

# 中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）清算报告

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告出具日期：2024 年 7 月 9 日

报告公告日期：2024 年 8 月 6 日

## 一、重要提示

中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证监会《关于准予中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》（证监许可[2023]110 号文）准予募集，于 2023 年 9 月 19 日成立并正式运作，基金合同生效日的基金份额总额为 236,592,557.54 份，包含认购资金利息结转的份额 80,891.94 份。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》“第五部分 基金备案”中“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，基金管理人应及时通知基金托管人，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2024 年 6 月 20 日，本基金基金资产净值出现连续 50 个工作日低于 5000 万元的情形，已触发《中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》中约定的基金合同终止条款。根据《中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》有关约定，无须召开基金份额持有人大会，本基金管理人应当依法履行基金财产清算程序并终止基金合同。本基金的最后运作日为 2024 年 6 月 20 日，基金管理人自 2024 年 6 月 21 日起根据相关法律法规、基金合同的规定履行基金财产清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见基金管理人于2024年6月21日发布的《中欧基金管理有限公司关于中欧盈选进取3个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金从2024年6月21日起进入清算期，由本基金管理人中欧基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、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律师组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，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，于2024年7月25日出具《中欧盈选进取3个月持有期混合型基金中基金（FOF）清算审计报告》，并由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

- 1、基金名称：中欧盈选进取3个月持有期混合型基金中基金（FOF）
- 2、基金简称：中欧盈选进取3个月持有混合（FOF）A、中欧盈选进取3个月持有混合（FOF）C
- 3、基金代码：A类基金份额018107，C类基金份额018108
- 4、基金运作方式：契约型开放式
- 5、基金合同生效日：2023年9月19日
- 6、基金运作终止日：2024年6月20日。基金份额总额18,176,979.96份
- 7、投资目标：本基金是基金中基金，灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产，在严格控制投资组合风险的前提下，寻求基金资产的长期稳健增值。
- 8、业绩比较基准：中证偏股型基金指数收益率\*80%+银行活期存款利率(税后)\*20%
- 9、风险收益特征：本基金为混合型基金中基金（FOF），风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币市场基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，需承担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。
- 10、基金管理人：中欧基金管理有限公司
- 11、基金托管人：中国银行股份有限公司

### 三、基金最后运作日财务会计报告（经审计）

#### 1、资产负债表

会计主体：中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2024 年 6 月 20 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| 资产                | 本期末<br>2024 年 6 月 20 日<br>(基金最后运作日) |
|-------------------|-------------------------------------|
| <b>资产：</b>        |                                     |
| 银行存款              | 3,027,087.16                        |
| 结算备付金             | 23,354.77                           |
| 存出保证金             | 9,486.08                            |
| 交易性金融资产           | 21,669,875.05                       |
| 其中：债券投资           | 2,639,163.84                        |
| 基金投资              | 19,030,711.21                       |
| 资产支持证券投资          |                                     |
| 应收证券清算款           | 1,037,111.72                        |
| 应收申购款             |                                     |
| <b>资产总计</b>       | <b>25,766,914.78</b>                |
| <b>负债：</b>        |                                     |
| 卖出回购金融资产款         |                                     |
| 应付证券清算款           |                                     |
| 应付赎回款             | 7,806,147.37                        |
| 应付管理人报酬           | 15,983.38                           |
| 应付托管费             | 3,196.64                            |
| 应付销售服务费           | 7,175.53                            |
| 应付交易费用            |                                     |
| 应交税费              |                                     |
| 其他负债              | 18,500.96                           |
| <b>负债合计</b>       | <b>7,851,003.88</b>                 |
| <b>所有者权益：</b>     |                                     |
| 实收基金              | 18,176,979.96                       |
| 未分配利润             | -261,069.06                         |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>17,915,910.90</b>                |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>25,766,914.78</b>                |

#### 四、清盘事项说明

##### 1、清算原因

根据《中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》“第五部分 基金备案”中“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，基金管理人应及时通知基金托管人，本基金将根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2024 年 6 月 20 日，本基金基金资产净值出现连续 50 个工作日低于 5000 万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，不需召开基金份额持有人大会，本基金管理人应当依法履行基金财产清算程序并终止基金合同。

