淳厚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

清算报告

基金管理人：淳厚基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二六年十一月十一日

清算报告公告日：二〇二六年十一月十七日

目录

1、 重要提示 3
2、 基金概况 3
2.1 基金基本情况 3
2.2 基金产品说明 4
3、 基金运作情况说明 4
4、 财务报告 5
资产负债表（已审计） 5
5、 清算情况 6
5.1 清算费用 7
5.2 资产处置情况 7
5.3 负债清偿情况 7
5.4 清算期间的清算损益情况 7
5.5 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 8
5.6 基金财产清算报告的告知安排 8
6、 备查文件目录 8
6.1 备查文件目录 8
6.2 存放地点 9
6.3 查阅方式 9

1、 重要提示

淳厚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（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”）2022 年 4 月 13 日证监许可〔2022〕783 号《关于准予淳厚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》准予注册，由淳厚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《淳厚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）负责公开募集。基金合同于 2022 年 5 月 20 日正式生效，首次设立募集规模为 4,406,638,207.53 份。本基金的基金管理人为淳厚基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据市场环境变化及基金运作情况，为了更好地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》和《基金合同》的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人浙商银行股份有限公司协商一致，提议终止《基金合同》，并以通讯方式召开基金份额持有人大会审议上述事项。

根据基金管理人于 2026 年 9 月 16 日发布的《淳厚基金管理有限公司关于淳厚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2026 年 9 月 15 日表决通过了《关于淳厚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，上述决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2026 年 9 月 15 日，自 2026 年 9 月 16 日进入清算期。

基金管理人淳厚基金管理有限公司、基金托管人浙商银行股份有限公司、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2026 年 9 月 16 日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

基金名称	淳厚中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
基金简称	淳厚中证同业存单AAA指数7天持有期
基金类型	混合型
基金主代码	015647
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年05月20日
基金管理人	淳厚基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
基金最后运作日(2026年09月	7,399,846.44份

15日)基金份额总额	
基金最后运作日(2026年09月15日)基金份额净值	1.0661
基金合同存续期	不定期
注册登记机构	淳厚基金管理有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证同业存单AAA指数收益率*95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

3、 基金运作情况说明

本基金经中国证监会 2022 年 4 月 13 日证监许可〔2022〕783 号《关于准予淳厚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人淳厚基金管理有限公司依照法律法规、《基金合同》等规定于 2022 年 5 月 5 日至 2022 年 5 月 18 日发行募集，基金合同于 2022 年 5 月 20 日生效。基金合同生效日的基金总份额为 4,406,638,207.53 份。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

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》和《基金合同》的有关规定，以及基金管理人于 2026 年 9 月 16 日发布的《淳厚基金管理有限公司关于淳厚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，本次基

金份额持有人大会于 2026 年 9 月 15 日表决通过了《关于淳厚中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》，上述决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为 2026 年 9 月 15 日，自 2026 年 9 月 16 日进入清算期。

4、 财务报告

资产负债表（已审计）

会计主体：淳厚中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

报告截止日：2026年09月15日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	2026年09月15日 （基金最后运作日）
资 产：	
货币资金	420,936.82
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	7,481,828.93
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	7,481,828.93
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
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	7,902,765.75
负债和净资产	**2026年09月15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	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	1,090.11
应付托管费	272.55
应付销售服务费	1,090.11
应付投资顾问费	-
应交税费	9.72
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	11,632.25
负债合计	14,094.74
净资产：	
实收基金	7,399,846.44
其他综合收益	-
未分配利润	488,824.57
净资产合计	7,888,671.01
负债和净资产总计	7,902,765.75

注：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》等有关规定编制的。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，本清算报表并无可比期间的相关数据列示。

5、 清算情况

本基金的清算期间为 2026 年 09 月 16 日至 2026 年 10 月 21 日。基金财产清算小组按照法律法规及《基金合同》的规定履行基金财产清算程序对本基金的资产、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

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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的清算审计费及律师费由基金管理人承担。

5.2资产处置情况

（1）本基金最后运作日货币资金为人民币420,936.82元，其中托管户存款为人民币31,110.63元，应计银行存款利息为人民币31.85元，应计银行存款利息已于2026年09月21日结息至托管户；券商保证金账户余额为人民币385,514.88元，应计券商保证金利息为人民币4,279.46元，该款项已于清算期间划入托管账户。

（2）本基金最后运作日交易性金融资产为人民币7,481,828.93元，均为债券投资，已于清算期间处置变现。

5.3 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1,090.11元，该款项已于清算期间完成支付。

（2）本基金最后运作日应付托管费为人民币272.55元，该款项已于清算期间完成支付。

（3）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币1,090.11元，该款项已于清算期间完成支付。

（4）本基金最后运作日应交税费为人民币9.72元，该款项已于清算期间完成支付。

（5）本基金最后运作日其他负债金额为人民币11,632.25元。分别为已计提尚未支付的中债登账户维护费4,500.00元，上清所账户维护费4,500.00元，上清所证书查询费300.00元以及应付银行间交易费用2,332.25元。上述所有款项已于清算期间完成支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2026年09月16日 至 2026年10月21日（清算期间）
一、清算收益	411.32
1．利息收入	1,047.02
2．投资收益	-3,016.50
3．公允价值变动损益（损失以“-”填列）	2,380.80
二、清算费用	0.38
1．其他费用	-
2．附加税	0.38

三、清算收益总额（损失以“-”填列）	410.94
四、清算净收益（损失以“-”填列）	410.94

注 1：利息收入系本基金清算期间的银行存款利息收入，券商保证金利息收入。
注 2：投资收益系本基金清算期间债券投资收益。

5.5 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

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日（2026年09月15日）基金净资产	7,888,671.01
加：自（2026年09月16日）至（2026年10月21日）止清算期间净收益（损失以“-”填列）	410.94
减：清算期间确认的最后运作日净赎回金额（含费用）	18,661.15
二、清算结束日（2026年10月21日）基金净资产	7,870,420.80

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日2026年10月21日，本基金剩余财产为人民币7,870,420.80元，根据本基金的基金合同，本基金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。

自本次清算期起始日2026年09月16日至清算款划出前一日产生的银行存款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。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，该部分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。

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、淳厚中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金审计报告

2、上海市通力律师事务所关于《淳厚中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

淳厚基金管理有限公司

地址：上海市长宁区长宁路1027号1001室

6.3 查阅方式

上述文件可在淳厚基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到淳厚基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人淳厚基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-000-9738

网址：http://www.purekindfund.com/

淳厚中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金财产清算小组

二〇二六年十一月十一日