

长城优选招益一年持有期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：招商银行股份有限公司

报告出具日：2025年8月8日

报告公告日：2025年8月18日

一、 重要提示

长城优选招益一年持有期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[2021]1821号文注册募集，于2022年1月26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》、《长城优选招益一年持有期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，截至2025年7月24日日终，本基金的基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元，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》，不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7月26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《关于长城优选招益一年持有期混合型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7月25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、德勤华永会计师事务所（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，并由德勤华永会计师事务所（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	长城优选招益一年混合
基金主代码	012685
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年1月26日
最后运作日基金份额总额	25,229,697.37份
投资目标	本基金把握债券市场与股票市场的投资机会，通过组合管理，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、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，同时保持高流动性，</p>

	<p>为组合提供现金增强收益。</p> <p>3、股票投资策略 本基金将采用定性分析和定量分析相结合的方法精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票进行投资，以此构建股票组合。</p> <p>4、股指期货投资策略 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 本基金投资于国债期货，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 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>	
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率×75%+中证 800 指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于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	长城优选招益一年混合 A	长城优选招益一年混合 C
下属分级基金的交易代码	012685	012686
最后运作日下属分级基金的份额总额	19,614,168.51 份	5,615,528.86 份

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2021]1821 号文注册，由基金管理人长城基金管理有限公司于 2021 年 11 月 26 日至 2022 年 1 月 24 日公开募集，《基金合同》于 2022 年 1 月 26 日正式生效，募集规模为 251,713,887.35 份基金份额。

自 2022 年 1 月 26 日至 2025 年 7 月 24 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》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。”截至 2025 年 7 月 24 日日终，本基

金的基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元，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》，不需召开基金份额持有人大会。本基金自 2025 年 7 月 25 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：长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 07 月 24 日

单位：人民币元

最后运作日：2025 年 07 月 24 日	
资产：	
银行存款	23,462,466.47
结算备付金	1,015,110.79
存出保证金	1,567.42
其他资产	5,200.00
应收证券清算款	9,014,405.01
资产总计	33,498,749.69
负债：	
应付管理人报酬	18,819.98
应付托管费	4,705.01
应付销售服务费	2,062.88
应付赎回款	7,952,888.15
其他负债	19,736.54
负债合计	7,998,212.56
净资产：	
实收基金	25,229,697.37
未分配利润	270,839.76
净资产合计	25,500,537.13
负债和净资产总计	33,498,749.69

注：于最后运作日 2025 年 07 月 24 日，基金份额总额 25,229,697.37 份，其中长城优选招益一年混合 A 基金份额总额 19,614,168.51 份，基金份额净值 1.0139 元；长城优选招益一年混合 C 基金份额总额 5,615,528.86 份，基金份额净值 0.9998 元。

五、 清算情况

自 2025 年 07 月 25 日至 2025 年 08 月 08 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《长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金合同》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 23,462,466.47 元，储存于基金托管人招商银行的活期银行存款人民币 23,461,515.53 元和应计活期银行存款利息人民币 950.94 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，本基金的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。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金人民币 1,015,110.79 元。其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金本金人民币 1,013,000.00 元，应计利息人民币 357.34 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金本金人民币 919.08 元，应计利息人民币 0.17 元；本基金的基金管理人于清算结束后以自有资金垫付剩余结算备付金本金及应计利息款项。期货备付金应计利息人民币 834.20 元，其中中信期货备付金应计利息人民币 834.08 元，已于 8 月 1 日完成结息并划入本基金托管账户；东证期货备付金应计利息人民币 0.12 元，已于 7 月 31 日完成结息并划入本基金托管账户。
- (3) 本基金最后运作日存出保证金人民币 1,567.42 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金本金人民币 1,540.35 元，应计利息人民币 0.34 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金本金人民币 26.73 元。存出保证金本金已于 8 月 4 日全部调回至托管户，本基金的基金管理人于清算结束后以自有资金垫付应计利息款项。
- (4) 本基金最后运作日其他资产人民币 5,200.00 元，是公司承担产品迷你期间产生的银行间账户费用，本基金的基金管理人于清算结束后以自有资金划入本基金托管账户。
- (5) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 9,014,405.01 元，是 7 月 23 日买入交易所正回购首期，已于 7 月 25 日到期结算并从本基金托管账户划出。

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 18,819.98 元，该款项已于 2025 年 07

月 28 日支付。

- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,705.01 元, 该款项已于 2025 年 07 月 28 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 2,062.88 元, 该款项已于 2025 年 07 月 28 日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 7,952,888.15 元, 该款项已于 2025 年 07 月 25 日-07 月 29 日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 19,736.54 元, 包含应付交易费用和预提审计费用、预提上证报信息披露费。其中, 应付交易费用为人民币 996.46 元, 已于 2025 年 07 月 28 日支付; 预提审计费为人民币 2,082.40 元, 预提上证报信息披露费为人民币 16,657.68 元, 均待获取相关凭据后支付。

4、清算期的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	2025 年 07 月 25 日至 2025 年 08 月 08 日
一、营业总收入	21,462.77
利息收入(注 1)	3,834.57
其他业务收入(注 2)	17,628.20
二、营业总支出	8,777.81
律师费(注 3)	8,000.00
银行手续费	777.81
三、利润总额	12,684.96
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	12,684.96

注 1: 利息收入系清算期间计提的银行存款利息收入、结算备付金利息收入及存出保证金利息收入。

注 2: 其他业务收入系迷你基金费用减免。

注 3: 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 07 月 24 日)基金净资产	25,500,537.13
加: 清算期间(2025 年 07 月 25 日至 2025 年 08 月 08 日)净收益	12,684.96
减: 基金净赎回金额(2025 年 07 月 24 日赎回并于 2025 年 07 月 25 日	49,990.00

确认的申请)	
二、2025年08月08日基金净资产	25,463,232.09

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08月09日至清算款划出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) 长城优选招益一年持有期混合型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《长城优选招益一年持有期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

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。

长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

2025年8月18日