

长城证券乐享臻稳 13 个月 1 号

集合资产管理计划

清算报告

二〇二六年一月六日

至二〇二六年一月七日

信会师报字[2026]第 ZG30141 号

# 长城证券乐享臻稳 13 个月 1 号集合资产管理计划 清算报告

(2026 年 1 月 6 日至 2026 年 1 月 7 日止)

	目录	页次
一、	清算报告	1-3
二、	清算财务报表	
	清算资产负债表	1-2
	清算损益表	3
	债务清偿表	4
	清算财务报表附注	1-4

## 清算报告

信会师报字[2026]第 ZG30141 号

长城证券乐享臻稳 13 个月 1 号集合资产管理计划清算组：

### 一、 审计意见

我们审计了长城证券乐享臻稳 13 个月 1 号集合资产管理计划（以下简称“该计划”）清算财务报表，包括 2026 年 1 月 7 日的清算资产负债表，2026 年 1 月 6 日至 2026 年 1 月 7 日的清算损益表、债务清偿表以及相关清算财务报表附注。

我们认为，该计划清算财务报表在所有重大方面按照清算财务报表附注二所述的编制基础编制。

### 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对清算财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该计划及其管理人长城证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、 强调事项——编制基础

我们提醒清算财务报表使用者关注清算财务报表附注二对编制基础的说明。本段内容不影响已发表的审计意见。

### 四、 其他事项——对审计报告的分发和使用的限制

本报告仅向该计划管理人出具，供其向该计划投资者和托管人披露并向相应监管机构和自律组织报送，不得用作任何其他目的。我们明确表示不会就本报告的内容向任何其他方负有任何义务或承担任何责任。未经我们书面同意，不适用于其他用途。

## 五、管理人对清算财务报表的责任

管理人负责按照清算财务报表附注二所述的编制基础编制清算财务报表，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使清算财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

## 六、注册会计师对清算财务报表审计的责任

我们的目标是对清算财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响清算财务报表使用者依据清算财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的清算财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。


(三)评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)评价清算财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容。

我们与管理人就本次清算审计计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。



中国注册会计师:

  
中国注册会计师  
谢东良  
310000073192

中国注册会计师:

  
中国注册会计师  
钟飞超  
310000064167

中国·上海

2026年3月27日

长城证券乐享臻稳 13 个月 1 号集合资产管理计划

清算资产负债表

2026 年 1 月 7 日

(除特别注明外，金额单位均为人民币元)

资产	清算结束日 2026 年 1 月 7 日	清算开始日前日 2026 年 1 月 5 日
资产：		
货币资金	88,841.26	56,817,606.77
结算备付金		
存出保证金		
衍生金融资产		
应收清算款		
应收利息		
应收股利		
应收申购款		
买入返售金融资产		
发放贷款和垫款		
交易性金融资产		
债权投资		
其他债权投资		
其他权益工具投资		
长期股权投资		
其他资产		
资产总计	88,841.26	56,817,606.77

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人：



主管会计工作负责人：



会计机构负责人：



长城证券乐享臻稳 13 个月 1 号集合资产管理计划  
清算资产负债表（续）

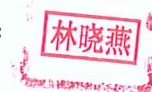
2026 年 1 月 7 日

（除特别注明外，金额单位均为人民币元）

负债和清算净值	清算结束日 2026 年 1 月 7 日	清算开始日前日 2026 年 1 月 5 日
负债：		
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款		
应付管理人报酬	59,664.94	59,664.94
应付托管费	1,491.63	1,491.63
应付销售服务费		
应付投资顾问费		
应交税费		
应付清算款		
应付赎回款		
应付利息		
应付利润		
其他负债	27,131.51	27,131.51
负债合计	88,288.08	88,288.08
清算净值：		
清算净值	553.18	56,729,318.69
负债和清算净值总计	88,841.26	56,817,606.77

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人：曾贇 主管会计工作负责人：曾贇 会计机构负责人：林晓燕



长城证券乐享臻稳 13 个月 1 号集合资产管理计划  
清算损益表

2026 年 1 月 6 日至 2026 年 1 月 7 日

(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)

