人已于2026年7月7日在《证券时报》和基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）刊登了《长盛基金管理有限公司关于长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，具体详见基金管理人相关公告。

本基金最后运作日为2026年7月6日，自2026年7月7日（最后运作日的下一日）起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人兴业银行、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所于2026年7月7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，上海市海华永泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	长盛鑫盛稳健一年持有

基金运作方式	契约型开放式，最短持有期一年
基金合同生效日	2021年8月17日
基金最后运作日(2026年7月6日) 基金份额总额	27,715,257.80份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债；可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0-30%(其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%)；同业存单投资占基金资产的比例不超过20%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。
主要投资策略	在大类资产配置中，本基金将主要考虑：宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险

	相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。 在股票投资方面,本基金将运用基金管理人的研究平台和股票估值体系,深入发掘股票内在价值,结合市场估值水平和股市投资环境,充分考虑行业景气程度、企业竞争优势等因素,有效识别并防范风险,以获取较好收益。 股指期货、国债期货投资将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合对期货合约的估值定价,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。	
业绩比较基准	$\text{中证 800 指数收益率} \times 15\% + \text{中证综合债指数收益率} \times 80\% + \text{恒生综合指数收益率} \times 5\%$	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。 本基金如果投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛鑫盛稳健一年持有A	长盛鑫盛稳健一年持有C
下属分级基金的交易代码	011267	011268
基金最后运作日(2026年7月6日)下属分级基金的份额净值	1.0824	1.0615
基金最后运作日(2026年7月6日)下属分级基金的份额总额	14,079,579.07	13,635,678.73

三、基金运作情况概述

长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金2020年12月22日经中国证券监督管理委员会证监许可〔2020〕3642号文准予注册募集,于2021年8月17日成立并正式运作,首次设立募集规模为365,234,114.13份基金份额(含利息结转份额)。

根据《长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:“《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续50个工作日出现前述情形的,可直接终止《基金合同》,无需召开基金份额持有人大会。法律

法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

截至2026年7月6日日终，本基金已连续50个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金终止《基金合同》并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人应当在出现《基金合同》终止事由后依法进入基金财产清算程序。本基金管理人确定2026年7月6日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2026年7月7日）起本基金进入基金财产清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2026年7月6日（基金最后运作日）

金额单位：人民币元

科目名称	最后运作日 (2026年7月6日)
资 产：	
银行存款	5,535,548.82
结算备付金	406,481.21
存出保证金	7,416.09
交易性金融资产	33,924,187.56
应收证券清算款	4,489,973.76
应收股利	38,183.77
资产总计	44,401,791.21
负债和所有者权益	
负 债：	
应付赎回款	9,593,208.70
应付管理人报酬	6,863.02
应付托管费	1,372.61
应付销售服务费	1,280.29
卖出回购金融资产款	5,012,737.43

应交税费	205.38
其他负债	71,271.94
负债合计	14,686,939.37
所有者权益:	
实收基金	27,715,257.80
未分配利润	1,999,594.04
所有者权益合计	29,714,851.84
负债和所有者权益总计	44,401,791.21

五、清算情况

由于本基金截至第一次清算期结束日(2026年8月5日)仍持有尚无法变现资产，经基金财产清算小组一致同意，本基金将进行二次清算。其中第一次清算期间为2026年7月7日至2026年8月5日，第二次清算期间将根据剩余资产的变现时间确定。

自2026年7月7日至2026年8月5日止第一次清算期间，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：

1、清算费用

按照《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”的约定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，并从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算律师费用将由基金管理人承担，不从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币5,535,548.82元，其中应计利息为人民币219.03元。第一次清算期间银行存款增加人民币23,581,604.40元，其中应计利息增加人民币5,847.85元。截至第一次清算期结束日，银行存款为人民币29,117,153.22元，其中应计利息为人民币6,066.88元。应计银行存款利息将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币406,481.21元，其中上海结算备付金为人民币101,333.83元，应计利息为人民币14.85元；深圳结算备付金为人民币

