

万家新能源主题混合型发起式证券投资基金

清算报告

基金管理人：万家基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

清算报告出具日：2025年6月10日

清算报告公告日：2025年6月21日

一、重要提示

万家新能源主题混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系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]907号文《关于准予万家新能源主题混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由万家基金管理有限公司作为基金管理人于2022年5月23日至2022年5月27日向社会公开募集，募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字[2022]第ZA31035号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2022年5月31日生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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》、《万家新能源主题混合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，万家新能源主题混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）触发基金合同终止情形，为维护基金份额持有人利益，万家基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定依法对本基金财产进行清算并终止《基金合同》，该事项无需召开基金份额持有人大会进行表决。

本基金2025年6月1日（含）起进入清算期，由基金管理人万家基金管理有限公司、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、立信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2025年6月3日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由立信会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

- 1、基金名称：万家新能源主题混合型发起式证券投资基金
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、《基金合同》生效日：2022年5月31日
- 4、基金管理人：万家基金管理有限公司
- 5、基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司
- 6、2025年5月31日基金份额总额：35,157,779.54份（其中万家新能源主题A份额：18,777,522.29份，其中万家新能源主题C份额：16,380,257.25份）
- 7、投资目标：本基金主要投资于直接从事或受益于新能源产业发展的优质上市公司，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期增值。
- 8、投资策略：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）主题界定；（2）个股投资策略；（3）港股通标的股票投资策略；（4）存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、可转换债券与可交换债券投资策略；6、证券公司短期公司债券投资策略；7、金融衍生产品投资策略：（1）股指期货投资策略；（2）国债期货投资策略；（3）股票期权投资策略；8、信用衍生品投资策略；9、融资交易策略。
- 9、业绩比较基准：中证新能源指数收益率×65%+恒生指数收益率×5%+中证全债指数收益率×30%
- 10、风险收益特征：本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于

股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

三、基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2022]907号文的核准，《基金合同》于2022年5月31日生效。自2022年5月31日至2025年5月31日期间，本基金按《基金合同》正常运作。

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》、《基金合同》的有关规定，本基金触发基金合同终止情形，为维护基金份额持有人利益，基金管理人决定依法对本基金财产进行清算并终止《基金合同》，该事项无需召开基金份额持有人大会进行表决。本基金从2025年6月1日起进入清算期。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：万家新能源主题混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2025年5月31日

单位：人民币元

最后运作日：2025年5月31日	
资产：	
货币资金	8,096,098.43
结算备付金	895,656.52
存出保证金	25,119.63
交易性金融资产	17,744,675.26
其中：股票投资	17,744,675.26
基金投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
其他投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
债权投资	—
其中：债券投资	—
资产支持证券投资	—
其他投资	—
其他债权投资	—
其他权益工具投资	—

应收清算款	—
应收股利	—
应收申购款	158,568.23
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	26,920,118.07
负债和净资产：	
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	—
应付清算款	0.52
应付赎回款	4,062,737.05
应付管理人报酬	33,491.69
应付托管费	5,581.95
应付销售服务费	7,828.94
应付投资顾问费	—
应交税费	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	60,010.24
负债合计	4,169,650.39
净资产：	
实收基金	35,157,779.54
其他综合收益	—
未分配利润	-12,407,311.86
净资产合计	22,750,467.68
负债和净资产总计	26,920,118.07

注：截至 2025 年 5 月 31 日（基金最后运作日），万家新能源主题 A 份额总额 18,777,522.29 份，基金份额净值 0.6516 元，基金资产净值 12,235,953.75 元；万家新能源主题 C 份额总额 16,380,257.25 份，基金份额净值 0.6419 元，基金资产净值 10,514,513.93 元。

五、基金财产分配

自2025年6月1日至2025年6月10日止的清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，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剩余财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的律师费和清算审计费将由基金管理人承担。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日货币资金余额为 8,096,098.43 元。其中，银行活期存款为 8,090,171.19 元，存放于托管账户；应计银行存款利息为 5,927.24 元，由基金管理人以自有资金先行垫付。