项目	本期金额 2026 年 1 月 6 日至 2026 年 1 月 7 日
一、清算收入	553.18
利息收入	553.18
投资收益 (损失以“-”填列)	
公允价值变动收益 (损失以“-”填列)	
汇兑收益 (损失以“-”填列)	
其他收入	
二、清算支出	
管理人报酬	
托管费	
销售服务费	
投资顾问费	
利息支出	
信用减值损失	
税金及附加	
其他费用	
三、清算净损益	553.18

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人: 主管会计工作负责人: 会计机构负责人:



长城证券乐享臻稳13个月1号集合资产管理计划  
债务清偿表

2026年1月6日至2026年1月7日

(除特别注明外, 金额单位均为人民币元)



债务项目	清算开始日前日 2026年1月5日	本期增加	本期减少	清算结束日 2026年1月7日	本期以现金清偿
普通债务:					
应付管理人报酬	59,664.94			59,664.94	
应付托管费	1,491.63			1,491.63	
应付赎回款		56,729,318.69	56,729,318.69		56,729,318.69
其他负债	27,131.51			27,131.51	
合计	88,288.08	56,729,318.69	56,729,318.69	88,288.08	56,729,318.69

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人: 

主管会计工作负责人: 

会计机构负责人:



# 长城证券乐享臻稳 13 个月 1 号集合资产管理计划

二〇二六年一月六日至二〇二六年一月七日清算财务报表附注

(除特殊注明外, 金额单位均为人民币元)

## 一、 计划的基本概况

长城证券乐享臻稳 13 个月 1 号集合资产管理计划(以下简称“本计划”)于 2024 年 12 月 5 日成立, 于 2024 年 12 月 12 日取得中国证券投资基金业协会出具的产品编码为 SARS03 的资产管理计划备案证明。本计划的管理人为长城证券资产管理有限公司(以下简称“管理人”), 本计划的托管人为平安银行股份有限公司深圳分行(以下简称“托管人”)。

本计划的计划类别为固定收益类集合资产管理计划。本计划的运作方式为封闭式。本计划的存续期限为 13 个月, 自本计划成立之日起计算, 可展期。

本计划的投资范围:

固定收益类资产: 银行存款、同业存单、债券逆回购, 以及符合《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《标准化债权类资产认定规则》规定的标准化债权类资产, 包括但不限于在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的具有合理公允价值和完善流动性机制的债券, 包括但不限于国债、地方政府债、央行票据、各类金融债(含次级债、混合资本债、二级资本债)、企业债、公司债、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具(如短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具)、资产支持证券和资产支持票据优先级份额。

本计划可参与债券正回购。

## 二、 清算财务报表的编制基础

本清算财务报表的编制范围包括本计划全部的资产和负债及清算期间发生的损益情况。

本清算财务报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及《资产管理产品相关会计处理规定》(财会〔2022〕14 号)的有关规定编制。

## 三、 遵循清算财务报表的编制基础的声明

本清算财务报表符合附注“二、清算财务报表的编制基础”所述编制基础的要求, 真实、完整地反映了本计划 2026 年 1 月 7 日的财务状况以及报告期间的清算损益情况。

#### 四、重要会计政策和会计估计

##### (一) 清算期间

本计划按照附注“二、清算财务报表的编制基础”编制本清算财务报表，清算开始日为 2026 年 1 月 6 日，清算资产负债表日为 2026 年 1 月 7 日，清算期间为 2026 年 1 月 6 日至 2026 年 1 月 7 日。

