

兴华智选成长 3 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：兴华基金管理有限公司

基金托管人：青岛银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二六年七月六日

报告公告日期：二〇二六年七月十日

1、重要提示

1.1 重要提示

兴华智选成长 3 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”）2024 年 12 月 9 日证监许可[2024]1776 号文准予注册，基金管理人为兴华基金管理有限公司，基金托管人为青岛银行股份有限公司。

根据《兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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”之“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；……”。本基金基金管理人经与基金托管人青岛银行股份有限公司协商一致，以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2026 年 6 月 15 日计票表决并通过了《关于终止兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同有关事项的议案》，基金管理人于 2026 年 6 月 16 日在规定媒介就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告，详见《兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金自 2026 年 06 月 17 日起进入清算程序。本基金基金管理人、基金托管人、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）、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，并由容诚会计师事务所（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

2.1 基金基本情况

| | | |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 基金简称 | 兴华智选成长三个月持有混合发起（FOF） | |
| 基金主代码 | 023007 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2024年12月26日 | |
| 2026年6月16日日终基金份额总额 | 32,625,244.01份 | |
| 基金管理人 | 兴华基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 青岛银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 兴华智选成长三个月持有混合发起（FOF）A | 兴华智选成长三个月持有混合发起（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 023007 | 023008 |
| 2026年6月16日日终下属分级基金的份额总额 | 19,954,205.41份 | 12,671,038.60份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置策略和公募基金精选策略，寻求基金资产的长期稳健增值。 |
| 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、存托凭证投资策略；5、港股通标的股票投资策略；6、债券投资策略；7、资产支持证券投资策略。 今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×70%+中债综合全价(总值)指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。 |

3、基金运作情况说明

3.1 基金基本情况

兴华智选成长 3 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[2024]1776 号《关于准予兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)注册的批复》准予注册,由兴华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华智选成长 3 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。本基金为混合型基金中基金(FOF),存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,278,852.04 元,业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2024]200Z0083 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》于 2024 年 12 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,279,190.05 份基金份额,其中认购资金利息折合 338.01 份基金份额。本基金的基金管理人为兴华基金管理有限公司,基金托管人为青岛银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,333.37 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》和《兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书》的规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费、赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为依法发行或上市的基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额(含 QDII 基金、香港互认基金、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)、公开募集基础设施证券投资基金)、股票(包含主板、创业

板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证及港股通标的股票)、债券(包括国内依法发行的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具,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的相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金 80%以上基金资产投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额。本基金投资于股票(含存托凭证)、股票型基金、混合型基金(指基金合同中约定股票投资占基金资产的比例为 60%以上或者最近四个季度披露的股票投资占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金)的比例为 60%-95%,本基金投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。本基金投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例不超过基金资产的 20%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率×70%+中债综合全价(总值)指数收益率×30%。

3.2 清算原因

根据《兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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”之“二、《基金合同》的终止事由”的约定:“有下列情形之一的,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的;……”。本基金基金管理人经与基金托管人青岛银行股份有限公司协商一致,以通讯方式召开了基金份额持有人大会,并于 2026 年 6 月 15 日计票表决并通过了《关于终止兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同有关事项的议案》,基金管理人于 2026 年 6 月 16 日在规定媒介就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告,详见《兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

3.3 清算起始日

根据《兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金于 2026 年 6 月 17 日起进入清算程序。

4、财务报告

4.1 资产负债表(已经审计)

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：兴华智选成长3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2026年6月16日

单位：人民币元

| 资产 | 2026年6月16日 (基金最后运作日) |
|-------------------|-------------------------|
| 资产： | |
| 货币资金 | 4,837,894.93 |
| 交易性金融资产 | 31,847,314.12 |
| 其中：基金投资 | 31,847,314.12 |
| 应收股利 | 5,145.69 |
| 资产总计 | 36,690,354.74 |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | 109,283.32 |
| 应付管理人报酬 | 17,259.59 |
| 应付托管费 | 2,588.94 |
| 应付销售服务费 | 2,689.82 |
| 其他负债 | 63,688.40 |
| 负债合计 | 195,510.07 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 32,625,244.01 |
| 未分配利润 | 3,869,600.66 |
| 所有者权益合计 | 36,494,844.67 |
| 负债和所有者权益总计 | 36,690,354.74 |

