中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）
清算报告

1、重要提示

中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）由信诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）更名而来，信诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）由信诚新机遇股票型证券投资基金（LOF）变更而来。信诚新机遇股票型证券投资基金（LOF）经2011年5月30日中国证监会证监许可[2011]819号文件核准募集，《信诚新机遇股票型证券投资基金（LOF）基金合同》于2011年8月1日生效。

鉴于市场环境的变化，为保护基金份额持有人利益，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》的有关规定和《基金合同》的约定，本基金基金管理人以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于终止中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告详见2026年10月21日刊登在《证券时报》、基金管理人网站（www.citicprufunds.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）上的《中信保诚基金管理有限公司关于中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金基金管理人按照《基金合同》的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的基金最后运作日定为2026年10月27日，并于2026年10月28日进入清算期。

本基金基金管理人中信保诚基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2026年10月28日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计、上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	中信保诚新机遇混合（LOF）
基金主代码	165512
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 1 日
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力求前瞻性地把握中国经济发展过程中涌现的新机遇，精选受益其中的优势行业和个股，在严格控制风险并充分保证流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	1.资产配置策略；2.股票投资策略；1）新机遇挖掘；2）行业的新机遇受益状况分析；3）个股精选；3.债券投资策略：（1）久期控制策略；（2）类属策略；（3）收益率曲线配置策略；（4）回购套利；4.权证投资策略；5.股指期货投资策略；6.存托凭证投资策略。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。

3、基金运作情况概述

信诚新机遇股票型证券投资基金（LOF）经中国证监会证监许可[2011]819 号文核准募集，自 2011 年 6 月 29 日起至 2011 年 7 月 26 日止通过各销售机构向社会公开募集。

经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的净认购金额为 424,082,517.13 元人民币，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计 141,584.00 元人民币。上述资金已于 2011 年 8 月 1 日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为 6,592 户。按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，募集发售期募集的有效份额为 424,082,517.13 份基金份额，利息结转

的基金份额为141,584.00份基金份额。两项合计共424,224,101.13份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

《信诚新机遇股票型证券投资基金（LOF）基金合同》于2011年8月1日生效。

鉴于市场环境的变化，为保护基金份额持有人利益，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》的有关规定和《基金合同》的约定，本基金基金管理人以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于终止中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》。本基金的基金最后运作日定为2026年10月27日，并于2026年10月28日进入清算期。

4、财务会计报告

4.1 资产负债表（已经审计）

单位：人民币元

资 产	2026年10月27日 基金最后运作日
资 产：	
货币资金	9,887,141.25
结算备付金	38,835.80
存出保证金	1,973.18
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
理财产品投资	-
结构性票据投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-

应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	9,927,950.23
负债和净资产	**2026 年 10 月 27 日** **基金最后运作日**
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	999.53
应付赎回款	169,224.89
应付管理人报酬	12,088.82
应付托管费	2,014.82
应付销售服务费	-
应付投资顾问费	-
应交税费	0.99
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	9,050.24
负债合计	193,379.29
净资产：	
实收基金	7,621,741.23
其他综合收益	0.00
未分配利润	2,112,829.71
净资产合计	9,734,570.94
负债和净资产总计	9,927,950.23

5、基金财产分配

本基金自 2026 年 10 月 28 日起进入清算程序，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 清算费用

本基金清算期间（自 2026 年 10 月 28 日起至 2026 年 10 月 30 日止）未产生清算费用。

5.2 资产处置情况

(1)本基金最后运作日货币资金及应计利息为人民币 9,887,141.25 元，其中本金为人民币 9,885,592.33 元，应计利息为人民币 1,548.92 元。

(2)本基金最后运作日结算备付金及应计利息人民币 38,835.80 元，其中本金为人民币 38,828.36 元，应计利息为人民币 7.44 元；存出保证金及应计利息人民币 1,973.18 元，其中本金为人民币 1,972.46 元，应计利息为人民币 0.72 元；共计人民币 40,808.98 元。

5.3 负债清偿情况

(1)本基金最后运作日应付清算款人民币 999.53 元，已于 2026 年 10 月 28 日支付。

(2)本基金最后运作日应付赎回款人民币 169,224.89 元，已于 2026 年 10 月 28 日支付。

(3)本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 12,088.82 元，将于清算期结束日后支付。

(4)本基金最后运作日应付托管费人民币 2,014.82 元，将于清算期结束日后支付。

(5)本基金最后运作日应交税费人民币 0.99 元，将于清算期结束日后支付。

(6)本基金最后运作日其他负债人民币 9,050.24 元，其中应付交易费用人民币 8,157.04 元，将于清算期结束日后支付；预提银行划款手续费人民币 400.00 元用于支付基金清算相关划款手续费，最终以银行实际扣款金额为准；应付审计费人民币 493.20 元，将于清算期结束日后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	清算期间（自 2026 年 10 月 28 日起至 2026 年 10 月 30 日止）
一、清算收入	
1、利息收入-存款利息收入（注 1）	285.96
2、其他业务收入-赎回费收入	32.20
清算收入小计	318.16
二、清算费用	-
清算费用小计	-
三、清算期间收益	318.16

注 1：存款利息收入为计提的清算期间（自 2026 年 10 月 28 日起至 2026 年 10

月 30 日止）的货币资金利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

5.5 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、最后运作日 2026 年 10 月 27 日基金净资产	9,734,570.94
加：清算期间收益	318.16
减：基金赎回金额	25,751.14
二、清算结束日 2026 年 10 月 30 日基金净资产	9,709,137.96

由于最后运作日 2026 年 10 月 27 日当日仍有投资者赎回，赎回确认后产生了基金赎回金额人民币 25,751.14 元。其中，赎回费人民币 32.20 元，归属于基金资产；应付赎回款人民币 25,718.94 元，已于 2026 年 10 月 29 日支付完毕。

资产处置及负债清偿后，于 2026 年 10 月 30 日本基金剩余财产为人民币 9,709,137.96 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，在基金可分配的剩余财产范围内按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。基金份额持有人对基金财产清算后的基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

清算期结束日次日 2026 年 10 月 31 日至清算款划出日前一日的货币资金、结算备付金及存出保证金产生的利息亦属于基金份额持有人所有。

5.6 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。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

（1）中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）财务报表及审计报告

（2）上海市通力律师事务所关于中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）清算事宜之法律意见

6.2 存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地--中国（上海）自由贸易试验区银城路

16 号 19 层。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

中信保诚新机遇混合型证券投资基金（LOF）

基金财产清算小组

2026 年 11 月 13 日