(2) 本基金最后运作日结算备付金余额为 895,656.52 元。其中，最低清算备付金为 33,273.95 元；应计最低清算备付金利息为 59.78 元，已于 6 月 10 日划款至托管户 13,939.50 元，剩余部分款项由基金管理人以自有资金先行垫付；深港通备付金为 862,306.03 元，已于 6 月 3 日前全部划款至托管户；应计深港通备付金利息为 16.76 元，由基金管理人以自有资金先行垫付。

(3) 本基金最后运作日存出保证金余额为 25,119.63 元。其中，存出保证金为 25,099.16 元；应计存出保证金利息为 20.47 元。该部分款项由基金管理人以自有资金先行垫付。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产余额为 17,744,675.26 元，均为交易性股票投资。本基金持有的交易性金融资产已于 6 月 5 日前全部变现完毕，合计清算金额为 17,496,631.04 元。

(5) 本基金最后运作日应收申购款为 158,568.23 元，其中应收申购款为 158,568.13 元，已于 6 月 3 日、6 月 4 日划入托管户；应计申购款利息为 0.10 元，由基金管理人以自有资金先行垫付。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付清算款为 0.52 元，已于 2025 年 6 月 3 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付赎回款为 4,062,737.05 元，其中应付赎回款为 3,657,705.91 元，应付转出款为 405,031.14 元，已于 6 月 5 日前全部支付。

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 33,491.69 元，该款项已于 2025 年 6 月 4 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为 5,581.95 元，该款项已于 2025 年 6 月 4 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为 7,828.94 元，该款项已于 2025 年 6 月 4 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为 60,010.24 元。其中，应付赎回费为 467.28 元，已于 6 月 5 日前全部支付；券商席位佣金为 11,183.02 元，已于 2025 年 6 月 6 日支付；应付审计费为 9,671.28 元，已于 2025 年 6 月 4 日支付，应付证券时报信息披露费为 38,688.66 元，在收到发票后支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

	自2025年6月1日至2025年6月10日的清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入	3,041.20
存款利息收入（注1）	3,041.20
2、投资收益（损失以“-”号填列）（注2）	-7,542,045.39
股票投资收益	-7,542,045.39
3、公允价值变动收益（损失以“-”号填列）（注3）	7,270,980.26

4、其他收入	274.07
清算收入小计	-267,749.86
二、清算期间费用	-
清算费用小计	-
三、清算净收益	-267,749.86

注: (1) 存款利息收入系计提自 2025 年 6 月 1 日至 2025 年 6 月 10 日止清算期间的银行存款、清算备付金和存出保证金。

(2) 投资收益系清算期间持有的交易性金融资产处置产生的差价收入, 同时将原计入该金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

(3) 公允价值变动收益系清算期间卖出股票的公允价值变动累计金额。

(4) 其他收入系应付赎回费归基金资产的部分。

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2025 年 5 月 31 日基金净资产	22,750,467.68
加: 清算期间净收益 (损失以“-”填列)	-267,749.86
减: 基金净赎回转出金额	520,615.51
二、清算结束日 2025 年 6 月 10 日基金净资产	21,962,102.31

截至 2025 年 6 月 10 日, 本基金剩余净资产为 21,962,102.31 元, 其中万家新能源主题 A 基金资产净值为 11,962,903.87 元, 万家新能源主题 C 基金资产净值为 9,999,198.44 元。资产处置及负债清偿后, 将根据本基金的《基金合同》约定, 依据基金财产清算的分配方案, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2025 年 6 月 11 日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息归基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益, 加快清盘速度, 基金管理人万家基金管理有限公司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, 报中国证监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)《万家新能源主题混合型发起式证券投资基金清算审计报告》

(2)《上海源泰律师事务所关于万家新能源主题混合型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

万家新能源主题混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2025年6月10日