

中泰中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 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:交通银行股份有限公司

清算报告出具日:2026年4月13日

清算报告公告日:2026年4月21日

§ 1 重要提示

中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金(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[2023]1162号《关于准予中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金注册的批复》准予注册,于2023年8月22日成立并正式运作。

《中泰中证同业存单AAA指数7天持有期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3月26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3月26日,并于2026年3月27日进入基金财产清算程序。

基金管理人、基金托管人、容诚会计师事务所(特殊普通合伙)和北京市通商律师事务所上海分所于2026年3月27日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由容诚会计师事务所(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 | 中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金 |
| 基金简称 | 中泰中证同业存单AAA指数7天持有 |
| 基金主代码 | 018678 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023年8月22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 | 交通银行股份有限公司 |
| 最后运作日（2026年3月26日）基金份额总额 | 5,710,765.25份 |
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | <p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，基金管理人力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年跟踪误差控制在2%以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金预期风险与收益理论上高于货币市场基金，低于股票型基金和偏股混合型基金。 |

| | |
|--|---|
| | 本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。 |
|--|---|

§ 3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2023]1162号《关于准予中泰中证同业存单AAA指数7天持有期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2023年8月22日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,297,041,029.88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3月26日，自2026年3月27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：中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

报告截止日：2026年3月26日

单位：人民币元

| 项目 | 2026年3月26日 (基金最后运作日) |
|------------|-------------------------|
| 资产： | |
| 货币资金 | 337,265.75 |
| 结算备付金 | - |
| 存出保证金 | 32,294.27 |
| 交易性金融资产 | 5,585,751.37 |
| 其中：股票投资 | |
| 债券投资 | 5,585,751.37 |

| | |
|-----------------|---------------------|
| 买入返售金融资产 | |
| 应收证券清算款 | |
| 应收申购款 | |
| 资产总计 | 5,955,311.39 |
| 负债和净资产 | |
| 负债： | |
| 应付证券清算款 | |
| 应付赎回款 | |
| 应付管理人报酬 | 2,118.77 |
| 应付托管费 | 529.71 |
| 应付销售服务费 | 105.93 |
| 应交税费 | |
| 其他负债 | 14,335.78 |
| 负债合计 | 17,090.19 |
| 净资产： | |
| 实收基金 | 5,710,765.25 |
| 未分配利润 | 227,455.95 |
| 净资产合计 | 5,938,221.20 |
| 负债和净资产总计 | 5,955,311.39 |

注：1. 报告截止日2026年3月26日(基金最后运作日)，基金份额总额5,710,765.25份，基金份额净值为1.0398元。

2. 本财务报表已经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师陈熹、罗佳签字出具了容诚专字[2026]200Z0728号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 清算情况

自2026年3月27日至2026年4月13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3月27日(清算开始日)本基金进入清算程序起至2026年4月13日(清算结束日)止期间，本基金由银行存款、存出保证金产生的利息收入归基金份额持有人所有。其中，银行存款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 3 月 26 日（基金最后运作日）持有的交易性金融资产 5,585,751.37 元，截至 2026 年 4 月 13 日（清算结束日）已全部变现。

5.1.3 本基金于 2026 年 3 月 26 日（基金最后运作日）的应付管理人报酬为 2,118.77 元，截至 2026 年 4 月 13 日（清算结束日），该款项已支付。

5.1.4 本基金于 2026 年 3 月 26 日（基金最后运作日）的应付托管费为 529.71 元，截至 2026 年 4 月 13 日（清算结束日），该款项已支付。

5.1.5 本基金于 2026 年 3 月 26 日（基金最后运作日）的应付销售服务费为 105.93 元，截至 2026 年 4 月 13 日（清算结束日），该款项已支付。

5.1.6 本基金于 2026 年 3 月 26 日（基金最后运作日）的其他负债为 14,335.78 元，包括应付交易费用 3,871.28 元、其他应付款 300.00 元、预提审计费 1,164.50 元和账户维护费 9,000.00 元，截至 2026 年 4 月 13 日（清算结束日），上述款项均已支付。

5.2 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 2026 年 3 月 27 日(清算开始日)至 2026 年 4 月 13 日(清算结束日)止期间 |
|----------------------|---|
| 一、收入 | 1,318.39 |
| 1、利息收入 | 1,192.10 |
| 2、投资收益(损失以“-”填列) | 1,216.38 |
| 3、公允价值变动损益(损失以“-”填列) | -1,090.09 |
| 减：二、费用 | - |
| 三、利润总额 | 1,318.39 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净收益 | 1,318.39 |

注：1. 利息收入系以当前适用的利率计提的自 2026 年 3 月 27 日（清算开始日）至 2026 年 4 月 13 日（清算结束日）止清算期间的利息收入，为银行存款和存出保证金利息收入。

2. 投资收益系清算期间债券利息收入、债券产生的差价收入。

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。

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 3 月 26 日（基金最后运作日）基金净资产 | 5,938,221.20 |
| 加：清算期间净收益 | 1,318.39 |
| 减：清算期间确认的赎回导致的基金净资产变动 | 2,367,797.04 |
| 二、2026 年 4 月 13 日(清算结束日)基金净资产 | 3,571,742.55 |

注：本基金最后运作日为2026年3月26日，最后运作日交易申请的确认日为2026年3月27日。

截至本次清算期结束日 2026 年 4 月 13 日，本基金剩余财产 3,571,742.55 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。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分配。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金清算财务报告及审计报告；
- 2、关于《中泰中证同业存单AAA指数7天持有期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

中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

基金财产清算小组

2026年4月13日