

长城新能源股票型发起式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：招商银行股份有限公司

报告出具日：2025年2月13日

报告公告日：2025年2月20日

一、 重要提示

长城新能源股票型发起式证券投资基金（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[2022]25号文注册募集，于2022年1月19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》、《长城新能源股票型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，截至《基金合同》生效之日起3年后的年度对应日2025年1月20日日终，本基金的基金资产净值低于两亿元，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止事由，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。本基金进入清算期的公告详见2025年1月21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《关于长城新能源股票型发起式证券投资基金基金合同终止与基金财产清算的公告》。

本基金自2025年1月21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、本基金基金托管人招商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市中盛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，北京市中盛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	长城新能源股票发起式
基金主代码	014902
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年1月19日
最后运作日基金份额总额	54,397,082.32份
投资目标	本基金通过积极主动的研究，主要投资新能源主题的上市公司，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下的行业配置和自下而上的个股精</p>

	<p>选相结合的方法，寻找具备基本面健康、估值有优势、竞争优势强的合理投资标的进行投资。</p> <p>本基金所界定的新能源主题上市公司包括公司：1) 新能源、再生能源生产和利用相关行业，包括：太阳能、风能、水能、核能、页岩气、生物质能、天然气发电、地热能、海洋能和氢能等新能源/再生能源的生产和利用及相关技术服务；2) 新能源、再生能源设备制造行业，包括：光伏组件、风机、核电设备、燃气机组、氢气生产设备和抽水蓄能机组；3) 新能源相关的工程建设、能源传输和运营行业，包括：新能源电站的建设、智能电网、电站运营、分布式能源管理、合同能源管理；4) 储能和交互设备的生产和研发行业，包括：电池、电容器、逆变器、充电桩、电缆等的研发生产制造，及与其相关的原材料生产与制造；5) 新能源汽车、智能汽车产业链相关行业，包括：新能源及智能汽车整车、装备、汽车电子以及关键零部件、原材料、充电桩运营及相关技术服务；6) 动力电池相关行业，包括：动力电池、装备、原材料及上游矿产资源的生产和制造装备。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资于国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证新能源指数收益率×75%+中证港股通能源综合指数收益率（人民币）×10%+中债综合财富指数收益率×15%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风</p>

	险。	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长城新能源股票发起式 A	长城新能源股票发起式 C
下属分级基金的交易代码	014902	014903
最后运作日下属分级基金的份额总额	24,568,021.09 份	29,829,061.23 份

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2022]25号文注册募集，由基金管理人长城基金管理有限公司于2022年1月17日向社会公开募集，《基金合同》于2022年1月19日正式生效，募集规模为12,507,197.58份基金份额。

自2022年1月19日至2025年1月20日期间，本基金按《基金合同》正常运作。《基金合同》约定“《基金合同》生效之日起3年后的年度对应日，若基金资产净值低于两亿元的，《基金合同》自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。”

截至2025年1月20日日终，本基金的基金资产净值低于两亿元，触发了《基金合同》约定的基金合同终止事由，基金管理人将按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。本基金自2025年1月21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：长城新能源股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2025年01月20日

单位：人民币元

最后运作日：2025年01月20日	
资产：	
银行存款	42,394,781.03
应收证券清算款	9,278,806.17
资产总计	51,673,587.20
负债：	
应付管理人报酬	32,134.64
应付托管费	5,355.79
应付销售服务费	9,072.37

应付赎回款	15,591,997.15
其他负债	20,959.12
负债合计	15,659,519.07
净资产：	
实收基金	54,397,082.32
未分配利润	-18,383,014.19
净资产合计	36,014,068.13
负债和净资产总计	51,673,587.20

注：于最后运作日 2025 年 01 月 20 日，基金份额总额 54,397,082.32 份，其中长城新能源股票发起式 A 基金份额总额 24,568,021.09 份，基金份额净值 0.6686 元；长城新能源股票发起式 C 基金份额总额 29,829,061.23 份，基金份额净值 0.6567 元。

五、 清算情况

自 2025 年 01 月 21 日至 2025 年 02 月 13 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《长城新能源股票型发起式证券投资基金合同》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 42,394,781.03 元，分别是储存于基金托管人招商银行的活期银行存款人民币 1,940,623.26 元和应计活期银行存款利息人民币 387.35 元，储存于证券公司资金账户的资金 40,451,744.31 元和应计证券公司资金账户利息 2,026.11 元。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。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活期银行存款利息款项。证券公司资金账户的资金与利息已于 2 月 6 日一次性划入活期银行存款账户。
- (2) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 9,278,806.17 元，已于 2025 年 1 月 22 日划回托管户。

3、 负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 32,134.64 元，该款项已于 2025 年 01 月 24 日支付。

- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 5,355.79 元, 该款项已于 2025 年 01 月 24 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 9,072.37 元, 该款项已于 2025 年 01 月 24 日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 15,591,997.15 元, 该款项已于 2025 年 01 月 21-24 日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 20,959.12 元, 包含应付赎回费、其他应付款和预提审计费用。其中, 应付赎回费为人民币 794.12 元, 已于 2025 年 01 月 21-24 日支付; 其他应付款为汇划费人民币 165 元, 已于 2025 年 02 月 11 日支付; 预提审计费为人民币 20,000.00 元, 已于 2025 年 02 月 07 日支付。

4、清算期的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	2025 年 01 月 21 日至 2025 年 02 月 13 日
一、营业总收入	3,598.37
利息收入(注 1)	7,008.84
投资收益(注 2)	-4,884.29
其他业务收入(注 3)	1,473.82
二、营业总支出	8,417.10
律师费(注 4)	8,000.00
深港通证券组合费	4.05
银行手续费	413.05
三、利润总额	-4,818.73
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-4,818.73

注 1: 利息收入系清算期间计提的银行存款利息人民币 3,281.08 元、证券公司资金账户利息 3,727.76 元。

注 2: 投资收益系最后运作日处置股票产生的红利补税。

注 3: 其他业务收入系清算期间赎回费归资产的收入。

注 4: 律师费系支付给北京市中盛律师事务所就本基金清算事宜产生的费用。

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(2025 年 01 月 20 日)基金净资产	36,014,068.13
加: 清算期间(2025 年 01 月 21 日至 2025 年 02 月 13 日)净收益	-4,818.73

减：基金净赎回金额(2025年01月20日赎回并于2025年01月21日确认的申请)	2,950,596.22
二、2025年02月13日基金净资产	33,058,653.18

2025年02月13日本基金剩余财产为人民币33,058,653.18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。

2025年02月14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) 长城新能源股票型发起式证券投资基金清算审计报告

(2) 北京市中盛律师事务所关于《长城新能源股票型发起式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：深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元，38层、39层

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。

长城新能源股票型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2025年2月20日