

东方专精特新混合型发起式证券投资基金清算报告

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：2025 年 12 月 10 日

清算报告公告日：2025 年 12 月 25 日

一、重要提示

东方专精特新混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）由东方基金管理股份有限公司担任基金管理人（以下简称“基金管理人”），由兴业银行股份有限公司担任基金托管人（以下简称“基金托管人”）。根据 2022 年 4 月 15 日中国证监会《关于准予东方专精特新混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2022]803 号）的注册进行公开募集，根据《关于东方专精特新混合型发起式证券投资基金备案确认的函》（基金成立备案函[2022]1336 号），《东方专精特新混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于 2022 年 12 月 7 日正式生效。

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》、《基金合同》的有关规定，以及本基金管理人于 2025 年 12 月 8 日发布的《关于东方专精特新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》，本基金基金合同生效日为 2022 年 12 月 7 日，基金合同生效满 3 年后的对应日为 2025 年 12 月 7 日。截至 2025 年 12 月 7 日日终，基金资产净值低于 2 亿元，触发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财产清算，不需召开基金份额持有人大会。

自 2025 年 12 月 8 日起本基金进入清算流程，由本基金管理人东方基金管理股份有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、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。

二、基金情况

1、基金基本情况

基金名称	东方专精特新混合型发起式证券投资基金
基金简称	东方专精特新混合发起式
基金主代码	015765
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 12 月 7 日
基金管理人	东方基金管理股份有限公司

基金托管人	兴业银行股份有限公司	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方专精特新混合发起式 A	东方专精特新混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	015765	015766

2、基金产品说明

投资目标	本基金在有效管理投资风险的基础上，重点挖掘并捕捉“专精特新”主题相关的优质证券，力争实现基金资产的长期、稳健增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略和资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×10%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，理论上其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金可投资港股通标的股票，将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。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：东方专精特新混合型发起式证券投资基金

最后运作日：2025 年 12 月 7 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2025 年 12 月 7 日
资 产：	
银行存款	1,456,988.31
结算备付金	49,761.40
存出保证金	18,293.12
交易性金融资产	14,676,348.16
其中：股票投资	13,464,955.07
债券投资	1,211,393.09
应收清算款	2,092,697.38
资产总计	18,294,088.37
负债和所有者权益	最后运作日 2025 年 12 月 7 日
负 债：	
应付赎回款	624,757.83

应付管理人报酬	4,156.78
应付托管费	692.80
应付销售服务费	411.46
其他负债	29,831.71
负债合计	659,850.58
所有者权益：	
实收基金	14,329,177.62
未分配利润	3,305,060.17
所有者权益合计	17,634,237.79
负债和所有者权益总计	18,294,088.37

注：截至基金最后运作日 2025 年 12 月 7 日，东方专精特新混合发起式 A 基金份额净值 1.2347 元，基金份额 11,199,606.42 份；东方专精特新混合发起式 C 基金份额净值 1.2162 元，基金份额 3,129,571.20 份。东方专精特新混合发起式份额总额合计为 14,329,177.62 份。

四、清算报表附注

1、基金基本情况

本基金根据 2022 年 4 月 15 日中国证监会《关于准予东方专精特新混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2022]803 号）的注册，由基金管理人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》自 2022 年 10 月 14 日至 2022 年 12 月 2 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 41,594,442.13 元人民币，业经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）“中喜验字 2022Y00137 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2022 年 12 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 41,607,117.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 12,674.98 份基金份额。本基金基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款）、同业存单、股指期货、国债期货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(但须符合中国证监会相关规定)。

根据东方基金管理股份有限公司于 2025 年 12 月 8 日发布的《关于东方专精特新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》，本基金自 2025 年 12 月 8 日起进入清算程序。

2、清算原因

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”的约定：

“基金合同生效满 3 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，不需召开基金份额持有人大会审议。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

本基金基金合同生效日为 2022 年 12 月 7 日，基金合同生效满 3 年后的对应日为 2025 年 12 月 7 日。截至 2025 年 12 月 7 日日终，基金资产净值低于 2 亿元，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财产清算，不需召开基金份额持有人大会。