基金管理人于 2024 年 6 月 21 日公告的《中欧基金管理有限公司关于中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同终止及基金财产清算的公告》约定：“本基金已于 2024 年 6 月 13 日起暂停申购、转换转入及定期定额投资业务……自 2024 年 6 月 21 日起，本基金进入清算程序，停止办理申购、赎回、定期定额投资、转换等业务，并且之后不再恢复……本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。”

## 2、清算起始日

本基金于 2024 年 6 月 21 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2024 年 6 月 21 日。

## 3、清算报表编制基础

本清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。

## 五、清算情况

自 2024 年 6 月 21 日至 2024 年 7 月 9 日清算期间，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。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，并于 2024 年 7 月 25 日

出具《中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）清算审计报告》。  
具体清算情况如下：

### 1、清算费用

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，根据基金合同的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 2、资产清算情况

（1）本基金最后运作日结算备付金为人民币 23,354.77 元，清算期间结算备付金利息收入为人民币 22.17 元，该款项将于清算期间后划入托管账户。

（2）本基金最后运作日存出保证金为人民币 9,486.08 元，清算期间存出保证金利息收入为人民币 17.18 元，该款项将于清算期间后划入托管账户。

（3）本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 21,669,875.05 元，其中债券投资为人民币 2,639,163.84 元，基金投资为人民币 19,030,711.21 元。本基金于清算期间对全部债券、基金投资进行处置变现，其中债券投资变现产生的证券清算款为人民币 2,639,203.37 元，基金投资变现产生的证券清算款为人民币 18,929,013.33 元，均已于清算期间划入托管账户。

（4）基金最后运作日应收证券清算款为人民币 1,037,111.72 元，该部分款项已于 2024 年 6 月 21 日划入托管账户。

### 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 7,806,147.37 元，该款项已于 2024 年 6 月 21 日、2024 年 6 月 24 日、2024 年 6 月 25 日、2024 年 6 月 26 日支付。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 15,983.38 元，该款项已于 2024 年 7 月 3 日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,196.64 元，该款项已于 2024 年 7 月 3 日支付。

（4）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 7,175.53 元，该款项已于 2024 年 7 月 3 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 18,500.96 元，其中应付审计费人民币 18,500.00 元，该款项已于 2024 年 6 月 27 日支付；应付赎回费人民币 0.96 元，该款项已于 2024 年 6 月 25 日和 2024 年 6 月 26 日支付。

#### 4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目       | 自 2024 年 6 月 21 日至 2024 年 7 月 9 日止清算期间 |
|----------|--|
| 一、清算收益   |  |
| 利息收入     | 2,435.86                               |
| 投资收益     | -341,222.54                            |
| 公允价值变动损益 | 239,647.39                             |
| 清算收入小计   | -99,139.29                             |
| 二、清算费用   |  |
| 其他费用     | 300.03                                 |
| 清算费用小计   | 300.03                                 |
| 三、清算净收益  | -99,439.32                             |

#### 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 2024 年 6 月 20 日基金净资产                | 17,915,910.90 |
| 加：自 2024 年 6 月 21 日至 2024 年 7 月 9 日止清算期间净收益 | -99,439.32    |
| 减：清算期间确认的净赎回、转出款                            | 4,358,198.37  |
| 二、2024 年 7 月 9 日基金净资产                       | 13,458,273.21 |

资产处置及负债清偿后，于 2024 年 7 月 9 日本基金剩余财产为人民币 13,458,273.21 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扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日 2024 年 6 月 21 日至清算款划出日前一日的存款利息亦属基金份额持有人所有，该部分利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

## 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，报相关监管机构备案并向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

(1)《中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)清算审计报告》

(2)上海市通力律师事务所关于《中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)清算报告》的法律意见

### 2、存放地点

本基金管理人中欧基金管理有限公司办公地点——中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8 层、10 层、16 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。

中欧盈选进取 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金财产清算小组

二〇二四年七月九日