7,530.58元，应计利息为人民币1.05元；沪港通结算备付金为人民币297,600.90元。第一次清算期间结算备付金减少人民币326,520.16元，其中应计利息增加人民币110.70元。截至第一次清算期结束日，结算备付金为人民币79,961.05元，其中上海结算备付金为人民币76,390.21元，应计利息为人民币37.55元；深圳结算备付金为人民币3,444.24元，应计利息为人民币2.03元；沪港通结算备付金应计利息为人民币87.02元。该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币7,416.09元，其中上海存出保证金为人民币2,358.97元，应计利息为人民币0.41元；深圳存出保证金为人民币1,706.06元，应计利息为人民币0.30元；沪港通风控资金为人民币3,350.35元。第一次清算期间存出保证金减少人民币7,414.22元，其中应计利息增加人民币1.16元。截至第一次清算期结束日，存出保证金为人民币1.87元，其中上海结算保证金应计利息为人民币0.99元；深圳结算保证金应计利息为人民币0.88元。该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

（4）本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 4,489,973.76 元，已于第一次清算期间内划入托管账户。

（5）本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 33,924,187.56 元，其中股票投资为人民币 7,891,522.79 元；债券投资为人民币 26,032,664.77 元。

其中截至第一次清算期结束日已变现的股票明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票代码	数量 (股)	最后运作日 估值单价	最后运作日成本 总额	最后运作日估 值总额
1	羚锐制药	600285	25,800	21.31	546,596.91	549,798.00
2	华域汽车	600741	2,800	16.25	55,746.96	45,500.00
3	长江电力	600900	3,000	27.19	78,847.25	81,570.00
4	杭州银行	600926	17,800	15.34	296,686.06	273,052.00
5	赛轮轮胎	601058	5,800	12.95	91,802.35	75,110.00
6	中国神华	601088	3,800	41.91	159,185.57	159,258.00

7	紫金矿业	601899	9,800	28.28	198,546.22	277,144.00
8	顾家家居	603816	18,800	22.06	575,529.78	414,728.00
9	美的集团	000333	18,800	80.00	1,292,141.90	1,504,000.00
10	东阿阿胶	000423	13,800	47.54	699,889.05	656,052.00
11	云铝股份	000807	4,500	22.88	138,051.20	102,960.00
12	神火股份	000933	3,800	22.52	106,505.35	85,576.00
13	招商积余	001914	32,800	8.65	328,762.28	283,720.00
14	宁波银行	002142	7,300	30.71	220,269.92	224,183.00
15	统一企业中国	00220	10,000	6.68	65,984.48	66,821.37
16	腾讯控股	00700	4,500	392.25	1,941,155.93	1,765,125.54
17	中国海洋石油	00883	39,000	18.26	678,852.56	712,090.17
18	颐海国际	01579	5,000	12.45	59,165.13	62,265.37
19	中煤能源	01898	62,000	8.91	666,264.12	552,569.34
合计					8,199,983.02	7,891,522.79

以上股票投资于第一次清算期间（2026年7月7日至2026年8月5日）处置变现，
处置净损益为人民币87,584.38元。

其中截至第一次清算期结束日已变现债券投资明细如下：

金额单位：人民币元

序号	债券名称	债券代码	数量	最后运作日 估值单价（含 应计利息）	最后运作日 成本总额（含应计 利息）	最后运作日 估值总额 （含应计利息）
1	25 国债 13	019785	25,000	101.27	2,531,302.87	2,531,860.27
2	电力 YK01	241145	30,000	100.68	3,002,676.16	3,020,459.18
3	24 凯盛 K1	241439	20,000	102.16	2,031,077.81	2,043,112.88
4	24 青城 14	241774	20,000	102.29	2,026,977.53	2,045,820.38
5	24 北汽 02	241882	20,000	102.30	2,023,895.01	2,045,962.41
6	24 金隅 K3	242163	20,000	101.40	2,017,773.70	2,028,021.04
7	25 漳九 Y4	244336	20,000	103.59	2,024,716.28	2,071,863.78

