

长城新策略灵活配置混合型证券投资基金清算报 告

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

一、重要提示

长城新策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2015]1494号文准予注册，于2015年11月27日成立并正式运作。

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》和《长城新策略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》”）的有关规定，并经2018年12月13日本基金基金份额持有人大会表决通过，本基金进行基金财产清算并终止《基金合同》。本基金进入清算期的公告详见2018年12月14日刊登在《证券日报》和基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）上的《长城新策略灵活配置混合型证券投资基金进入清算期及终止办理申购、赎回、转换及定投等业务的公告》。

本基金自2018年12月14日起进入清算程序，由本基金基金管理人长城基金管理有限公司、本基金基金托管人中信银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所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，上海市通力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	长城新策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长城新策略混合	
基金主代码	001670	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年11月27日	
最后运作日基金份额总额	5,961,149.80份	
下属分级基金的基金简称:	长城新策略混合A	长城新策略混合C
下属分级基金的交易代码:	001670	001671
报告期末下属分级基金的份额总额	2,742,138.90份	3,219,010.90份
投资目标	本基金通过综合运用多种投资策略，充分把握我国经济转型过程中产生的投资机遇，在控制风险的前提下，力求实现超越业绩比较基准的表现。	
投资策略	本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素，在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素，如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等；对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况，	

	对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上，本基金将参考基金流动性要求，以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。
业绩比较基准	50%×中证 800 指数收益率+50%×中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于中等风险、中等收益的基金产品。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2015]1494 号文准予注册，由基金管理人长城基金管理有限公司于 2015 年 11 月 18 日至 2015 年 11 月 25 日向社会公开募集，《基金合同》于 2015 年 11 月 27 日正式生效，募集规模为 230,559,870.50 份基金份额。

自 2015 年 11 月 27 日至 2018 年 12 月 13 日期间，本基金按《基金合同》正常运作。本基金基金管理人于 2018 年 11 月 14 日至 2018 年 12 月 12 日以通讯方式召开了本基金基金份额持有人大会，并于 2018 年 12 月 13 日表决通过了《关于终止长城新策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“《议案》”）。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》以及上述经基金份额持有人大会表决通过的《议案》的有关规定，本基金自 2018 年 12 月 14 日起进入清算程序。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：长城新策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 13 日

单位：人民币元

最后运作日：2018 年 12 月 13 日	
资产：	
银行存款	7,124,286.85
结算备付金	97,984.56

存出保证金	735.81
应收利息	2,448.90
应收申购款	4,227.24
资产合计:	7,229,683.36
负债:	
应付赎回款	69,784.99
应付管理人报酬	2,338.87
应付托管费	730.88
应付销售服务费	752.93
其他负债	123,587.53
负债合计	197,195.20
所有者权益:	
实收基金	5,961,149.80
未分配利润	1,071,338.36
所有者权益合计	7,032,488.16
负债与持有人权益总计:	7,229,683.36

注: 于最后运作日 2018 年 12 月 13 日, 基金 A 级份额净值为 1.0676 元, 份额为 2,742,138.90 份, 资产净值为 2,927,591.87 元, C 级份额净值为 1.2752 元, 份额为 3,219,010.90 份, 资产净值为 4,104,896.29 元。

五、清算情况

自 2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 26 日止为清算期间, 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《长城新策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定, 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。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款 7,124,286.85 元, 是储存于基金托管人中信银行的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日结算备付金 97,984.56 元和存出保证金 735.81 元, 是由中国证券登记结算公司上海分公司收取并保管的结算备付金和结算保证金。结算备付金和存出保证金每月调整一次, 为保护基金份额持有人利益, 加快清盘速度, 基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款

项。

(3) 本基金最后运作日应收利息 2,448.90 元, 包括活期银行存款应收利息 2,377.20 元、结算备付金应收利息 63.18 元和存出保证金应收利息 8.52 元。应收活期银行存款利息由托管银行于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日(节假日顺延) 结算入账, 或在账户注销时一次性结清; 结算备付金和存出保证金利息由中国证券登记结算有限责任公司于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日(节假日顺延) 结算入账。为保护基金份额持有人利益, 加快清盘速度, 基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。

(4) 本基金最后运作日应收申购款人民币 4,227.24 元, 该款项已于 2018 年 12 月 14 日收回。

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 69,784.99 元, 该款项已于 2018 年 12 月 14 日至 17 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 2,338.87 元, 该款项已于 2018 年 12 月 14 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 730.88 元, 该款项已于 2018 年 12 月 14 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 752.93 元, 该款项已于 2018 年 12 月 14 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 123,587.53 元。其中, 预提审计费 28,519.93 元, 已于 2018 年 12 月 18 日支付; 预提信息披露费 95,067.59 元, 已于 2018 年 12 月 24 日支付; 其中应付赎回费 0.01 元, 已于 2018 年 12 月 17 日支付。

4、清算期间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(2018 年 12 月 13 日)基金净资产	7,032,488.16
减: 基金净赎回金额(2018 年 12 月 13 日赎回并于 2018 年 12 月 14 日确认的申请)	69,783.50
加: 清算期间(2018 年 12 月 14 日至 2018 年 12 月 26 日)收入	908.55
其中: 利息收入-银行存款利息收入(注 1)	755.09
利息收入-结算备付金利息收入(注 1)	57.26

利息收入-存出保证金利息收入（注1）	0.49
赎回基金补偿收入	95.71
二、2018年12月26日基金净资产	6,963,613.21

注：利息收入系以当前适用的利率预估计提的2018年12月14日至2018年12月26日期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

2018年12月26日本基金剩余财产为人民币6,963,613.21元，根据本基金的基金合同约定，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。

2018年12月27日至清算款划出日前一日的银行存款等孳生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

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) 长城新策略灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告
- (2) 通力律师事务所关于《长城新策略灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公场所：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心40-41层

存放网址：www.ccfund.com.cn

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

长城新策略灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2019年1月30日