

国泰海通善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金 (FOF) 清算报告

基金管理人：	上海国泰海通证券资产管理有限公司
基金托管人：	上海浦东发展银行股份有限公司
报告出具日期：	2025年11月11日
报告公告日期：	2025年12月2日

目录

一、重要提示	1
二、基金概况	2
三、基金运作情况概述	4
四、财务会计报告	5
五、清算情况	6
六、备查文件	10

一、重要提示

国泰海通善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）变更而来。国泰君安善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）（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”）2022年1月20日证监许可【2022】154号文注册募集，于2022年7月20日成立并正式运作，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

依据《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》、《国泰海通善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，本基金已出现触发基金合同终止情形，将按照基金合同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。

根据基金管理人于2025年11月4日发布的《上海国泰海通证券资产管理有限公司关于国泰海通善远平衡配置一年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》，本基金自2025年11月4日起进入基金财产清算程序，由基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、会计师事务所容诚会计师事务所(特殊普通合伙)、律师事务所上海市通力律师事务所于2025年11月4日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由容诚会计师事务所(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

基金名称	国泰海通善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	国泰海通善远平衡配置一年持有混合(FOF)
基金代码	A类份额基金代码：015129
	C类份额基金代码：015130
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年9月29日
基金管理人名称	上海国泰海通证券资产管理有限公司
基金托管人名称	上海浦东发展银行股份有限公司
最后运作日（2025年11月3日） 基金份额总额	30,926,548.66份
投资目标	在合理控制风险的前提下，通过稳定的资产配置和精细化优选基金，力争实现基金资产的长期稳定增值。
主要投资策略	1、资产配置策略 本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，精选基金品种，构建有超额收益能力的基金组合。同时通过有效地风险管理，降低业绩的波动性，获得稳定而持续的投资收益。 2、基金投资策略 （1）开放式基金投资策略 本基金以权益类基金为重点投资方向，在开放式基金的投资选择上，更倾向于挑选中长期主动管理能力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选择维度上分为基金公司、基金经理、基金产品三个方向，进行定量和定性的合理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。 （2）场内ETF等基金投资策略 场内ETF等基金评价中更多考虑业绩持续性和市场因素的影响。通过对基金规模、流动性、跟踪误差、交易成本，以及ETF所跟踪指数的综合评价挑选适合的ETF投资标的，再根据市场波动因素的变化在适当时机完成基金的买入或卖出操作。 本基金的投资策略还包括：股票的投资策略、债券的投资策略、资产支持证券等品种投资策略、存托凭证投资策略、可转换债券、可交换债券的投资策略。
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率*75%+沪深 300 指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于

	货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。
--	--

三、基金运作情况概述

国泰海通善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）变更而来。国泰君安善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）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]154号《关于准予国泰君安善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》注册，由上海国泰海通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币210,084,627.66元。《国泰君安善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于2022年7月20日正式生效。

自2022年7月20日至2025年11月3日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中的约定：“《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之一的，本基金将依据《基金合同》第十九部分的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。”

截至2025年11月3日日终，本基金已出现连续50个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本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进行表决。

根据基金管理人于2025年11月4日发布的《上海国泰海通证券资产管理有限公司关于国泰海通善远平衡配置一年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》，本基金自2025年11月4日起进入基金财产清算程序。

四、财务会计报告

1、基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：国泰海通善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2025年11月3日（本基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2025年11月3日
资产：	
银行存款	32,019,967.70
结算备付金	—
存出保证金	—
交易性金融资产	200.00
其中：股票投资	—
应收基金红利	24.38
应收清算款	2,425,148.61
资产总计	34,445,340.69
负债和净资产	最后运作日 2025年11月3日
负债：	
应付赎回款	2,643,658.36
应付管理人报酬	25,785.80
应付托管费	5,525.52
应付销售服务费	3,022.07
应交税费	62,090.12
其他负债	42,491.78
负债合计	2,782,573.65
净资产：	
实收基金	30,926,548.66
未分配利润	736,218.38
净资产合计	31,662,767.04
负债和净资产总计	34,445,340.69

注：本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《资产管理产品相关会计处理规定》等有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无可比期间的相关数据列示。

五、清算情况

本基金的清算期间为自2025年11月4日至2025年11月11日。基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序对本基金的资产、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

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用。按照《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。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，本基金清算期间的清算审计费、清算律师费由基金管理人承担。

2、资产处置情况

（1）本基金最后运作日银行存款为人民币32,019,967.70元，其中托管户存款为人民币26,541,024.13元，证券账户余额为人民币5,476,380.18元，应计银行存款利息为人民币2,450.81元，应计证券账户存款利息为人民币112.58元。

清算期间托管户存款流入人民币7,901,753.17元，流出3,394,646.19元，计提托管户利息2,486.26元；清算期间证券账户资金流入人民币224.38元，流出5,476,604.56元，证券账户计提证券账户存款利息0.00元。

截止清算期末本基金银行存款为人民币31,053,180.76元，其中托管户存款为人民币31,053,180.76元，证券账户余额为人民币0.00元，应计银行存款利息为人民币4,937.07元，应计证券账户存款利息为人民币112.58元。应计利息将由基金管理人垫付。

（2）本基金最后运作日基金投资为人民币200.00元，该款项已于清算期间卖出变现。

（3）本基金最后运作日应收基金红利为人民币24.38元，该款项已于清算期间到账。

（4）本基金最后运作日场外基金赎回款为人民币2,425,148.61元，该款项已于清算期间到账。

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2,643,658.36元，该款项已于清算期间完成支付。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币25,785.80元，清算期间尚未支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币5,525.52元，该款项已于2025年11月7日支付。

（4）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币3,022.07元，该款项已于2025年11月7日支付。

（5）本基金最后运作日应交增值税及其附加税为人民币62,090.12元，该款项已于2025年11月7日支付。

（6）本基金最后运作日预提费用为人民币42,491.78元，为预提信息披露费42,191.78元和预提银行汇划费300.00元。

清算期间因资金划付确认汇划费102.19元。

截止清算期末本基金预提费用为人民币42,389.59元，为预提信息披露费42,191.78元和预提银行汇划费197.81元。

4、清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	自2025年11月4日至2025年11月11日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	2,486.26
2、投资收益	—
3、公允价值变动收益	—
清算收益小计	—
二、清算支出（注2）	
1、其他费用（注3）	—
清算支出小计	—
三、清算净收益	2,486.26

注1：利息收入系自2025年11月4日起至2025年11月11日止清算期间的银行存款和证券账户利息收入。

注2：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，本基金清算期间的清算审计费、清算律师费由基金管理人承担。

5、剩余资产分配情况说明

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2025年11月3日基金净资产	31,662,767.04
加：清算期间净收益	2,486.26
减：基金净赎回金额（于2025年11月4日确认的投资者赎回申请）	680,247.93
二、清算结束日2025年11月11日基金净资产	30,985,005.37

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日2025年11月11日，本基金剩余财产为人民币30,985,005.37元。根据本基金的基金合同，本基金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。

自本次清算期起始日2025年11月4日至清算款划出前一日产生的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息归基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，该部分利息将由基金管理人垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

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，报上海证监局备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

（1）《国泰海通善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）审计报告》

（2）《上海市通力律师事务所关于国泰海通善远平衡配置一年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

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。

国泰海通善远平衡配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）

基金财产清算小组

二〇二五年十一月十一日