

长盛研发回报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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日期：2026年8月11日

清算报告公告日期：2026年8月15日

一、重要提示

长盛研发回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2018年9月7日《关于准予长盛研发回报混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2018〕1453号文）注册募集，于2019年4月25日成立并正式运作，基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

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60个工作日出现前述情形的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。”

截至2026年7月16日日终，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形，触发《基金合同》中约定的《基金合同》终止条款。本基金根据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会审议。本基金最后运作日为2026年7月16日，自最后运作日的下一日（即2026年7月17日）起本基金进入基金财产清算程序。《基金合同》终止及基金财产清算安排详见2026年7月17日刊登在《上海证券报》和本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《关于长盛研发回报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》。

本基金最后运作日为2026年7月16日，自2026年7月17日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国银行、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17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	长盛研发回报混合型证券投资基金
基金简称	长盛研发回报混合
基金代码	A类：007063 C类：025382

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年4月25日
基金最后运作日（2026年7月16日）基金份额总额	17,803,371.33份
投资目标	聚焦持续投入研发资金的上市公司，满足投资人长期稳健的投资收益需求。
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（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、沪港和深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、次级债、中小企业私募债及其他经中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、资产支持证券、股指期货、国债期货、权证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。 基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的60-95%投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的60-95%，投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的50%），权证投资比例不超过基金资产净值的3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债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、应收申购款等。
主要投资策略	1、大类资产配置策略 在大类资产配置中，本基金将通过深入分析：宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，从而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。 2、股票投资策略 对于A股，本基金通过对上市公司研发支出绝对值（研发支

	出总额)和研发支出相对值(研发支出总额占营业收入比例)的比较分析,筛选出年度研发支出总额不低于3千万元,年度研发支出总额占营业收入比例不低于3%,且研发支出高于所在行业平均值的公司。对于港股,本基金筛选出过去三年任一年内年度研发支出总额占净营业收入比例不低于1.5%的公司。综上可知,研发支出分析是本基金重要的定量选股逻辑和标准,而非主题投资方向。 在上述研究基础上,本基金将通过定量与定性相结合的评估方法,对上市公司的增长前景进行分析,力争所选择的企业具备长期竞争优势。 3、债券投资策略 本基金在实际的投资管理运作中,将运用利率配置策略、类属配置策略、信用配置策略、相对价值策略及单个债券选择策略等多种策略,以获取债券市场的长期稳定收益。 4、股指期货投资策略 5、国债期货投资策略 6、权证投资策略 7、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	中证500指数收益率×50%+恒生指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其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。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

长盛研发回报混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会2018年9月7日《关于准予长盛研发回报混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2018〕1453号文)注册募集,募集期自2019年3月6日到2019年4月19日止,《基金合同》于2019年4月25日生效,基金合同生效日的基金份额总额为508,164,182.08份。自2019年4月25日至2026年7月16日期间,本基金按《基金合同》约定正常运作。

根据《基金合同》以及《关于长盛研发回报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》,自2026年7月17日起,本基金进入清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：长盛研发回报混合型证券投资基金

报告截止日：2026年7月16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 16 日)
资产：	
货币资金	3,670,923.75
结算备付金	2,925.42
存出保证金	7,369.08
交易性金融资产	21,790,882.04
应收股利	31,754.20
应收申购款	928.61
资产总计	25,504,783.10
负债和净资产	
负债：	
应付清算款	2.68
应付赎回款	2,146,113.50
应付管理人报酬	14,685.01
应付托管费	2,447.50
应付销售服务费	2.98
应交税费	21.95
其他负债	55,372.43
负债合计	2,218,646.05
净资产：	
实收基金	17,803,371.33
未分配利润	5,482,765.72
净资产合计	23,286,137.05
负债和净资产总计	25,504,783.10

注：截至2026年7月16日(基金最后运作日)，本基金基金份额总额17,803,371.33份，其中长盛研发回报混合A基金份额净值1.3080元，份额总额17,790,317.23份；长盛研发回报混合C基金份额净值1.3062元，份额总额13,054.10份。

五、清算情况

自2026年7月17日至2026年8月11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：

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，本基金清算费用中的律师费部分由基金管理人承担，不从基金财产中支付。其他清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

（1）本基金最后运作日货币资金为人民币3,670,923.75元，其中应计利息为人民币675.36元。清算期间银行存款变动金额为人民币18,542,501.91元，其中新增银行存款应计利息为人民币3,837.78元。截至清算期结束日，货币资金余额为人民币22,213,425.66元，其中银行存款应计利息余额为人民币4,513.14元。

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币2,925.42元，其中上海结算备付金为人民币2,858.75元，应计利息为人民币0.24元；沪港通结算备付金应计利息为人民币66.43元。清算期间自托管账户划入上海结算备付金账户人民币656.16元，结算备付金共增加利息人民币253.19元。截至清算期结束日，结算备付金余额为人民币3,834.77元，其中上海结算备付金为人民币3,514.91元，应计利息为人民币1.02元；沪港通结算备付金应计利息为人民币318.84元。

