

大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型 发起式基金中基金（FOF） 清算报告

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2026 年 8 月 21 日

清算报告公告日：2026 年 8 月 21 日

一、重要提示

大成颐禧积极养老目标五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[2022]2301号《关于准予大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》注册，由大成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《大成颐禧积极养老目标五年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。于2023年6月29日成立并正式运作，本基金的基金管理人为大成基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”、“我司”或“公司”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

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》、《大成颐禧积极养老目标五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》”）的有关规定，本基金已触发基金合同终止情形，基金管理人应当在上述终止情形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。根据《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”的约定：“基金合同生效之日起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，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29日，基金合同生效之日起满三年后的对应日为2026年6月29日。截至2026年6月29日日终，本基金的基金规模低于2亿元人民币，触发《基金合同》约定的前述终止条件，因此本基金根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序，而不需召开基金份额持有人大会。

本基金自2026年6月30日起进入清算期，由基金管理人大成基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2026年6月30日成立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，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称	大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	大成颐禧积极养老目标五年持有混合发起式（FOF）
基金主代码	017768

交易代码	017768
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 6 月 29 日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
最后运作日 (2026 年 6 月 29 日) 基金份额总额	10,197,849.57 份

2、基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金运用动态资产配置策略，以定量和定性相结合的方法，通过积极主动的投资管理追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*65%+恒生指数收益率*3%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*3%+中债-综合全价(总值)指数收益率*24%+活期存款基准利率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，是目标风险型基金，且投资风格为积极型，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、货币市场基金中基金、债券型基金及债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金若投资港股通标的股票，则需承担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(已经审计)

会计主体：大成颐禧积极养老目标五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 29 日（最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2026 年 6 月 29 日
资 产:	
银行存款	404,925.68
结算备付金	17,885.35
存出保证金	3,312.57
交易性金融资产	14,987,867.61
其中：股票投资	1,985,957.00
基金投资	12,396,169.35
债券投资	605,741.26
应收清算款	10,220.04
应收股利	14.64
其他资产	1,580.04
资产总计	15,425,805.93
负债和净资产	最后运作日 2026 年 6 月 29 日
负 债:	
应付管理人报酬	6,514.64
应付托管费	2,278.91

应交税费	9.42
其他负债	8,281.32
负债合计	17,084.29
净资产：	
实收基金	10,197,849.57
未分配利润	5,210,872.07
净资产合计	15,408,721.64
负债和净资产总计	15,425,805.93

注：1、基金最后运作日 2026 年 6 月 29 日，大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）份额单位净值为 1.5110 元，份额为 10,197,849.57 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《资产管理产品相关会计处理规定》的有关规定编制的。

四、基金财产分配

自 2026 年 6 月 30 日至 2026 年 8 月 19 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：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 404,925.68 元，其中：银行托管户余额 404,893.66 元，应计利息 32.02 元。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 17,885.35 元，其中：深交所最低备付金余额 16,817.57 元，深交所最低备付金应计利息 1.44 元，上交所最低备付金余额 1,066.25 元，上交所最低备付金应计利息 0.09 元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 3,312.57 元，其中：深交所交易保证金账户余额 1,763.38 元，深交所交易保证金应计利息 0.18 元，上交所交易保证金账户余额 1,548.83 元，上交所交易保证金应计利息 0.18 元。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 14,987,867.61 元，其中：基金投资为人民币 12,396,169.35 元，股票投资为人民币 1,985,957.00 元，债券投资为人民币 605,741.26 元。该交易性金融资产已于清算期间全部处置变现。

(5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 10,220.04 元，已于 2026 年 6 月 30 日划入本基金托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收股利为人民币 14.64 元，已于 2026 年 6 月 30 日全部收回。

(7) 本基金最后运作日其他资产为人民币 1,580.04 元，为销售服务费返还收入，该款项已于 2026 年 7 月 14 日划入本基金托管账户。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 6,514.64 元, 该款项将于清算期间结束后支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,278.91 元, 该款项将于清算期间结束后支付。

(3) 本基金最后运作日应交税费为人民币 9.42 元, 该款项已于清算期间支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 8,281.32 元, 其中: 应付交易费用为人民币 5,271.32 元, 应付银行划款手续费为人民币 10.00 元, 应付审计费为人民币 3,000.00 元。应付审计费将于清算期间结束后支付, 其余款项已于清算期间支付。

3、清算期间损益情况

单位: 人民币元

清算期间损益情况	
项目	
一、清算期间收入 (损失以“-”填列)	
利息收入	2,894.99
其中: 存款利息收入 (注)	2,894.99
投资收益	-51,565.67
其中: 股票投资收益	-359,842.19
基金投资收益	292,467.51
债券投资收益	1,056.22
股利收益	14,752.79
公允价值变动收益	-2,926,346.16
其他业务收入 (注)	1,409.62
清算期间收入小计①	-2,973,607.22
二、清算期间费用	
税金及附加	679.63
其他费用	40.00
银行划款手续费 (注)	40.00
清算期间费用小计②	719.63
三、清算期间净收益①-②	-2,974,326.85

注: 1、利息收入系计提的自 2026 年 6 月 30 日起至 2026 年 8 月 19 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息以及申购款利息。

2、其他业务收入系销售服务费返还。

4、资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

单位: 人民币元

项目	
一、最后运作日 (2026 年 6 月 29 日) 基金净资产	15,408,721.64
加: 清算期间净收益	-2,974,326.85
二、清算期结束日 (2026 年 8 月 19 日) 基金净资产	12,434,394.79

注: 1、资产处置及负债清偿后, 于 2026 年 8 月 19 日本基金剩余财产为人民币 12,434,394.79 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。

2、2026 年 8 月 19 日至清算款划出日前一日的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有, 以上利息均按实际适用的利率计算。基金管理人垫付的资金 (如有) 以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5、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, 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。

五、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算审计报告》
- (2) 《关于大成颐禧积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的住所。

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。

大成颐禧积极养老目标五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 8 月 21 日