
东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起 式证券投资基金 清算报告

基金管理人：上海东方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 3 月 20 日

报告公告日期：2025 年 4 月 15 日

目录

1、重要提示	1
1.1 重要提示	1
2、基金概况	2
2.1 基金基本情况	2
2.2 基金产品说明	2
3、基金运作情况说明	2
4、财务报告	3
4.1 资产负债表(已经审计)	3
5、清算情况	4
5.1 资产负债清算情况	4
5.2 清算损益表	5
5.3 截至本次清算期结束日的剩余财产分配情况	6
5.4 基金财产清算报告的告知安排	6
6、备查文件目录	7
6.1 备查文件目录	7
6.2 存放地点	7
6.3 查阅方式	7

1、重要提示

1.1 重要提示

东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金(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【2020】1702 号《关于准予东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册,由上海东方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《东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称或“《基金合同》”)进行公开募集。经向中国证监会备案,《东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 21 日正式生效。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的相关约定:“《基金合同》生效满三年后继续存续的,在任一开放期的最后一个开放日日终(登记机构完成最后一个开放日申购、赎回业务申请的确认以后),如基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的,则本基金根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止,无需召开基金份额持有人大会。”《基金合同》生效已满三年,且本基金最近一个开放期为 2025 年 2 月 5 日(含)至 2025 年 3 月 4 日(含),截至 2025 年 3 月 4 日日终且登记机构完成该开放日申购、赎回业务申请的确认以后,本基金的基金资产净值低于 5000 万元人民币,触发《基金合同》终止的上述情形,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。

本基金的最后运作日为 2025 年 3 月 4 日,自 2025 年 3 月 5 日起,本基金进入清算程序,由本基金管理人上海东方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、毕马威华振会计师事务所(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,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	东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	东方红鼎元 3 个月定开混合
基金主代码	010059
基金运作方式	契约型，定期开放式，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式
基金合同生效日	2020 年 9 月 21 日
基金管理人	上海东方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
最后运作日（2025 年 3 月 4 日）基金总份额	148,000,261.50 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	在封闭期内，本基金对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测，通过定性和定量指标的分析，在目标收益条件下，追求风险最小化，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。 基于本基金每 3 个月开放一次、除开放期外封闭运作的特点，基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力，分散投资，做好流动性管理以应对开放期投资者的赎回需求。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+银行活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

3、基金运作情况说明

本基金经中国证监会证监许可【2020】1702 号《关于准予东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册，由上海东方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《东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》进行公开募集。经向中国证监会备案，《东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 21 日正式生效。本基金的基金管理人为

上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

自 2020 年 9 月 21 日至 2025 年 3 月 4 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“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的相关约定：“《基金合同》生效满三年后继续存续的，在任一开放期的最后一个开放日日终（登记机构完成最后一个开放日申购、赎回业务申请的确认以后），如基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，则本基金根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会。”《基金合同》生效已满三年，且本基金最近一个开放期为 2025 年 2 月 5 日（含）至 2025 年 3 月 4 日（含），截至 2025 年 3 月 4 日日终且登记机构完成该开放日申购、赎回业务申请的确认以后，本基金的基金资产净值低于 5000 万元人民币，触发《基金合同》终止的上述情形，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。

基金管理人已就该事项于 2025 年 3 月 5 日刊登了《关于东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后一个运作日为 2025 年 3 月 4 日，自 2025 年 3 月 5 日起，本基金进入基金资产清算程序，终止办理申购、赎回等业务。自 2025 年 3 月 5 日起，停止收取基金管理费和基金托管费。

4、财务报告

4.1 资产负债表(已经审计)

单位：人民币元

资产	本期末 2025 年 3 月 4 日 (基金最后运作日)
资 产：	
货币资金	336,036,550.33
结算备付金	221,671.97
存出保证金	586,248.43
交易性金融资产	11,957,680.00
其中：股票投资	11,957,680.00
应收清算款	22,051,190.77
资产合计	370,853,341.50

负 债：	
应付清算款	16,455.60
应付赎回款	228,113,800.00
应付管理人报酬	739,538.80
应付托管费	41,085.49
其他负债	702,795.47
负债合计	229,613,675.36
净资产：	
实收基金	148,000,261.50
未分配利润	-6,760,595.36
净资产合计	141,239,666.14
负债和净资产总计	370,853,341.50

