

国泰央企改革股票型证券投资基金 清算报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

公告日期：2026 年 7 月 8 日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰央企改革股票型证券投资基金(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”)证监许可[2015]1398号《关于准予国泰央企改革股票型证券投资基金注册的批复》准予注册,由国泰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《国泰央企改革股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 279,753,260.50 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1040 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰央企改革股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2015 年 9 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 279,845,757.40 份基金份额,其中认购资金利息折合 92,496.90 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金合同“第五部分 基金备案”中“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 个工作日出现前述情形的,本基金将按照《基金合同》的约定进入清算程序并终止,无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。”截至 2026 年 6 月 16 日日终,本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元,已触发基金合同终止的上述情形,将根据基金合同约定进入基金财产清算程序并终止基金合同,无需召开基金份额持有人大会审议。

本基金清算期为2026年6月18日至2026年6月26日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、立信会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2026年6月18日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由立信会计师事务所(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。

1.2 目录

1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
2	基金概况	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	5
3	基金最后运作日财务会计报告（经审计）	5
3.1	资产负债表	5
3.2	利润表	7
3.3	净资产变动表	8
4	清盘事项说明	9
4.1	基金基本情况	9
4.2	清算原因	10
4.3	清算起始日	10
4.4	清算报表编制基础	10
5	清算情况	10
5.1	清算费用	11
5.2	资产处置情况	11
5.3	负债清偿情况	11
5.4	清算期间的清算损益情况	11
5.5	资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况	12
5.6	基金财产清算报告的告知安排	12
6	备查文件目录	13
6.1	备查文件目录	13
6.2	存放地点	13
6.3	查阅方式	13

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰央企改革股票型证券投资基金	
基金简称	国泰央企改革股票	
基金主代码	001626	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 9 月 1 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
2026 年 6 月 17 日(基金最后运作日) 基金份额总额	14,918,882.58 份	
下属分级基金的基金简称	国泰央企改革股票 A	国泰央企改革股票 C
下属分级基金的交易代码	001626	019117
2026 年 6 月 17 日(基金最后运作日) 下属分级基金的份额总额	14,184,141.84 份	734,740.74 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于央企改革受益股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在投资运作中，淡化大类资产配置，侧重在央企改革主题下精选个股，以期实现基金资产的稳健增值。 1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、固定收益类投资工具投资策略；4、股指期货投资策略；5、中小企业私募债投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、权证投资策略。
业绩比较基准	中证中央企业综合指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	许俊
	联系电话	021-31081600转	010-66596688
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95566
传真		021-31081800	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦 东大道1200号2层225室	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号楼 嘉昱大厦15-20层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200082	100818
法定代表人		周向勇	葛海蛟

3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

3.1 资产负债表

会计主体：国泰央企改革股票型证券投资基金

报告截止日：2026年6月17日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2026年6月17日 (基金最后运作日)	上年度末 2025年12月31日
资产：		
货币资金	3,637,467.93	7,664,800.07
结算备付金	23.72	8,536.95
存出保证金	10,557.92	49,191.56
交易性金融资产	21,015,406.76	51,693,996.93
其中：股票投资	21,015,406.76	51,693,996.93
基金投资	-	-
债券投资	-	-

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	-	-
应收清算款	1,463,898.81	181,015.47
应收股利	-	-
应收申购款	-	7,598.94
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	26,127,355.14	59,605,139.92
负债和净资产	本期末 2026年6月17日 (基金最后运作日)	上年度末 2025年12月31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	-	949,617.94
应付赎回款	2,872,124.79	240,286.97
应付管理人报酬	20,296.75	62,081.91
应付托管费	3,382.78	10,347.01
应付销售服务费	754.80	2,083.24
应付投资顾问费	-	-
应交税费	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	38,382.24	146,672.33
负债合计	2,934,941.36	1,411,089.40
净资产:		
实收基金	14,918,882.58	32,550,753.00
未分配利润	8,273,531.20	25,643,297.52
净资产合计	23,192,413.78	58,194,050.52
负债和净资产总计	26,127,355.14	59,605,139.92

注：报告截止日 2026 年 6 月 17 日（基金最后运作日），基金份额总额 14,918,882.58 份，其中 A 类基金份额净值 1.5554 元，份额总额 14,184,141.84 份；C 类基金份额净值 1.5377 元，份额总额 734,740.74 份。

3.2 利润表

会计主体：国泰央企改革股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 17 日（基金最后运作 日）止期间	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日止期间
一、营业总收入	-6,197,158.39	511,634.69
1.利息收入	8,178.27	76,757.68
其中：存款利息收入	8,178.27	76,757.68
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,715,811.27	-4,040,679.42
其中：股票投资收益	-1,881,049.42	-5,844,883.83
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-73,760.81
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	165,238.15	1,877,965.22
其他投资收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,515,018.10	4,203,756.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	25,492.71	271,799.81
减：二、营业总支出	353,707.10	2,560,603.64
1. 管理人报酬	268,550.56	1,806,466.89
2. 托管费	44,758.45	301,077.81
3. 销售服务费	10,066.46	315,314.10
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	-	-
8. 其他费用	30,331.63	137,744.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-6,550,865.49	-2,048,968.95
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-6,550,865.49	-2,048,968.95
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	-6,550,865.49	-2,048,968.95

