

中泰双鑫 6 个月持有期债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

清算报告出具日:2026 年 8 月 25 日

清算报告公告日:2026 年 9 月 10 日

§ 1 重要提示

中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金(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[2024]1930号《关于准予中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,于2025年5月30日成立并正式运作。

《中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金基金合同》(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”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5,000万元情形的,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,基金管理人可以按照《基金合同》约定的程序进行清算并终止《基金合同》,无需召开基金份额持有人大会。”

截至2026年8月5日日终,本基金资产净值已连续50个工作日低于5,000万元,触发基金合同终止条款。本基金的最后运作日为2026年8月5日,并于2026年8月6日进入基金财产清算程序。

基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和北京市通商律师事务所上海分所于2026年8月6日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,北京市通商律师事务所上海分所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

基金名称	中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金	
基金简称	中泰双鑫6个月持有债券	
基金主代码	023214	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年05月30日	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
最后运作日（2026年8月5日）基金份额总额	6, 720, 389. 26份	
下属分级基金的基金简称	中泰双鑫6个月持有债券A	中泰双鑫6个月持有债券C
下属分级基金的交易代码	023214	023215
最后运作日（2026年8月5日）下属分级基金的份额总额	1, 682, 492. 67份	5, 037, 896. 59份
投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金在充分考虑基金资产的安全性、收益性、流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究证券市场运行状况、研判市场风险，制定证券投资策略，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。在具体细分品类投资策略上，本基金投资策略主要分为资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、基金投资策略和信用衍生品投资策略。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深300指数收益率×7%+恒生指数收益率×3%	
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期风险与收益理论	

	上高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。 本基金投资于港股通标的股票时，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。
--	--

§ 3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2024]1930号《关于准予中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由中泰证券(上海)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《基金合同》负责公开募集。基金合同于2025年5月30日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为268,786,352.05份。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

鉴于本基金已连续50个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元，触发基金合同终止条款，基金管理人依据《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》和《基金合同》的有关规定，在上述事由出现后终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。本基金最后运作日为2026年8月5日，自2026年8月6日起进入清算程序。

§ 4 财务报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）
会计主体：中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金
报告截止日：2026年8月5日

单位：人民币元

项目	2026 年 8 月 5 日 (基金最后运作日)
资 产：	
货币资金	1,078,912.32
结算备付金	704.45
存出保证金	-
交易性金融资产	6,102,899.18
其中：股票投资	-

债券投资	6,102,899.18
应收申购款	-
资产总计	7,182,515.95
负债和净资产	
负 债:	
应付赎回款	304,646.71
应付管理人报酬	1,030.94
应付托管费	268.05
应付销售服务费	592.71
应交税费	1,109.94
其他负债	88,365.40
负债合计	396,013.75
净资产:	
实收基金	6,720,389.26
未分配利润	66,112.94
净资产合计	6,786,502.20
负债和净资产总计	7,182,515.95

注：1. 报告截止日2026年8月5日(基金最后运作日)，基金份额总额6,720,389.26份，其中中泰双鑫6个月持有债券A基金份额总额1,682,492.67份，中泰双鑫6个月持有债券C基金份额总额5,037,896.59份；中泰双鑫6个月持有债券A基金份额净值为1.0130元，中泰双鑫6个月持有债券C基金份额净值为1.0088元。

2. 本财务报表已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师倪益、谢晶菁签字出具了毕马威华振审字第 2626961 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 清算情况

自2026年8月6日至2026年8月25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：

5.1 资产负债清算情况

5.1.1 自 2026 年 8 月 6 日(清算开始日)本基金进入清算程序起至 2026 年 8 月 25 日(清算结束日)止期间，本基金由银行存款和结算备付金产生的利息收入归基金份额持有人所有。其中，银行存款和结算备付金产生的利息收入由基金管理人中泰证券（上海）资产管理有限公司先行垫付，垫付资金孳生的利息归中泰证券（上海）资产管理有限公司所有，结息后将由托管人退还中泰证券（上海）资产管理有限公司，结息金额与清算结

束日止期间预估的垫付利息产生的差额也由中泰证券（上海）资产管理有限公司享有或承担。

5.1.2 本基金于 2026 年 8 月 5 日（基金最后运作日）持有的交易性金融资产 6,102,899.18 元，截至 2026 年 8 月 25 日（清算结束日）已全部变现。

5.1.3 本基金于 2026 年 8 月 5 日（基金最后运作日）已确认的应付赎回款余额为 304,646.71 元，截至 2026 年 8 月 25 日（清算结束日），该款项已支付。

5.1.4 本基金于 2026 年 8 月 5 日（基金最后运作日）的应付管理人报酬为 1,030.94 元，截至 2026 年 8 月 25 日（清算结束日），该款项已支付。

5.1.5 本基金于 2026 年 8 月 5 日（基金最后运作日）的应付托管费为 268.05 元，截至 2026 年 8 月 25 日（清算结束日），该款项已支付。

5.1.6 本基金于 2026 年 8 月 5 日（基金最后运作日）的应付销售服务费为 592.71 元，截至 2026 年 8 月 25 日（清算结束日），该款项已支付。

5.1.7 本基金于 2026 年 8 月 5 日（基金最后运作日）的应交税费为 1,109.94 元，截至 2026 年 8 月 25 日（清算结束日），该款项已支付。

5.1.8 本基金于 2026 年 8 月 5 日（基金最后运作日）的其他负债为 88,365.40 元，截至 2026 年 8 月 25 日（清算结束日），其他负债余额为人民币 37,018.55 元，上述款项将于清算结束后支付。

5.2 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2026 年 8 月 6 日(清算开始日)至 2026 年 8 月 25 日(清算结束日)止期间
一、收入	961.72
1、利息收入	1,240.72
2、投资收益(损失以“-”填列)	16,959.60
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)	-17,238.60
4、其他收入(损失以“-”填列)	-
减：二、费用	-44,475.06
1、其他费用	-44,475.06
三、利润总额	45,436.78
减：所得税费用	-

四、净收益	45,436.78
-------	-----------

- 注：1. 利息收入系以当前适用的利率计提的自 2026 年 8 月 6 日(清算开始日)至 2026 年 8 月 25 日(清算结束日)止清算期间的利息收入，为银行存款和结算备付金利息收入。
2. 投资收益系清算期间卖出债券产生的差价收入及交易费用。
3. 公允价值变动损益系清算期间处置交易性金融资产产生的，为原计入交易性金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。
4. 其他费用为汇划手续费及信息披露费减免。

5.3 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、2026 年 8 月 5 日（基金最后运作日）基金净资产	6,786,502.20
加：清算期间净收益	45,436.78
减：清算期间确认的赎回导致的基金净资产变动	514,544.83
二、2026 年 8 月 25 日(清算结束日)基金净资产	6,317,394.15

注：本基金最后运作日为2026年8月5日，最后运作日交易申请的确认日为2026年8月6日。

截至本次清算期结束日 2026 年 8 月 25 日，本基金剩余财产 6,317,394.15 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。

5.4 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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后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、中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金基金清算财务报告及审计报告；
- 2、关于《中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金清算报告》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。

客户服务中心电话：400-821-0808

中泰双鑫6个月持有期债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2026年8月25日