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币7,369.08元，其中上海存出保证金为人民币1,473.16元，应计利息为人民币0.58元；深圳存出保证金为人民币5,893.84元，应计利息为人民币1.50元。清算期间自上海存出保证金账户划入托管账户人民币1,473.16元，自深圳存出保证金账户划入托管账户人民币5,893.84元，存出保证金共增加利息人民币1.33元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币3.41元，全部为存出保证金应计利息。

（4）本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币21,790,882.04元，其中

股票投资为人民币20,380,797.98元，债券投资为人民币1,410,084.06元。

股票投资明细如下：

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	比亚迪股份	01211	16,725.00	78.79	1,560,061.39	1,317,762.50
2	比亚迪	002594	12,700.00	94.14	1,310,853.64	1,195,578.00
3	泡泡玛特	09992	16,800.00	145.63	2,356,126.48	2,446,500.50
4	腾讯控股	00700	5,345.00	419.29	2,106,427.38	2,241,100.77
5	东鹏饮料	605499	16,900.00	129.65	2,711,321.65	2,191,085.00
6	美的集团	000333	22,000.00	81.80	1,680,099.41	1,799,600.00
7	乖宝宠物	301498	39,000.00	41.00	2,471,262.28	1,599,000.00
8	赛轮轮胎	601058	102,600.00	13.78	1,410,196.65	1,413,828.00
9	明源云	00909	1,031,000.00	1.28	1,764,072.63	1,321,869.84
10	中国海洋石油	00883	48,472.00	19.82	1,013,710.84	960,760.80
11	中国海油	600938	11,800.00	28.96	449,831.57	341,728.00
12	阿里健康	00241	414,000.00	3.01	1,682,235.26	1,244,509.25
13	恒瑞医药	600276	18,800.00	55.99	954,754.26	1,052,612.00
14	九号公司	689009	24,520.00	41.05	1,113,781.64	1,006,546.00
15	公牛集团	603195	2,300.00	37.80	96,439.00	86,940.00
16	德业股份	605117	622.00	82.62	27,859.56	51,389.64
17	福耀玻璃	600660	800.00	53.00	46,600.00	42,400.00
18	海尔智家	600690	1,500.00	21.11	36,114.30	31,665.00
19	蜜雪集团	02097	100.00	196.48	25,378.12	19,647.68
20	三棵树	603737	700.00	23.25	29,649.08	16,275.00

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 19	019792	8,000.00	101.11	808,821.81	808,877.81
2	26 国债 09	019835	6,000.00	100.20	601,086.25	601,206.25

以上交易性金融资产于2026年7月17日至2026年8月11日止清算期间内处置变现，其中，股票投资处置净损益为人民币-573,093.91元，债券投资处置净损益为人民币-100.00元，清算期间产生的利息收入为人民币323.96元。

（5）本基金最后运作日应收股利为人民币31,754.20元，该款项已于清算期间内

划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收申购款为人民币928.61元，该款项已于清算期间内划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付清算款为人民币2.68元，应付赎回款为人民币2,146,113.50元，应付管理人报酬为人民币14,685.01元，应付托管费为人民币2,447.50元，应付销售服务费为人民币2.98元，应交税费为人民币21.95元，上述款项已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币55,372.43元，其中应付赎回费为人民币59.71元、应付交易费用为人民币3,668.52元，已于清算期间内支付；预提审计费为人民币10,000.00元、预提信息披露费为人民币41,644.20元，将于完成付款流程后支付。

4、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17日 至2026年8月11日止清算 期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	4,092.30
投资收益（注2）	-572,869.95
清算期间收益小计	-568,777.65
二、清算期间支出	
税金及附加	1.17
银行汇划费	311.00
清算期间支出小计	312.17
三、清算期间净收益	-569,089.82

注1：利息收入系计提的2026年7月17日至2026年8月11日止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投资利息收入。

5、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

金额单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2026年7月16日基金净资产	23,286,137.05
加：清算期间净收益	-569,089.82
减：基金净赎回金额（于2026年7月17日确认的投资者净赎回申请）	551,627.59
二、清算结束日2026年8月11日基金净资产	22,165,419.64

注：截至2026年8月11日(清算结束日)，本基金基金份额总额17,381,620.79份，长盛研发回报混合A基金份额净值1.2752元，份额总额17,367,833.20份；长盛研发回报混合C基金份额净值1.2735元，份额总额13,787.59份。

资产处置及负债清偿后，2026年8月11日本基金剩余财产为人民币22,165,419.64元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组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（由本基金管理人承担的部分除外）、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。

自清算起始日（2026年7月17日）至清算结束日（2026年8月11日）的银行存款、存出保证金、结算备付金等资产产生的利息已计入清算期间净收益，自清算期结束日次日（2026年8月12日）至清算款划出前一日的银行存款、存出保证金、结算备付金等产生的利息亦归基金份额持有人所有。基金财产清算完毕之后所产生的其他任何费用由基金管理人承担。

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）《长盛研发回报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<长盛研发回报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。

长盛研发回报混合型证券投资基金基金财产清算小组

2026年8月15日