

长城景气行业龙头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：中国建设银行股份有限公司

一、重要提示

长城景气行业龙头灵活配置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”）证监许可[2009]386号文核准募集，于2009年6月30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《长城景气行业龙头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2021年5月7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2021年5月8日刊登在长城基金管理有限公司网站（www.ccfund.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）上的《长城景气行业龙头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2021年5月8日起进入财产清算期，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国建设银行股份有限公司、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

基金简称	长城景气行业龙头混合
基金主代码	200011
交易代码	200011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年6月30日
最后运作日基金份额总额	26,227,644.86份
投资目标	在合理的资产配置基础上，通过投资于景气行业或预期景气度向好的行业中的龙头上市公司，实现基金资产的持续稳定增值。
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。由于不同行业在不同的经济周期中表现出不同的运行态势，本基金将结合宏观经济分析结果，运用长城基金景气行业评价体系对相关经济指标进行定性和定量分析，以选择在不同经济环境下景气度较高

	的行业作为股票资产配置的重点。
业绩比较基准	55%×沪深 300 指数收益率+45%×中债总财富指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，长期平均风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，为中高风险、中高收益产品。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2009]386号文核准募集，由基金管理人长城基金管理有限公司于2009年6月1日至2009年6月26日向社会公开募集，《基金合同》于2009年6月30日正式生效，募集规模为1,964,631,732.69份基金份额。

自2009年6月30日至2021年5月7日期间，本基金按《基金合同》正常运作。本基金基金管理人于2021年4月6日至2021年5月6日以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，并于2021年5月7日表决通过了《关于终止长城景气行业龙头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2021年5月8日起进入财产清算期。

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：长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年5月7日

单位：人民币元

最后运作日：2021年5月7日	
资产：	
银行存款	15,590,079.63
结算备付金	43,838.63
存出保证金	13,305.21
交易性金融资产	8,396,385.00

其中：股票投资	8,396,385.00
应收证券清算款	4,242,005.48
应收利息	11,169.13
应收申购款	123,922.15
资产合计：	28,420,705.23
负债：	
应付赎回款	206,757.36
应付管理人报酬	51,876.53
应付托管费	8,646.10
应付交易费用	12,477.51
其他负债	198,189.23
负债合计	477,946.73
所有者权益：	
实收基金	26,227,644.86
未分配利润	1,715,113.64
所有者权益合计	27,942,758.50
负债与持有人权益总计：	28,420,705.23

注：于最后运作日 2021 年 5 月 7 日，基金份额净值为 1.0654 元，份额为 26,227,644.86 份，资产净值为 27,942,758.50 元。

五、 清算情况

自 2021 年 5 月 8 日至 2021 年 5 月 21 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《长城景气行业龙头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人民币 15,590,079.63 元，是储存于基金托管人建设银行的活期银行存款。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金人民币 43,838.63 元和存出保证金人民币 13,305.21 元，是由中国证券登记结算公司上海分公司和深圳分公司收取并保管的结算备付金和存出保证金，其中上海结算备付金 26,192.90 元，深圳结算备付金 17,645.73 元，上海存出保证金 5,826.29 元，深圳存出保证金 7,478.92 元。

元。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人民币 11,169.13 元，包括活期银行存款应收利息 10,912.77 元、结算备付金应收利息 229.38 元和存出保证金应收利息 26.98 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) 本基金最后运作日交易性金融资产-股票投资为人民币 8,396,385.00 元，该资产已于 2021 年 5 月 10 日全部卖出，收回金额合计为 8,314,544.24 元，已全部划入基金托管户。
- (5) 本基金最后运作日应收申购款人民币 123,922.15 元，该款项已于 2021 年 5 月 10 日收回。
- (6) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 4,242,005.48 元，已于 2021 年 5 月 10 日划回托管户。

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 206,757.36 元，该款项已于 2021 年 5 月 10 日至 11 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 51,876.53 元，该款项已于 2021 年 5 月 10 日至 12 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 8,646.10 元，该款项已于 2021 年 5 月 10 日至 12 日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 12,477.51 元，该款项已于 2021 年 5 月 12 日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 198,189.23 元。其中，预提审计费 10,400.00 元，已于 2021 年 5 月 14 日支付；预提信息披露费 137,397.73 元，已于 2021 年 5 月 14 日支付；预提持有人大会律师费 50,000.00 元，已于 2021 年 5 月 14 日支付；其中应付赎回费 391.50 元，已于 2021 年 5 月 10 日至 11 日支付。

4、清算期的清算损益情况

项目	2021年5月8日至2021年5月21日
一、收入	-69,251.92
1、利息收入	3,515.71
其中：银行存款利息收入	3,479.73
结算备付金利息收入	27.58
存出保证金利息收入	8.40
2、处置交易性金融资产产生的净损失（注1）	-72,778.75
3、其他收入（损失以“-”填列）（注2）	11.12
二、费用	16,888.71
1、交易费用	16,813.71
2、其他费用（注3）	75.00
三、利润总额	-86,140.63
减：所得税费用	-
利润净额	-86,140.63

注1：处置交易性金融资产产生的净损失系清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票最后运作日的股票估值总额后的差额。

注2：其他收入为赎回基金补偿收入；

注3：其他费用系清算期间本基金托管账户的银行汇划费。

5、资产处置及负债清偿后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（2021年5月7日）基金净资产	27,942,758.50
加：基金净申购金额（2021年5月7日申购并于2021年5月10日确认的申请）	62,796.22
加：清算期间（2021年5月8日至2021年5月21日）净收益	-86,140.63
二、2021年5月21日基金净资产	27,919,414.09

2021年5月21日本基金剩余财产为人民币27,919,414.09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。

2021年5月22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。

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) 长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告

(2) 上海市通力律师事务所关于《长城景气行业龙头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。

长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2021 年 6 月 4 日