3.3 净资产变动表

会计主体：国泰央企改革股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 17 日（基金最后运作日）止期间		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	32,550,753.00	25,643,297.52	58,194,050.52
二、本期期初净资产	32,550,753.00	25,643,297.52	58,194,050.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,631,870.42	-17,369,766.32	-35,001,636.74
（一）、综合收益总额	-	-6,550,865.49	-6,550,865.49
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-17,631,870.42	-10,818,900.83	-28,450,771.25
其中：1.基金申购款	4,946,747.38	3,633,116.07	8,579,863.45
2.基金赎回款	-22,578,617.80	-14,452,016.90	-37,030,634.70
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	14,918,882.58	8,273,531.20	23,192,413.78
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	178,139,019.09	121,028,153.49	299,167,172.58
二、本期期初净资产	178,139,019.09	121,028,153.49	299,167,172.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-145,588,266.09	-95,384,855.97	-240,973,122.06
（一）、综合收益总额	-	-2,048,968.95	-2,048,968.95
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-145,588,266.09	-93,335,887.02	-238,924,153.11
其中：1.基金申购款	81,247,899.76	51,006,801.77	132,254,701.53
2.基金赎回款	-226,836,165.85	-144,342,688.79	-371,178,854.64
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	32,550,753.00	25,643,297.52	58,194,050.52

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰央企改革股票型证券投资基金(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”)证监许可[2015]1398号《关于准予国泰央企改革股票型证券投资基金注册的批复》准予注册,由国泰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《国泰央企改革股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 279,753,260.50 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1040 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰央企改革股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2015 年 9 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 279,845,757.40 份基金份额,其中认购资金利息折合 92,496.90 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金管理人国泰基金管理有限公司于 2023 年 8 月 17 日发布的《国泰基金管理有限公司关于国泰央企改革股票型证券投资基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2023 年 8 月 21 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用,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(原基金份额自动转入 A 类基金份额);C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同类别基金份额之间如开通互相转换业务,相关约定见届时公告,无需召开基金份额持有人大会审议。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰央企改革股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行或上市的股票(含存托凭证)、债券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。具体包括:国内依法发行或上市的股票(包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证)、股指期货、权证等权益类金融工具,债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、央行票据)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类金融工具,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

会相关规定。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例不低于基金资产的 80%，投资于《基金合同》界定的央企改革受益主题证券资产(含存托凭证)占非现金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证中央企业综合指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

4.2 清算原因

根据基金合同“第五部分 基金备案”中“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 个工作日出现前述情形的，本基金将按照《基金合同》的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”截至 2026 年 6 月 16 日日终，本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元，已触发基金合同终止的上述情形，将根据基金合同约定进入基金财产清算程序并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会审议。

4.3 清算起始日

本基金清算期为 2026 年 6 月 18 日至 2026 年 6 月 26 日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、立信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2026 年 6 月 18 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由立信会计师事务所（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。

4.4 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《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。

5 清算情况

自 2026 年 6 月 18 日至 2026 年 6 月 26 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：

5.1 清算费用

按照基金合同“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。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，本基金清算期间的律师费由基金管理人承担。

5.2 资产处置情况

截至本次清算期结束日（2026 年 6 月 26 日），各项资产处置情况如下：

（1）本基金最后运作日，活期存款 3,637,467.93 元，结算备付金 23.72 元，存出保证金 10,557.92 元。截至清算结束日，活期存款 19,038,750.81 元，包含基金管理人于 2026 年 6 月 25 日划入的垫付资金 100,000.00 元，存出保证金 10,547.92 元。

（2）本基金最后运作日，交易性金融资产 21,015,406.76 元，均为交易性股票投资。截至清算结束日，交易性金融资产已变现。

（3）本基金最后运作日，应收清算款 1,463,898.81 元。截至清算结束日，应收清算款已交收。

5.3 负债清偿情况

截至本次清算期结束日（2026 年 6 月 26 日），各项负债清偿情况如下：

（1）本基金最后运作日，应付赎回款 2,872,124.79 元。截至清算结束日，应付赎回款已支付。

（2）本基金最后运作日，应付管理人报酬 20,296.75 元，应付托管费 3,382.78 元，应付销售服务费 754.80 元。截至清算结束日，应付管理人报酬、应付托管费已支付，应付销售服务费待日后支付。

（3）本基金最后运作日，其他负债 38,382.24 元，其中应付赎回费 102.29 元、应付佣金 9,676.67 元、预提审计费用 3,178.40 元、预提信披费用 25,424.88 元。截至清算结束日，以上费用均已支付。2026 年 6 月 26 日预提汇款费用 220.00 元，待日后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 6 月 18 日（基金清算起始日）起至 2026 年 6 月 26 日（基金清算结束日）止期间

一、资产处置损益	-187,549.28
1.利息收入	671.87
其中：存款利息收入	671.87
2.投资收益（损失以“-”填列）	-4,167,794.67
其中：股票投资收益	-4,152,965.87
股利收益	-14,828.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,978,636.27
4.其他业务收入	937.25
二、清算费用	453.54
1. 其他费用	453.54
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-188,002.82

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

资产处置及负债清偿后，截至清算结束日 2026 年 6 月 26 日，本基金剩余财产为 18,948,323.93 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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日 2026 年 6 月 18 日至最终清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算，由基金管理人以自有资金垫付并已于 2026 年 6 月 25 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账起孳生的利息归基金管理人所有。

截至 2026 年 6 月 26 日日终，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额 19,038,750.81 元，包含基金管理人垫付资金 100,000.00 元。基金管理人垫付的资金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。

5.6 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、《国泰央企改革股票型证券投资基金 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 17 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告》；
- 2、上海市通力律师事务所关于《国泰央企改革股票型证券投资基金清算报告》的法律意见。

6.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

国泰央企改革股票型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二六年六月二十六日