

# 渤海汇金优选平衡一年持有期混合型 发起式基金中基金（FOF）清算报告

基金管理人：渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

清算报告出具日：2026年6月26日

清算报告公告日：2026年7月6日

## § 1 重要提示

渤海汇金优选平衡一年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〔2023〕864号《关于准予渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册。经向中国证监会备案，《渤海汇金优选平衡一年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》”或“基金合同”）于2023年6月12日正式生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规规定及《基金合同》约定，《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延续基金合同期限。

本基金《基金合同》生效日为2023年6月12日，《基金合同》生效之日起三年后的对应日为2026年6月12日。截至2026年6月12日，本基金的基金资产净值低于2亿元，已触发上述《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，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人于2026年6月12日披露了《关于渤海汇金优选平衡一年持有期混合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》。

本基金自2026年6月13日起进入清算期，由基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司、基金托管人宁波银行股份有限公司、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组成了基金财产清算小组，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。

## § 2 基金概况

基金简称	渤海汇金优选平衡一年持有混合发起(FOF)
基金主代码	018498
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年06月12日

基金最后运作日(2026年6月12日) 基金份额总额	10,475,946.61份
投资目标	在严格控制组合风险的前提下,灵活投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产,追求超越基金业绩比较基准的资产长期稳健增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金主要对国内外宏观经济环境、经济周期所处阶段、财政货币政策形势、证券市场走势、市场流动性等因素进行综合分析,判断各大类资产(如权益类、固定收益类、商品类)的中长期风险-收益特征和相对投资价值,结合本基金的投资目标、投资理念和风险控制要求,确定大类资产的中长期配置权重及调整区间。本基金将紧密跟踪市场环境的变化,结合组合绩效归因分析,对资产配置进行适时调整和优化。</p> <p>(二) 基金投资策略</p> <p>基金投资策略分为权益类基金投资策略和固定收益类基金投资策略。</p> <p>1、权益类基金投资策略</p> <p>权益类基金包含主动型基金和指数型基金,前者包括股票型基金和混合型基金;后者包含普通指数型基金、增强指数型基金和ETF。指数型权益类基金具有低成本优势,本基金对指数型基金的选择主要从标的基金所跟踪指数的走势研判及特征、跟踪误差、基金规模和流动性四方面来考量。主动型权益类基金的投资,主要运用多维度的基金评价分析方法,精选中长期业绩优秀且具有持续性、投资风格稳定的基金进行投资。</p> <p>定性分析方面通过对基金经理访谈或调研的方式进行,主要从基金产品、投资流程、基金管理团队、风险控制等维度进行评价。</p> <p>定量分析方面包括:</p> <p>(1) 业绩分析: 主要包括收益、风险、收益风险比等。</p> <p>(2) 归因分析: 主要包括择时能力、行业配置能力、选股能力等。</p> <p>(3) 持仓分析: 在行业配置层面,主要观察行业集中度、行业偏离度、行业轮换度等指标。</p> <p>(4) 风险控制能力: 主要考察下行标准差、区间最大回撤、信息比率等指标。</p> <p>2、固定收益类基金投资策略</p> <p>固定收益类基金的选择包括定性分析和定量分析两个维度。定性分析方面通过对基金经理访谈或调研的方式进行,主要从基金产品、投资流程、基金管理团队、风险控制等维度进行评价。而定量分析方面,除了分析基金的长中短期投资业绩、收益率波动性、最大回撤、风险调整后收益等指标外,还将分析标的基金的久期、投资杠杆和信用债的投资比例及结构,结合市场利率、收益率曲线和信用利差变动趋势的判断,分析组合的久期、杠杆水平以及信用风险暴露度。</p>

	<p>（三）股票投资策略</p> <p>本基金在行业分析的基础上,会更加侧重用自下而上的方法精选个股。通过对上市公司的深度调研和分析,理清发展脉络,发现成长价值,在注重安全边际的基础上挑选具有长期竞争力的优质公司,通过股票池分级管理,精选核心投资标的。重点在于以下几个方面:</p> <p>1、定性分析:包括企业核心竞争优势、公司治理结构、管理层战略规划能力和经营团队管理能力等方面。</p> <p>2、定量分析:包括财务分析、市场占有率、盈利能力和成长能力等。主要参考业务收入增长率、利润增长率、净资产收益率(ROE)、毛利率等成长和盈利性指标。</p> <p>3、纵向比较:研究行业发展历史和公司发展历史,从而判断公司未来的发展前景。</p> <p>4、横向比较:对所研究上市公司的竞争对手、上下游关系进行比较分析,从而判断投资标的的价值。</p> <p>（四）债券投资策略</p> <p>本基金在保障流动性的基础上,有效利用基金资产进行债券投资,以提高基金资产的投资收益。本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略,构建债券投资组合。</p> <p>可转换债券和可交换债券同时具有债券与权益类证券的双重特性。本基金利用可转换债券及可交换债券的债券底价和到期收益率、信用风险来判断其债性,增强本金投资的安全性;利用可转换债券和可交换债券转股溢价率、基础股票基本面趋势和估值来判断其股性,在市场出现投资机会时,优先选择股性强的品种。</p> <p>综合选择安全边际较高、基础股票基本面优良的品种进行投资,获取超额收益。</p> <p>同时,关注可转债和可交换债流动性、条款博弈、可转债套利等影响转债及可交换债投资的其他因素。</p> <p>（五）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济等多个因素的研究预测资产池未来现金流变化,并通过研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时在严格控制风险的情况下,综合运用多个策略和研究方法,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。</p>	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+中债-综合全价(总值)指数收益率*40%	
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,其预期风险和预期收益高于债券型基金中基金和货币型基金中基金,低于股票型基金中基金。	
基金管理人	渤海汇金证券资产管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	渤海汇金优选平衡一年持有混合发起(FOF)A	渤海汇金优选平衡一年持有混合发起(FOF)C

