中欧互通精选混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告出具日期：2026 年 10 月 20 日

报告公告日期：2026 年 11 月 3 日

一、重要提示

中欧互通精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）经 2018 年 7 月 12 日证监许可【2018】1103 号文批准变更注册而来。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《中欧互通精选混合型证券投资基金基金合同》“第四部分 基金的历史沿革与存续”之“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额”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 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现上述情形的，本基金将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

截至 2026 年 9 月 29 日日终，本基金连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，本基金将根据基金合同约定进行基金财产清算并终止，无须召开基金份额持有人大会进行表决。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见基金管理人于 2026 年 9 月 30 日发布的《中欧基金管理有限公司关于中欧互通精选混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金于 2026 年 9 月 30 日进入清算程序，由本基金管理人中欧基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（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，

并由安永华明会计师事务所（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、基金概况

1、基金名称：中欧互通精选混合型证券投资基金

2、基金简称：中欧互通精选混合

3、基金代码：A 类基金份额 166007，E 类基金份额 001884

4、基金运作方式：契约型、开放式

5、基金合同生效日：2018 年 10 月 8 日

6、基金最后运作日：2026 年 9 月 29 日。基金份额总额 20,738,723.64 份

7、投资目标：在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。

8、业绩比较基准：MSCI 中国 A 股国际通指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

9、风险收益特征：本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，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。

10、基金管理人：中欧基金管理有限公司

11、基金托管人：兴业银行股份有限公司

三、基金最后运作日财务会计报告（经审计）

1、资产负债表

会计主体：中欧互通精选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 09 月 29 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2026 年 9 月 29 日
资 产：	
货币资金	2,071,275.78
结算备付金	889,496.90

存出保证金	12,945.67
交易性金融资产	27,345,203.54
其中：股票投资	26,134,855.27
债券投资	1,210,348.27
应收证券清算款	13,000,673.88
应收申购款	4,408.09
资产合计	43,324,003.86
负 债：	
卖出回购金融资产款	900,036.48
应付证券清算款	0.09
应付赎回款	173.85
应付管理人报酬	43,635.71
应付托管费	7,272.61
应交税费	46.62
其他负债	94,629.80
负债合计	1,045,795.16
净资产：	
实收基金	20,738,723.64
未分配利润	21,539,485.06
净资产合计	42,278,208.70
负债和净资产合计	43,324,003.86

四、清盘事项说明

1、清算原因

根据《基金合同》“第四部分基金的历史沿革与存续”之“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额”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 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现上述情形的，本基金将根据基金合同第十八部分的约定进行基金财产清算并终止，而无须召开基金份额持有人大会。”

截至 2026 年 9 月 29 日日终，本基金连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，本基金将根据基金合同约定进行基金财产清算并终止，无须召开基金份额持有人大会进行表决。

基金管理人于 2026 年 9 月 30 日公告的《中欧基金管理有限公司关于中欧互通精选混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》约定：“本基

金已于 2026 年 9 月 29 日（含）起，暂停本基金的申购、转换转入、定期定额投资业务。本基金最后运作日为 2026 年 9 月 29 日，自 2026 年 9 月 30 日（含）起，本基金进入清算程序，停止办理申购、赎回、定期定额投资、转换等业务，并且之后不再恢复，敬请投资者注意。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费、基金托管费。”

2、清算起始日

本基金于 2026 年 9 月 30 日起进入清算期，故本基金清算起始日为 2026 年 9 月 30 日。

3、清算报表编制基础

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。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，本清算报表无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自 2026 年 9 月 30 日至 2026 年 10 月 9 日清算期间，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

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，根据基金合同的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产清算情况

(1) 本基金最后运作日货币资金为人民币2,071,275.78元，其中托管户存款为人民币2,071,111.72元；应计银行存款利息为人民币164.06元，应计银行存款利息将于本次清算期结束后划付。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币889,496.90元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金存款为人民币192,752.41元，存放于中信期货有限公司的结算备付金存款为人民币696,484.65元；应计结算备付金利息为人民币259.84元，应计结算备付金利息将于本次清算期结束后划付。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币12,945.67元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金为人民币12,944.59元；应计存出保证

金利息为人民币1.08元，应计存出保证金利息将于本次清算期结束后划付。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币27,345,203.54元，其中股票投资为人民币26,134,855.27元，债券投资为人民币1,210,348.27元，于清算期间进行处置变现。变现产生的证券清算款为人民币27,024,681.81元，截至本清算报告出具日已全部划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币13,000,673.88元,该部分款项已于本次清算期间划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收申购款为人民币4,408.09元,该部分款项已于本次清算期间划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日卖出回购金融资产款为人民币900,036.48元，该款项已于2026年10月9日支付。

(2) 本基金最后运作日应付证券清算款为人民币0.09元，该款项已于2026年9月30日支付。

(3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币173.85元，该款项已于2026年9月30日支付。

(4) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币43,635.71元，该款项已于2026年10月9日支付。

(5) 本基金最后运作日应付托管费为人民币7,272.61元，该款项已于2026年10月9日支付。

(6) 本基金最后运作日应交税费为人民币46.62元，该款项将于本次清算期后支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债为人民币94,629.80元，其中预提审计费为人民币20,076.43元，该款项将于本次清算期后支付；预提信息披露费为人民币50,192.22元，该款项将于本次清算期后支付；应付交易费用为人民币19,453.24元，该款项将于本次清算期后支付；其他应付款为人民币4,907.69元，于清算期间转为其他收入；应付赎回费为人民币0.22元，该款项已于2026年9月30日支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2026年9月30日 至2026年10月9日

	止清算期间
一、收益	
1、利息收入（注1）	1,707.49
2、公允价值变动损益（注2）	1,282,488.66
3、投资收益（注3）	-1,616,984.78
4、其他收入（注4）	8,742.66
收益小计	-324,045.97
二、费用	
1、其他费用（注5）	9,641.35
2、税金及附加	1.28
3、利息支出	328.27
费用小计	9,970.90
三、清算期间净收益	-334,016.87

注1：利息收入系自2026年9月30日至2026年10月9日止清算期间计提的银行存款利息收入、结算备付金利息收入及存出保证金利息收入。

注2：公允价值变动损益系自2026年9月30日至2026年10月9日止清算期间因持有股票产生的公允价值变动以及股票交易和债券交易时发生的损益结转。

注3：投资收益系自2026年9月30日至2026年10月9日止清算期间因持有股票产生的红利收入和红利补税、因持有债券产生的利息收入，以及因股票交易和债券交易产生的差价收入。

注4：其他收入系自2026年9月30日至2026年10月9日止清算期间无需支付的费用转入其他收入产生，以及归入基金资产的赎回费和补差费收入。

注5：其他费用系自2026年9月30日至2026年10月9日止清算期间的汇划费用、证券组合费和律师费。

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9月29日基金净资产	42,278,208.70
加：清算期间净收益	-334,016.87
减：清算期间支付赎回款	6,529,069.20
二、2026年10月9日基金净资产	35,415,122.63

资产处置及负债清偿后，于2026年10月9日，本基金剩余财产为人民币35,415,122.63元，根据本基金的基金合同及《中欧基金管理有限公司关于中欧互通精选混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》的约定，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。

自本次清算起始日2026年9月30日至清算款划出日前一日产生的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息归基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。银行存款、结算备付金、存出保证金利息将由基金管理人以自有资金垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担，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。

6、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。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

（1）《中欧互通精选混合型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《中欧互通精选混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

本基金管理人中欧基金管理有限公司办公地点——中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8 层、10 层、16 层。

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。

中欧互通精选混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二六年十月二十日