

# 中金优选长兴稳健6个月持有期混合型发起式基金中基金 （FOF）清算报告

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日期：2026年04月16日

报告公告日期：2026年04月21日

## 1 重要提示

中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）依据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2023 年 2 月 24 日证监许可[2023]396 号文《关于准予中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)注册的批复》注册，2023 年 3 月 29 日基金合同生效。本基金的基金管理人为中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”），本基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

根据《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：

“《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。”

本基金《基金合同》生效日为 2023 年 3 月 29 日，《基金合同》生效之日起三年后的对应日为 2026 年 3 月 29 日。截至 2026 年 3 月 29 日日终，本基金的基金资产净值低于 2 亿元，已触发基金合同中约定的基金终止条款。基金管理人将根据相关法律法规、基金合同等约定履行基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会审议。

本基金自 2026 年 3 月 30 日起进入清算期，由基金管理人中金基金、基金托管人招商银行、信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力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，并由信永中和会计师事务所（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。

## 2 基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起（FOF）
基金主代码	018141
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 29 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
最后运作日（2026 年 3 月 29 日）基金份额总额	22,303,972.79 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置策略和基金优选策略，进行积极主动的投资管理，力争为持有人提供长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金投资策略包括大类资产配置策略、基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略及资产支持证券投资策略。在大类资产配置策略上，将通过战略资产配置策略（SAA）与战术资产配置策略（TAA）的有机结合，确定并优化投资组合的资产配置比例。在基金投资策略上，基金精选部分以长期可持续的超额收益能力作为核心目标，通过采用定量与定性相结合的研究方法进行基金筛选并完成组合构建，以获取基金精选层面的 $\alpha$ 收益。基金精选具体包括定量评估、定性评估、基金池管理和基金投资。在股票投资策略上，结合行业配置与个股选择，在景气度向上的行业中，选择具备内生性增长基础的价值创造型企业，并重点关注相关个股的安全边际及绝对收益机会。详见《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*10%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 本基金投资于港股通标的股票，还需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

#### 3.1 资产负债表

会计主体：中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2026 年 3 月 29 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 3 月 29 日 (基金最后运作日)
<b>资产：</b>	
货币资金	2,482,321.31
结算备付金	-
存出保证金	19.09
交易性金融资产	22,053,696.36
其中：股票投资	-
基金投资	21,445,776.69
债券投资	607,919.67
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	57,918.64
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	24,593,955.40
<b>负债和净资产</b>	<b>本期末 2026 年 3 月 29 日 (基金最后运作日)</b>
<b>负债：</b>	
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	-

应付赎回款	24,178.29
应付管理人报酬	9,808.80
应付托管费	2,870.25
应付销售服务费	923.48
应付投资顾问费	-
应交税费	3,057.93
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	1,000.00
负债合计	41,838.75
<b>净资产：</b>	
实收基金	22,303,972.79
其他综合收益	-
未分配利润	2,248,143.86
净资产合计	24,552,116.65
负债和净资产总计	24,593,955.40

注：报告截止日 2026 年 3 月 29 日，中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起（FOF）A 的基金份额净值为 1.1024 元，期末份额总额为 17,030,743.50 份；中金优选长兴稳健 6 个月持有混合发起（FOF）C 的基金份额净值为 1.0957 元，期末份额总额为 5,273,229.29 份。基金份额总额 22,303,972.79 份。

## 4 清盘事项说明

### 4.1 基金基本情况

本基金依据中国证监会于 2023 年 2 月 24 日证监许可[2023]396 号文注册，由中金基金依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则、《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书》(以下简称《招募说明书》)和《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为中金基金，基金托管人为招商银行。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台及蚂蚁(杭州)基金销售有限公司等共同销售，募集期为 2023 年 3 月 23 日起至 2023 年 3 月 27 日。经向中国证监会备案，《中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2023 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 10,009,940.63 份(含利息转份额 900.57 份)，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马

