

摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)清算报告

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年九月十八日

报告公告日期：二〇二六年九月二十九日

目录

1、重要提示	3
2、基金概况	3
2.1 基金基本情况	3
2.2 基金产品说明	4
3、基金运作情况概述	5
4、财务会计报告	6
5、清算事项说明	7
5.1 基金基本情况	7
5.3 清算报表编制基础	8
6、清算情况	9
6.1 清算费用	9
6.2 资产处置情况	9
6.3 负债清偿情况	9
6.4 清算期的清算损益情况	10
6.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况	10
6.6 基金财产清算报告的告知安排	11
7、备查文件目录	11
7.1 备查文件目录	11
7.2 存放地点	11
7.3 查阅方式	12

1、重要提示

摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(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”）证监许可[2023]722 号文准予募集注册，于 2023 年 8 月 8 日成立并正式运作，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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》和《摩根双季鑫 6 个月持有期债券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》”）的有关规定：《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的方式延续基金合同期限。本基金的基金合同生效日为 2023 年 8 月 8 日，基金合同生效之日起 3 年后的对应日为 2026 年 8 月 8 日。截至 2026 年 8 月 8 日日终，本基金资产净值低于 2 亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的终止情形，基金合同自动终止，基金管理人将根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金的最后运作日为 2026 年 8 月 8 日，并于 2026 年 8 月 9 日进入基金财产清算程序。

本基金从 2026 年 8 月 9 日起进入清算期，由基金管理人摩根基金管理（中国）有限公司、基金托管人中国光大银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰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，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰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	摩根双季鑫6个月持有期债券型发起式基金中基金
------	------------------------

	(FOF)	
基金简称	摩根双季鑫6个月持有债券 (FOF)	
基金主代码	018428	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年8月8日	
基金管理人名称	摩根基金管理（中国）有限公司	
基金托管人名称	中国光大银行股份有限公司	
基金最后运作日（2026年8月8日）基金份额总额	17, 939, 920. 07	
下属分级基金的基金简称	摩根双季鑫6个月持有债券 (FOF) A	摩根双季鑫6个月持有债券 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	018428	018429
2026年8月8日下属分级基金份额总额	13, 994, 978. 36	3, 944, 941. 71

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过资产配置及优选基金，并结合严格的风险控制，力争实现基金资产的长期稳健增值。
------	--

投资策略	1、资产配置策略 2、基金投资策略 (1) 主动管理型基金投资策略 (2) 指数基金投资策略 (3) 公募REITs投资策略 3、股票投资策略 4、债券投资策略 5、证券公司短期公司债投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、存托凭证投资策略
业绩比较基准	中证债券型基金指数收益率*90%+活期存款利率（税后）*10%
风险收益特性	本基金属于债券型基金中基金，预期风险和收益水平低于股票型基金中基金和混合型基金中基金，高于货币型基金中基金。

3、基金运作情况概述

根据中国证监会关于准予本基金注册的文件（证监许可[2023]722号文），自2023年7月24日起向全社会公开募集，并于2023年8月4日募集工作顺利结束。

经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效净认购金额为15,204,249.05元人民币，折合基金份额15,204,249.05份；认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计1,758.48元人民币，折合基金份额1,758.48份。总计募集基金份额15,206,007.53份。

经中国证监会书面确认，本基金的基金合同于2023年8月8日生效。本基金为契约型开放式债券型基金中基金(FOF)，存续期限为不定期。

自2023年8月8日至2026年8月8日期间，本基金按基金合同正常运作。

自2026年8月9日起，本基金进入清算程序。

4、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金 (FOF)

报告截止日：2026 年 8 月 8 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2026 年 8 月 8 日 (基金最后运作日)
资 产：	
货币资金	15,433,149.33
结算备付金	43,647.23
存出保证金	12,991.86
应收申购款	854.20
应收清算款	9,135,772.40
资产总计	24,626,415.02
负 债 和 净 资 产	
负 债：	
应付赎回款	5,786,663.03
应付管理人报酬	1,535.88
应付托管费	257.86
应付销售服务费	283.89
应交税费	7.86
其他负债	26,000.00
负债合计	5,814,748.52

净资产：	
实收基金	17,939,920.07
未分配利润	871,746.43
净资产合计	18,811,666.50
负债和净资产总计	24,626,415.02