3、清算起始日

本基金清算起始日为 2025 年 12 月 8 日。

4、清算报表编制基础

本基金的清算报表系本基金为基金财产清算而向中国证监会备案及公告清算报告之目的而编制。基于此目的，本清算报表系本基金基金财产清算小组在非持续经营基础上，参照《企业会计准则》及其相关规定、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《基金合同》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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自 2025 年 12 月 8 日至 2025 年 12 月 10 日止的清算期间，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：

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”的约定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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。

2、 资产处置情况

（1）本基金最后运作日银行存款为人民币 1,456,988.31 元，其中本金人民币 1,455,933.41 元，应计利息人民币 1,054.90 元。

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币 49,761.40 元，其中本金人民币 49,713.94 元，应计利息人民币 47.46 元。

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币 18,293.12 元，其中本金人民币 18,279.17 元，应计利息人民币 13.95 元。

（4）本基金最后运作日交易性金融资产-股票投资为人民币 13,464,955.07 元，该资产已于 2025 年 12 月 9 日前全部卖出，清算金额为人民币 13,777,076.18 元，已全部划至托管账户。

（5）本基金最后运作日交易性金融资产-债券投资为人民币 1,211,393.09 元，该资产已于 2025 年 12 月 8 日全部卖出，清算金额为人民币 1,211,225.26 元，已全部划至托管账户。

（5）本基金最后运作日证券清算款为人民币 2,092,697.38 元，该款项已于 2025 年 12 月 8 日划至托管账户。

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 624,757.83 元，该款项已于 2025 年 12 月 8 日和 2025 年 12 月 9 日支付。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 4,156.78 元，该款项已于 2025 年 12 月 10 日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币 692.80 元，该款项已于 2025

年 12 月 10 日支付。

（4）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 411.46 元，该款项已于 2025 年 12 月 10 日支付。

（5）本基金最后运作日其他负债为人民币 29,831.71 元，其中应付交易费用为人民币 11,069.28 元，该款项已于 2025 年 12 月 10 日支付；应付赎回费为人民币 79.04 元，该款项已于 2025 年 12 月 8 日和 2025 年 12 月 9 日支付；清算审计费为人民币 18,683.39 元，该款项将于 2025 年 12 月 10 日后支付。

4、清算期间的清算损益情况

金额单位：人民币元

项目	2025 年 12 月 8 日至 2025 年 12 月 10 日
一、清算收益①	305,640.98
1、存款利息收入（注）	199.96
2、投资收益	3,073,767.91
其中：股票投资收益	3,073,915.94
债券投资收益	-148.03
3、公允价值变动收益	-2,768,364.71
4、赎回费归基金资产	37.82
减：二、清算费用②	10,055.00
1、银行划款手续费	55.00
2、清算律师费	10,000.00
三、清算期间净收益 ①- ②	295,585.98

注：利息收入系计提的自 2025 年 12 月 8 日至 2025 年 12 月 10 日清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

金额单位：人民币元

项目	2025 年 12 月 7 日至 2025 年 12 月 10 日
一、最后运作日 2025 年 12 月 7 日基金净资产	17,634,237.79
减：2025 年 12 月 8 日赎回确认金额	660,168.91
加：清算期间净收益	295,585.98
二、2025 年 12 月 10 日基金净资产	17,269,654.86

资产处置及负债清偿后，2025 年 12 月 10 日本基金剩余财产为人民币 17,269,654.86 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，按各类基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。

清算起始日 2025 年 12 月 8 日至清算款划出日前一日产生的相应利息亦属基金份额持有人所有。本基金管理人将于清算款划出日以自有资金划入托管账户用以垫付结算备付金、存出保证金及应计利息等，本基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归本基金管理人所有。

6、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《东方专精特新混合型发起式证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈东方专精特新混合型发起式证券投资基金清算报告〉的法律意见》。

2、存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.orient-fund.com）查阅。

3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及基金托管人住所，供公众查阅、复制。

东方专精特新混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2025 年 12 月 10 日