注：1、报告截止日 2025 年 3 月 4 日(基金最后运作日)，基金份额净值为 0.9543 元，基金份额 148,000,261.50 份。

2、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》的有关规定编制的。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，本清算报表无比较期间的相关数据列示。

5、清算情况

5.1 资产负债清算情况

自 2025 年 3 月 5 日至 2025 年 3 月 20 日止为本基金清算期间，基金财产清算小组按照法律法规及本基金基金合同的规定履行基金财产清算程序，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：

截至本次清算期结束日（2025 年 3 月 20 日），各项资产负债清算情况如下：

1、本基金最后运作日货币资金余额为 336,036,550.33 元(含应计利息 121,416.10 元)，截至清算期结束日货币资金余额为 18,857,157.82 元（含应计利息 126,263.55 元），应计货币资金利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

2、本基金最后运作日结算备付金余额为 221,671.97 元（含应计利息 1,088.06 元），截至清算期结束日结算备付金余额为 293,424.75 元（含应计利息 1,130.05 元），应计结算备付金利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

3、本基金最后运作日存出保证金余额为 586,248.43 元（含应计利息 391.45 元），截至清算期结束日存出保证金余额为 586,339.47 元（含应计利息 482.49 元），应计存出保证

金利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

4、本基金最后运作日持仓股票市值为 11,957,680.00 元,上述持仓股票已于清算期间全部卖出,截至清算期结束日已全部收到卖出款项。

5、本基金最后运作日应收清算款余额为 22,051,190.77 元,截至清算期结束日该款项已全部收到。

6、本基金最后运作日应付赎回款余额为 228,113,800.00 元,截至清算期结束日该款项已全部支付。

7、本基金最后运作日应付管理人报酬余额为 739,538.80 元,截至清算期结束日该款项已全部支付。

8、本基金最后运作日应付托管费余额为 41,085.49 元,截至清算期结束日该款项已全部支付。

9、本基金最后运作日应付清算款余额为 16,455.60 元,截至清算期结束日该款项已全部支付。

10、本基金最后运作日其他负债余额为 702,795.47 元,包括应付佣金、预提清算律师费、预提审计费、预提信息披露费和预提银行间账户维护费。其中:

1) 最后运作日应付佣金余额为 478,802.63 元,清算期间产生应付佣金 5,053.53 元,支付佣金 483,856.16 元,截至清算期结束日该款项已全部支付;

2) 最后运作日预提清算律师费余额为 15,000.00 元,该款项将于取得律师费发票后支付;

3) 最后运作日预提审计费余额为 64,492.84 元,该款项将于取得审计费发票后支付;

4) 最后运作日预提中国证券报信息披露费余额为 140,000.00 元,其中 2024 年未支付的信息披露费 120,000.00 元已于 2025 年 3 月 13 日支付,剩余 20,000.00 元该款项将于取得信息披露费发票后支付;

5) 最后运作日预提银行间账户维护费余额为 4,500.00 元,截至清算期结束日该款项已全部支付。

5.2 清算损益表

项目	2025 年 3 月 5 日至 2025 年 3 月 20 日 (清算期间)
一、清算收益(损失)	-405,456.94
1. 利息收入	4,980.48
2. 投资收益	1,914,207.70

3. 公允价值变动损益	-2,324,645.12
4. 汇兑收益	-
5. 其他收入	-
二、清算费用	680.00
1. 银行汇划费	680.00
三、清算收益（损失）总额	-406,136.94
减：所得税费用	-
四、清算净收益（损失）	-406,136.94

注：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2025 年 3 月 5 日至 2025 年 3 月 20 日止清算期间的活期存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

5.3 截至本次清算期结束日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 2025 年 3 月 4 日基金净资产	141,239,666.14
加：清算期间净收益	-406,136.94
减：确认赎回对净值的影响	121,196,100.00
二、2025 年 3 月 20 日基金净资产	19,637,429.20

截至本次清算期结束日 2025 年 3 月 20 日，本基金剩余财产为人民币 19,637,429.20 元。根据本基金的基金合同约定，基金财产清算小组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 2025 年 3 月 21 日至清算款划出前一日的收益和费用由基金份额持有人享有和承担。为保护基金份额持有人利益，加快清算速度，银行存款、结算备付金和存出保证金尚未结息的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。

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。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进行分析。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金审计报告
- 2、《东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

6.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：www.dfham.com。

东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2025 年 3 月 20 日