注：

1. 报告截止日 2026 年 8 月 8 日(基金最后运作日)，摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)的基金份额总额 17,939,920.07 份，其中：A 类，基金份额净值：1.0503 元，基金份额：13,994,978.36 份。C 类，基金份额净值：1.0425 元，基金份额：3,944,941.71 份。
2. 财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 8 月 8 日(基金最后运作日)止期间。

5、清盘事项说明

5.1 基金基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、公开募集基础设施证券投资基金（公募 REITs）及其他经中国证监会核准或注册的基金）、国内依法发行或上市的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、公开发行的次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（须符合中国证监会相关规定）。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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%；投资于债券型证券投资基金（包括债券指数基金）的比例不低于本基金资产的 80%；投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%，投资于 QDII 基金和香港互认基金比例合计不超过基金资产的 20%。本基金应保持现金或到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证债券型基金指数收益率*90%+活期存款利率（税后）*10%

5.2 清算原因

根据《基金合同》以及摩根基金管理（中国）有限公司于 2026 年 8 月 10 日发布的《关于摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金触发了《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，本基金的最后运作日为 2026 年 8 月 8 日，并于 2026 年 8 月 9 日进入基金财产清算程序。

5.3 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。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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

6、清算情况

自 2026 年 8 月 9 日至 2026 年 9 月 18 日止清算期间，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：

6.1 清算费用

按照《基金合同》中“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。

6.2 资产处置情况

(1) 自最后运作日(2026 年 8 月 8 日)后至基金财产返还投资人前一日止期间本基金由货币资金、结算备付金、存出保证金产生的利息收入将由基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司先行垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。托管账户销户后将由基金托管人退还基金管理人，与之前预估数所产生的差异也由基金管理人享有/承担。

(2) 本基金最后运作日(2026 年 8 月 8 日)的应收清算款 9,135,772.40 元，该款项已于 2026 年 8 月 13 日完成收回。

(3) 本基金最后运作日(2026 年 8 月 8 日)应收申购款 854.20 元，该款项已于 2026 年 8 月 10 日完成收回。

6.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日(2026 年 8 月 8 日)应付管理人报酬为人民币 1,535.88 元，该款项已于 2026 年 8 月 14 日支付。

(2) 本基金最后运作日(2026 年 8 月 8 日)应付托管费为人民币 257.86 元，该款项已于 2026 年 8 月 14 日支付。

（3）本基金最后运作日(2026年8月8日)应付销售服务费为人民币283.89元，该款项已于2026年8月14日完成支付。

（4）本基金最后运作日(2026年8月8日)应付赎回款为人民币5,786,663.03元，该款项已于2026年8月12日完成支付。

（5）本基金最后运作日(2026年8月8日)应付税费为人民币7.86 元，该款项已于2026年8月14日完成支付。

（6）本基金最后运作日(2026年8月8日)确认的其他负债为人民币26,000.00元，包括应付审计费为人民币6,000.00元，该款项已于2026年8月19日支付。应付律师费为人民币20,000.00元,该款项已于2026年8月17日支付。

6.4 清算期的清算损益情况

单位：人民币元	
项目	自2026年8月9日至2026年9月18日止清算期间
一、清算期间收益	
利息收入-存款利息收入（注1）	6476.07
二、清算期间费用	
汇划费用	0
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	6476.07

注1：利息收入以当前适用的利率预估计提的自2026年8月8日至2026年9月18日止清算期间的货币资金利息、结算备付金利息、存出保证金利息。

6.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

截至本次清算期结束日2026年9月18日，本基金剩余财产为人民币15,863,410.88元，自本次清算结束日次日2026年9月19日至本次清算款划出前一日的货币资金、结算

备付金、存出保证金产生的利息亦归基金份额持有人所有。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。

为便于及时向基金份额持有人分配剩余资产，基金管理人摩根基金管理（中国）有限公司以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付备付金以及由货币资金、结算备付金、存出保证金产生的利息。基金管理人所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。

本基金的货币资金、结算备付金、存出保证金的应收利息为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中基金管理人垫付资金与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

6.6 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。

7、备查文件目录

7.1 备查文件目录

（1）摩根双季鑫6个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)清算财务报表及审计报告

（2）关于摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)清算事宜之法律意见

7.2 存放地点

基金管理人处

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根双季鑫 6 个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)

财产清算组

2026年9月29日