##### (二) 记账本位币

本计划采用人民币为记账本位币。

##### (三) 记账基础和计价原则

会计核算以权责发生制为基础。资产以资产清算净值计量。负债以债务清偿价值计量。

##### (四) 清算资产

本计划在清算期间的资产以资产清算净值计量，资产清算净值是指在清算的特定环境下和规定时限内，最可能的变现价值扣除相关的处置税费后的净额。

##### (五) 清算负债

本计划在清算期间的负债以债务清偿价值计量。债务清偿价值，是指在不考虑本计划实际清偿能力和折现等因素的情况下，按照相关法律规定或合同约定应当偿付的金额。

##### (六) 清算费用

本计划在清算期间发生各项费用直接计入清算损益。

##### (七) 剩余财产的分配方法

根据资产变现情况，优先分配给委托人，然后支付清算费用，并清偿全部债务。销户时托管户孳生的利息（如有）将划付给管理人。

#### 五、清算情况

本计划清算期间的具体清算情况如下：

##### (一) 资产

本计划银行存款于清算开始日前日（2026 年 1 月 5 日）余额为 56,817,606.77 元，包

含应计利息 3,580.78 元；清算结束日（2026 年 1 月 7 日）余额为 88,841.26 元，包含应计利息 4,133.96 元；清算期间银行存款净变动为-56,728,765.51 元。

## (二) 负债

本计划应付管理人报酬于清算开始日前日（2026 年 1 月 5 日）余额为 59,664.94 元；清算结束日（2026 年 1 月 7 日）余额为 59,664.94 元；管理人报酬清算期间净变动为 0.00 元。

本计划应付托管费于清算开始日前日（2026 年 1 月 5 日）余额为 1,491.63 元；清算结束日（2026 年 1 月 7 日）余额为 1,491.63 元；清算期间托管费净变动为 0.00 元。

本计划其他负债于清算开始日前日（2026 年 1 月 5 日）余额为 27,131.51 元，其中应付交易费用 5,309.51 元，应付审计费用 9,222.00 元，预提账户维护费 12,400.00 元，预提询证费 200 元；清算结束日（2026 年 1 月 7 日）余额为 27,131.51 元，其中应付交易费用 5,309.51 元，应付审计费用 9,222.00 元，预提账户维护费 12,400.00 元，预提询证费 200 元。

## (三) 清算净值情况

清算净值于清算开始日前日（2026 年 1 月 5 日）为人民币 56,729,318.69 元，于清算结束日（2026 年 1 月 7 日）为人民币 553.18 元，清算净值于清算期间变动为人民币 -56,728,765.51 元。

## (四) 清算损益情况

清算期间共发生净损益 553.18 元，明细情况如下：

项目	本期金额
	2026 年 1 月 6 日 至 2026 年 1 月 7 日
一、清算收入	553.18
利息收入	553.18
投资收益（损失以“-”填列）	
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	
汇兑收益（损失以“-”填列）	
其他收入	
二、清算支出	
管理人报酬	

项目	本期金额
	2026 年 1 月 6 日 至 2026 年 1 月 7 日
托管费	
销售服务费	
投资顾问费	
利息支出	
信用减值损失	
税金及附加	
其他费用	
<b>三、清算净损益</b>	<b>553.18</b>

本计划于 2026 年 1 月 5 日到期终止，资产变现完毕，管理人根据合同终止及清算条款，按 2026 年 1 月 5 日本计划资产净值为投资者办理份额清算，于 T+2 日（2026 年 1 月 7 日）进行资金清算、交收。清算净损益 553.18 元系管理人为投资者办理清退份额后至资金交收日托管户孳生的利息，销户时划付给管理人。

#### 六、清算结束日的资产负债及剩余财产分配情况

清算小组于 2026 年 1 月 7 日起根据实际情况分配剩余资产。截至 2026 年 1 月 7 日止，本计划剩余资产 88,841.26 元，其中银行存款 88,841.26 元；剩余负债 88,288.08 元，其中应付管理人报酬 59,664.94 元，应付托管费 1,491.63 元，其他负债 27,131.51 元；清算净值 553.18 元。截至 2026 年 1 月 7 日，应付投资者的赎回款 56,729,318.69 元已分配完毕。管理人后续将根据本计划资产实际变现情况及新产生的相关费用（如有），及时按照本合同的约定支付相关费用、应付托管费、其他负债，最后支付应付管理人报酬。清算小组在进行本计划清算过程中发生的所有合理费用，由清算小组从本计划资产中划付。

清算小组将在剩余资产分配完毕后，注销本计划的相关账户。

#### 七、其他重要事项

截至清算结束日，本计划无需要披露的其他重大或有事项或承诺事项。

长城证券资产管理有限公司  
二〇二六年三月二十七日

