

财通资管通达未来 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:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告出具日期: 2025 年 07 月 15 日

报告送出日期: 2025 年 08 月 15 日

§ 1 重要提示

财通资管通达未来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”)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]863号《关于准予财通资管通达未来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,于2022年7月7日正式生效,本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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《财通资管通达未来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》”)的有关规定,本基金于基金合同生效满三年之日(2025年7月7日)日终基金资产净值低于2亿元,出现基金合同终止事由。财通证券资产管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)自2025年7月8日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

本基金自2025年7月8日起进入清算期,由基金管理人财通证券资产管理有限公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对本基金清算报告出具法律意见。

§ 2 基金概况

基金名称	财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	
基金简称	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）	
基金主代码	015776	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年07月07日	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
基金最后运作日（2025年07月07日） 基金份额总额	15,658,217.72份	
投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过资产配置策略和公募基金精选策略，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。	
投资策略	1、大类资产配置策略；2、基金投资策略；3、股票投资策略；4、债券投资策略；5、可转换债券和可交换债券投资策略；6、资产支持证券投资策略。	
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，在通常情况下其预期收益及预期风险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。	
下属分级基金的基金简称	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）A	财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）C
下属分级基金的交易代码	015776	015777
报告期末下属分级基金的份额总额	15,285,486.46份	372,731.26份

§ 3 基金运作情况说明

财通资管通达未来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”)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]863号《关于准予财通资管通达未来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,由财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《财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金(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。根据《财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》的相关规定,本基金对每份基金份额设置6个月的最短持有期。对于每份基金份额,最短持有期起始日指基金合同生效日(对认购份额而言)、基金份额申购确认日(对申购份额而言)或基金份额转换转入确认日(对转换转入份额而言);最短持有期到期日指该基金份额最短持有期起始日起次6个月的月度对日。如该对应日期为非工作日,则顺延至下一工作日,若该日历月份不存在对应日期的,则顺延至该月最后一日的下一工作日。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币34,895,009.89元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0494号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》于2022年7月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为34,896,016.92份基金份额,其中认购资金利息折合1,007.03份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

自2022年7月7日至2025年7月7日期间,本基金按基金合同正常运作。

本基金自2025年7月8日起进入清算期,由基金管理人财通证券资产管理有限公司、基金托管人中国民生银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

§ 4 财务会计报告

资产负债表(已经审计)

会计主体:财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

报告截止日:2025年7月7日(基金最后运作日)

单位:人民币元

资产	本期末 2025 年 7 月 7 日(基金最后运作日)
资产:	
货币资金	884,093.09
结算备付金	533.18
存出保证金	2,184.99
交易性金融资产	16,399,408.56
其中:债券投资	303,889.97
基金投资	16,095,518.59
资产总计	17,286,219.82
负债:	

应付赎回款	39,520.82
应付管理人报酬	1,655.65
应付托管费	452.19
应付销售服务费	23.90
应交税费	6,250.91
其他负债	7,417.97
负债合计	55,321.44
净资产：	
实收基金	15,658,217.72
未分配利润	1,572,680.66
净资产合计	17,230,898.38
负债和净资产总计	17,286,219.82

注：报告截止日2025年7月7日（基金最后运作日），基金份额总额15,658,217.72份，其中财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）A基金份额净值1.1007元，份额总额15,285,486.46份；财通资管通达未来6个月持有混合发起式（FOF）C基金份额净值1.0882元，份额总额372,731.26份。

§ 5 清算情况

自2025年7月8日至2025年7月15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《基金合同》的规定履行基金财产清算程序，全部工作按清算原则和清算手续进行。截至2025年7月15日，各项资产负债清算情况如下：

一、 资产处置情况

（1）本基金最后运作日银行存款为人民币884,093.09元，其中活期存款本金为人民币883,954.20元，应计利息为人民币138.89元；截至清算期结束日银行存款余额为人民币17,025,535.01元，其中活期存款本金为人民币17,021,268.98元，应计利息为人民币4,266.03元。

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币533.18元，其中上交所最低备付金本金为人民币250.01元，深交所最低备付金本金为人民币283.17元，截至清算期结束日结算备付金为人民币388.45元，其中深交所最低备付金本金为人民币388.45元。

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币2,184.99元，其中上交所结算保证金本金为人民币1,364.60元，应计利息为人民币0.28元，深交所结算保证金本金为人民币819.94元，应计利息为人民币0.17元；截至清算期结束日存出保证金余额为人民币2,185.61元，其中上交所结算保证金本金为人民币1,364.60元，应计利息为人民币0.59元，深交所结算保证金本金为人民币819.94元，应计利息为人民币0.48元。

(4)本基金 2025 年 7 月 7 日(最后运作日)交易性金融资产为人民币 16,399,408.56 元,包含债券投资人民币 303,889.97 元和基金投资人民币 16,095,518.59 元。以上投资均于清算期处置变现,变现产生的证券清算款为人民币 16,423,026.15 元,已于清算期间划入托管账户。

二、 负债清偿情况

(1)本基金 2025 年 7 月 7 日(最后运作日)应付赎回款为人民币 39,520.82 元,已于清算期内全部支付。

(2)本基金 2025 年 7 月 7 日(最后运作日)的应付管理人报酬为人民币 1,655.65 元,应付托管费为人民币 452.19 元,应付销售服务费为人民币 23.90 元,将于清算期后支付。

(3)本基金最后运作日应交税费为人民币 6,250.91 元,清算期间计提应交税费人民币 258.06 元,于清算结束日应交税费余额为人民币 6,508.97 元,将于清算期后支付。

(4)本基金 2025 年 7 月 7 日(最后运作日)的其他负债为人民币 7,417.97 元,其中:预提年度审计费为人民币 2,575.60 元,于清算期内冲销;预提中债账户维护费为人民币 4,842.37 元,于清算期内支付。截至 2025 年 7 月 15 日(清算结束日)的其他负债为人民币 215.00 元,全部为清算期间新增的预提汇划费。

三、 清算期清算损益情况

报告期间:2025 年 7 月 8 日-2025 年 7 月 15 日

单位:人民币元

项目	2025 年 7 月 8 日(清算开始日)至 2025 年 7 月 15 日(清算结束日)止期间
一、营业总收入	27,514.95
利息收入	4,127.76
投资收益(损失以“-”填列)	528,965.32
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-505,578.13
减:二、营业总支出	-1,135.31
其他费用	-1,135.31
三、利润总额	28,650.26
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	28,650.26
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	28,650.26

四、清算结束后所有者权益情况说明

项目	金额
----	----

一、2025年7月7日(最后运作日)净资产	17,230,898.38
加：清算期间净收益	28,650.26
加：清算期间基金份额赎回交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-240,295.28
二、2025年7月15日(清算结束日)净资产	17,019,253.36

赎回金额为2025年7月7日发起的赎回、转出申请，在清算期间进行支付。资产处置及负债清偿后，截止本基金清算报告期结束日2025年7月15日，本基金剩余净资产为人民币17,019,253.36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（其中，清算费用中的律师费用、审计费用由基金管理人承担）、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。2025年7月15日后至清算款划出日前的货币资金应计利息、结算备付金应计利息及存出保证金应计利息归基金份额持有人所有。清算分配结束后，与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

五、基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

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配。

§ 6 备查文件

备查文件目录

- 1、财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算财务报表及审计报告；
- 2、关于《财通资管通达未来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。

存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层
浙江省杭州市上城区新业路300号中国人寿大厦2幢22层

查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。
咨询电话：400-116-7888
公司网址：www.ctzg.com

基金财产清算小组
二〇二五年七月十五日