威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《基金合同》和《招募说明书》的相关内容,本基金根据认购、申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用,而不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书及基金产品资料概要中具体列示。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。计算公式为计算日某类基金份额净值 = 计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日该类基金份额余额总数。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《基金合同》和《招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围主要为经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(包括公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募 REITs”)、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF,下同)、QDII 基金和香港互认基金等)。本基金还可投资于股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

## 4.2 清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:

“《基金合同》生效之日起三年后的对应日,若基金资产净值低于 2 亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。”

本基金《基金合同》生效日为 2023 年 3 月 29 日,《基金合同》生效之日起三年后的对应日为 2026 年 3 月 29 日。截至 2026 年 3 月 29 日日终,本基金的基金资产净值低

于2亿元，已触发基金合同中约定的基金终止条款。基金管理人将根据相关法律法规、基金合同等约定履行基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会审议。

#### 4.3 清算起始日

本基金于2026年3月30日起进入清算期，清算期为2026年3月30日至2026年4月3日。本基金将清算后的全部剩余财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。

#### 4.4 清算报表编制基础

本基金的清算报表是参考《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。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

### 5 清算情况

自2026年3月30日至2026年4月3日止为本基金清算报告期，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：

#### 5.1 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。

#### 5.2 资产处置情况

银行存款、存出保证金、应收清算款资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价值	清算金额	清算期期末账面价值
1	银行存款（注）	2,482,321.31	12,802,635.94	15,284,957.25
2	存出保证金	19.09	-19.09	0.00
3	应收清算款	57,918.64	9,229,153.13	9,287,071.77

注：银行存款包含应计利息金额。

#### 5.3 负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付赎回款为人民币24,178.29元，已于2026年4月7日前支付完毕。

（2）本基金最后运作日应付管理费为人民币9,808.80元，已于2026年4月2日支

付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,870.25 元, 已于 2026 年 4 月 2 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 923.48 元, 已于 2026 年 4 月 2 日支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费人民币 3,057.93 元, 清算结束日应交税费为人民币 3,599.38 元, 该款项将于清算期后划付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为预提审计费人民币 1,000.00 元, 已于 2026 年 4 月 7 日完成支付。

#### 5.4 清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	本期 2026 年 3 月 30 日 (基金清算起始日) 至 2026 年 4 月 3 日 (基金清算结束日) 止期 间
<b>一、资产处置损益</b>	<b>14,729.03</b>
1. 利息收入	746.13
其中: 存款利息收入	746.13
债券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
2. 投资收益 (损失以-填列)	1,209,520.90
其中: 债券投资收益	7.56
基金投资收益	1,209,513.34
股利收益	-
3. 公允价值变动收益 (损失以-号填列)	-1,195,538.00
4. 其他收入 (损失以-号填列)	-
<b>二、清算费用</b>	<b>420.64</b>
1. 税金及附加	385.64
2. 其他费用	35.00
<b>三、清算净损益 (净亏损以-号填列)</b>	<b>14,308.39</b>

#### 5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2026 年 3 月 29 日基金净资产	24,552,116.65
加: 清算期间净收益	14,308.39
减: 基金净赎回金额	0.00

二、2026年4月3日基金净资产	24,566,425.04
------------------	---------------

资产处置及负债清偿后,于 2026 年 4 月 3 日本基金剩余财产为人民币 24,566,425.04 元,根据《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。

自本次清算期结束日次日 2026 年 4 月 4 日至清算款项支付日前一日的存款利息归基金份额持有人所有。于清算划款日的应计存款利息余额由基金管理人以自有资金先行垫付,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。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。除清算划款产生的银行汇划费从基金资产中支付外,其他与本次清算相关产生的银行汇划费由基金管理人承担。

### 5.6 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。

## 6 备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

- (1) 中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）审计报告
- (2) 《上海市通力律师事务所关于<中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算报告>的法律意见》

### 6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 6.3 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。

中金优选长兴稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金财产清算  
小组

二〇二六年四月二十一日