8	24 工行永续债 01	242480007	20,000	104.26	2,057,832.98	2,085,284.93
9	24 中行永续债 02BC	242480086	20,000	102.72	2,021,796.36	2,054,480.77
10	25 邮储永续债 01BC	242580002	30,000	101.61	3,018,817.11	3,048,395.51
11	25 建行永续债 01BC	242580012	20,000	101.11	2,001,499.39	2,022,274.41
12	25 五矿集 MTN012	102584657	10,000	103.51	1,007,918.13	1,035,129.21
合计					25,766,283.33	26,032,664.77

以上债券投资于第一次清算期间（2026年7月7日至2026年8月5日）处置变现，处置净损益为人民币22,680.13元，清算期间产生的债券利息收入为人民币20,070.48元。

（6）本基金最后运作日应收股利为人民币38,183.77元。第一次清算期间收到应收股利为人民币25,337.37元。截至第一次清算期结束日，应收股利为人民币12,846.40元。该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。

3、负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付赎回款为人民币9,593,208.70元，应付管理人报酬为人民币6,863.02元，应付托管费为人民币1,372.61元，应付销售服务费为人民币1,280.29元，卖出回购金融资产款为人民币5,012,737.43元，应交税费为人民币205.38元，已于第一次清算期间内支付。

（2）本基金最后运作日其他负债为人民币71,271.94元，其中应付赎回费为人民币186.48元，应付交易费用为人民币9,094.70元，预提上清所账户维护费为人民币6,100.00元，预提中债登账户维护费为人民币6,000.00元，已于第一次清算期间内支付；预提审计费为人民币10,000.00元，预提信息披露费为人民币39,890.76元，将于完成付款流程后支付。

4、第一次清算期间的清算损益情况

金额单位：人民币元

项目	自2026年7月7日至2026年8月5日止的第一次清算期间
----	-------------------------------

一、第一次清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	5,959.90
投资收益（注2）	130,334.99
第一次清算期间收益小计	136,294.89
二、第一次清算期间支出	
卖出回购金融资产利息支出	1,564.43
银行划款费	413.39
账户查询费	300.00
税金及附加	12.62
第一次清算期间支出小计	2,290.44
三、第一次清算期间净收益	134,004.45

注1:利息收入系计提的2026年7月7日至2026年8月5日止的第一次清算期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入和存出保证金利息收入。

注2:投资收益系清算期间交易性金融资产处置净损益和债券利息收入。

5、第一次清算期间的剩余资产分配情况

金额单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2026年7月6日基金净资产	29,714,851.84
加：第一次清算期间净收益	134,004.45
减：基金净赎回金额（于2026年7月7日确认的投资者赎回申请）	688,784.51
二、第一次清算期结束日2026年8月5日基金净资产	29,160,071.78

截至第一次清算期结束日（2026年8月5日），本基金剩余财产为人民币29,160,071.78元，扣除截至第一次清算期结束日（2026年8月5日）持有的未变现资产后，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组将依据基金财产清算的分配方案，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（本基金的清算律师费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付）、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。

由于本基金截至第一次清算期结束日（2026年8月5日）持有未变现资产，未变现资产包含结算备付金、应计利息和应收股利，本基金将根据变现情况进行后续二次清算流程，将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用（本基金的清算律师

费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付）、交纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行二次分配，直至全部基金财产清算完毕。

自第一次清算期结束日次日（2026年8月6日）至清算款划出日前一日的银行存款等产生的利息亦属基金份额持有人所有，将在第二次清算期间进行分配。

6、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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

- （1）《长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金清算审计报告》；
- （2）《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金清算报告>之法律意见》。

2、存放地点

存放于基金管理人的办公地址。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内到基金管理人的办公地址免费查阅。

长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

2026年8月10日