注：1. 报告截止日 2026 年 6 月 16 日(基金最后运作日)，基金份额总额 32,625,244.01 份。

其中兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）A 类基金份额净值 1.1211 元，基金份额总额 19,954,205.41 份；兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）C 类基金份额净值 1.1147 元，基金份额总额 12,671,038.60 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《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了供兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）全体基金份额持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。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。

5、清算情况

5.1 资产负债清算情况

自 2026 年 6 月 17 日至 2026 年 7 月 6 日止，兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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。各项资产负债清算情况如下：

5.1.1 资产处置情况

1、本基金最后运作日货币资金人民币 4,837,894.93 元，银行存款及其应计利息总和为人民币 4,837,894.04 元，其中托管户存款为 4,834,132.12 元，应计银行存款利息 3,761.92 元。应计利息将于结息或者销户时收到。存出保证金及其应计利息总和为人民币 0.89 元，其中第一创业证券存出保证金本金 0.00 元；应计第一创业证券券商保证金利息 0.89 元，应计利息将于结息或者销户时收到。

2、本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 31,847,314.12 元，应收股利为人民币 5,145.69 元，都已于清算期全部变现，相关证券清算款已划入托管户。

5.1.2 负债的清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 109,283.32 元，截至 2026 年 6 月 24 日该款项已全部支付。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 17,259.59 元，该费用预计于 2026 年 7 月 10 日扣除。

3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,588.94 元，该费用预计于 2026 年 7 月 10 日扣除。

4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 2,689.82 元，该费用预计于 2026 年 7 月 10 日扣除。

5、本基金最后运作日其他负债为人民币 63,688.40 元，由预提审计费人民币 2,745.48 元、预提信息披露费 22,877.33 元、律师费 30,000.00 元、持有人大会公证费 8,000.00 元、应付赎回费 65.59 元构成。上述费用预计于 2026 年 7 月 10 日扣除。

5.2 清算损益表

| 项目 | 2026年6月17日至2026年7月6日 |
|---------------------|----------------------|
| 一、清算收益 | -58,846.39 |
| 1. 利息收入（注1） | 5,457.14 |
| 2. 投资收益（注2） | -815,042.93 |
| 3. 公允价值变动损益（注3） | 750,435.20 |
| 4. 其他收入（注4） | 304.20 |
| 二、清算费用 | 762.00 |
| 1. 交易费用 | 762.00 |
| 三、清算收益（损失）总额 | -59,608.39 |

注：1. 利息收入系计提的自2026年6月17日至2026年7月6日止期间的银行存款利息收入。

2. 投资收益主要包括自2026年6月17日至2026年7月6日止期间的基金差价收入、基金红利收入。

3. 公允价值变动损益系自2026年6月17日至2026年7月6日止期间基金投资的估值增值及其终止确认时的公允价值变动损益转出。

4. 其他收入系自2026年6月17日至2026年7月6日止期间，因投资者赎回确认而产生的归属于本基金的赎回费收入。

5.3 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排

| 项目 | 金额 |
|-------------------------------|----------------------|
| 一、最后运作日2026年6月16日基金净资产 | 36,494,844.67 |
| 加：清算期间净收益 | -59,608.39 |
| 减：期间确认的赎回金额 | 894,929.83 |
| 二、2026年7月6日基金净资产 | 35,540,306.45 |

截至本次清算期结束日2026年7月6日，本基金剩余财产为人民币35,540,306.45元。

自本次清算期结束日次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。为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金对未到账的应收利息进行垫付。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 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

6.1.1 兴华智选成长 3 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

6.1.2 关于《兴华智选成长 3 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

6.2 存放地点

基金管理人处

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

兴华智选成长 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金财产清算小组

二〇二六年七月六日