

长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金

第二次清算报告

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9月23日

清算报告公告日期：2026年9月29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号文准予注册募集，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.csfund.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。

本基金第一次清算期间为2026年7月7日至2026年8月5日。本基金的基金管理人于2026年8月10日对《长盛鑫盛稳健一年持有期混合型证券投资基金清算报告》进行了公告，并于2026年8月14日支付了第一次清算款。

本基金于2026年8月6日进入第二次清算期间，至2026年9月22日已完成所有资产变现，本次清算期间为2026年8月6日至2026年9月22日。本清算报告已经基金托管人

复核，在经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计、上海市海华永泰律师事务所出具法律意见书后，已报中国证券监督管理委员会备案。

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
第一次清算结束日（2026年8月5日）基金份额总额	27,078,136.06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
第一次清算结束日（2026年8月5日）下属分级基金的份额净值	1.0874	1.0664
第一次清算结束日（2026年8月5日）下属分级基金的份额总额	13,482,460.93	13,595,675.13

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

第一次清算结束日资产负债表（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8月5日

金额单位：人民币元

科目名称	第一次清算结束日 (2026年8月5日)
资 产：	
银行存款	29,117,153.22
结算备付金	79,961.05
存出保证金	1.87

交易性金融资产	
应收证券清算款	
应收股利	12,846.40
资产总计	29,209,962.54
负债和所有者权益	
负 债:	
应付赎回款	
应付管理人报酬	
应付托管费	
应付销售服务费	
卖出回购金融资产款	
应交税费	
其他负债	49,890.76
负债合计	49,890.76
所有者权益:	
实收基金	27,078,136.06
未分配利润	2,081,935.72
所有者权益合计	29,160,071.78
负债和所有者权益总计	29,209,962.54

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，本基金进行二次清算。本次清算为本基金的第二次清算，自2026年8月6日至2026年9月22日止，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) 本基金第一次清算结束日银行存款为人民币29,117,153.22元，其中包含应计利息人民币6,066.88元。第二次清算期间产生支付第一次清算款、变现交收以及支

付税费等资金变动共计减少银行存款人民币29,015,261.37元；第二次清算期间计提的银行存款利息为人民币2,568.77元，并于2026年9月21日收到银行存款结息人民币8,634.78元。截至第二次清算期结束日，银行存款余额为人民币101,891.85元，其中应计银行存款利息人民币0.87元。该应计银行存款利息将于第二次清算期结束后由基金管理人以自有资金先行垫付，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。

（2）本基金第一次清算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；沪港通结算备付金为人民币0.00元，应计利息为人民币87.02元。第二次清算期间上海结算备付金转入托管账户人民币76,390.21元，深圳结算备付金转入托管账户人民币3,444.24元，共计提利息人民币33.17元，并于2026年9月21日收到结算备付金结息人民币159.77元。截至第二次清算期结束日，结算备付金余额为人民币0.00元。

（3）本基金第一次清算结束日存出保证金为人民币1.87元，其中上海存出保证金为人民币0.00元，应计利息为人民币0.99元；深圳存出保证金为人民币0.00元，应计利息为人民币0.88元。第二次清算期间共计提利息人民币0.32元，并于2026年9月21日收到存出保证金结息人民币2.19元。截至第二次清算期结束日，存出保证金余额为人民币0.00元。

（4）本基金第一次清算期结束日应收股利为人民币12,846.40元，已于第二次清算期间内划入托管账户。

3、负债清偿情况

（1）本基金第一次清算期结束日其他负债为人民币49,890.76元，其中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、第二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8月6日
----	------------

	至2026年9月22日止的第二次清算期间
一、第二次清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	2,602.26
第二次清算期间收益小计	2,602.26
二、第二次清算期间支出	
银行划款费（注2）	-413.39
第二次清算期间支出小计	-413.39
三、第二次清算期间净收益	3,015.65

注1：利息收入系2026年8月6日至2026年9月22日止第二次清算期间产生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：银行划款费系第二次清算期间银行划款手续费返还。

5、第二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、第一次清算结束日2026年8月5日基金净资产	29,160,071.78
加：第二次清算期间净收益	3,015.65
减：划付第一次清算金额	29,111,086.34
二、第二次清算期结束日2026年9月22日基金净资产	52,001.09

截至第二次清算期结束日（2026年9月22日），本基金剩余财产为人民币52,001.09元，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。

自第二次清算期起始日（2026年8月6日）至第二次清算期结束日（2026年9月22日）的银行存款等产生的利息已计入第二次清算期间净损益，自第二次清算期结束日次日（2026年9月23日）至第二次清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。为便于及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应计银行存款利息、应计结算备付金利息及应计存出保证金利息。基金管理人所垫付的资金及垫付资金到账日起

孳生的利息归基金管理人所有，并于第二次清算期后返还基金管理人，基金财产清算完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

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第二次清算审计报告》；
- (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第二次清算报告>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9月29日