下属分级基金的交易代码	018498	018499
基金最后运作日(2026年6月12日)	10,421,399.07份	54,547.54份
下属分级基金的份额总额		

### § 3 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可〔2023〕864号《关于准予渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》准予注册，由渤海汇金证券资产管理有限公司管理，并依照法律法规、《基金合同》等规定自2023年5月18日至2023年6月8日公开募集。《基金合同》于2023年6月12日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额（含利息结转份额）总额为19,672,270.01份。

自2023年6月12日至2026年6月12日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《基金合同》等有关规定，基金管理人于2026年6月12日披露了《关于渤海汇金优选平衡一年持有期混合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》。本基金最后运作日为2026年6月12日，自2026年6月13日起，本基金进入基金财产清算程序。

### § 4 财务会计报告

#### 4.1 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2026年6月12日

单位：人民币元

	最后运作日 2026年6月12日
<b>资产：</b>	
货币资金	1,232,340.16
交易性金融资产	9,306,503.65
其中：债券投资	606,534.41

基金投资	8,699,969.24
应收清算款	51,300.00
<b>资产总计</b>	<b>10,590,143.81</b>
<b>负债和净资产</b>	
<b>负债:</b>	
应付管理人报酬	3,471.60
应付托管费	347.17
应付销售服务费	10.65
应交税费	0.74
其他负债	5,000.00
<b>负债合计</b>	<b>8,830.16</b>
<b>净资产:</b>	
实收基金	10,475,946.61
未分配利润	105,367.04
<b>净资产合计</b>	<b>10,581,313.65</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>10,590,143.81</b>

注：截至最后运作日 2026 年 6 月 12 日，渤海汇金优选平衡（FOF）A 基金份额净值 1.0102 元，基金份额总额 10,421,399.07 份；渤海汇金优选平衡（FOF）C 基金份额净值 0.9921 元，基金份额总额 54,547.54 份。渤海汇金优选平衡（FOF）基金份额总额合计为 10,475,946.61 份。

## § 5 清算情况

清算期间自 2026 年 6 月 13 日至 2026 年 6 月 26 日止，本基金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。基金资产处置、负债清偿及清算期间的清算损益情况如下：

### 5.1 清算费用

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。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

## 5.2 资产处置情况

- 5.2.1 本基金最后运作日货币资金为人民币 1,232,340.16 元，其中存放于渤海证券股份有限公司证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金为人民币 649,236.69 元，对应应计利息为 256.01 元，上述货币资金在清算期间已完成结息并划转至银行托管户；存放于托管人宁波银行股份有限公司的资金为人民币 582,816.89 元，对应应计利息为 30.57 元。
- 5.2.2 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 9,306,503.65 元，其中债券投资 606,534.41 元，基金投资 8,699,969.24 元，已于清算期全部变现。
- 5.2.3 本基金最后运作日应收清算款为人民币 51,300.00 元，全部为场外基金赎回款，已于清算期全部到账。

## 5.3 负债清偿情况

- 5.3.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,471.60 元，该款项已于 2026 年 6 月 16 日支付。
- 5.3.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 347.17 元，该款项已于 2026 年 6 月 16 日支付。
- 5.3.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 10.65 元，该款项已于 2026 年 6 月 16 日支付。
- 5.3.4 本基金最后运作日应交税费为人民币 0.74 元，该款项已于 2026 年 6 月 18 日支付。
- 5.3.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 5,000.00 元，为审计费，该款项已于 2026 年 6 月 16 日支付。

## 5.4 清算期间的损益情况

单位：人民币元

项目	金额
一、清算期间收益	13,135.95
1、利息收入（注 1）	1,193.45
2、投资收益（注 2）	-186,735.05
3、公允价值变动损益	198,677.55
二、清算期间费用	10,000.12
1、律师费	10,000.00
2、税金及附加	0.12
三、清算期间净收益	3,135.83

注：1) 利息收入为自 2026 年 6 月 13 日至 2026 年 6 月 26 日止清算期间的货币资金利息收入。

2) 投资收益为自 2026 年 6 月 13 日至 2026 年 6 月 26 日止清算期间的债券及基金变现收益。

## 5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2026 年 6 月 12 日基金净资产	10,581,313.65
加：清算期间净收益	3,135.83
二、清算结束日 2026 年 6 月 26 日基金净资产	10,584,449.48

资产处置及负债清偿后，本基金 2026 年 6 月 26 日归属于剩余基金份额持有人的基金净资产为人民币 10,584,449.48 元，其中剩余未到账资产为人民币 198.63 元，均为货币资金应计利息。支付清算款之日前未到账的部分，将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

自清算期结束日次日（2026 年 6 月 27 日）至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的货币资金孳生的利息归基金份额持有人所有，最终支付清算款金额以本基金登记机构的记录为准。基金管理人垫付的资金自资金到账日起至托管账户销户为止孳生的利息归基金管理人所有，在托管账户销户前向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

## 5.6 基金财产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，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。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 备查文件目录

### 6.1 备查文件目录

- 1、《渤海汇金优选平衡一年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、《上海市通力律师事务所关于〈渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算报告〉的法律意见》

### 6.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

### 6.3 查阅方式

上述文件可在营业时间内到渤海汇金证券资产管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

渤海汇金优选平衡一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金财产清算小组

2026年6月26日