
国投瑞银和嘉债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：2026年7月15日

清算报告公告日：2026年7月17日

一、 重要提示

国投瑞银和嘉债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2024年1月31日证监许可[2024]213号文《关于准予国投瑞银和嘉债券型证券投资基金注册的批复》准予注册募集，由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2024年4月25日生效。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《国投瑞银和嘉债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，《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50个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在履行清算程序后终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。截至2026年7月3日日终，本基金的基金资产净值为3,709,760.80元，已连续50个工作日低于5000万元，触发了上述《基金合同》终止的情形。根据《基金合同》上述约定，本基金自2026年7月4日起进入基金财产清算程序，本基金的最后运作日为2026年7月3日。

基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2026年7月4日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

基金名称	国投瑞银和嘉债券型证券投资基金
基金简称	国投瑞银和嘉债券
基金主代码	020805
交易代码	020805

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 4 月 25 日
最后运作日基金份额总额	3,483,398.82 份
投资目标	本基金在追求基金资产稳定增值、严格控制风险和保持资金流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资人实现超越业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	1、资产配置策略：本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险的比较判别，对债券、股票（包括 A 股、存托凭证和港股通标的股票等）及货币市场工具等各资产类别的配置比例进行动态调整，以期在投资中达到风险和收益的优化平衡。 2、债券投资管理策略：主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略和信用债（含资产支持证券，下同）投资策略。在不同的时期，采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同，具体采用何种策略取决于债券组合允许的风险程度。 本基金主动投资信用债的信用评级应在 AA+ 级及以上。其中，主动投资于 AA+ 级债券的比例合计不超过信用债资产的 50%，主动投资于 AAA 级债券的比例合计不低于信用债资产的 50%。 3、股票投资管理策略：本基金将采用行业配置和个股精选相结合的方法进行股票投资。同时，本基金将根据政策因素、宏观因素、估值因素、市场因素等方面的指标，在基金合同约定的投资比例范围内适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例。 4、基金投资管理策略：本基金仅可投资于全市场的股票型 ETF 及本基金管理人管理的股票型基金、应计入权益类资产的混合型基金。 5、可转换债券投资管理策略：本基金将着重于对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究，同时兼顾其债券价值和转换期权价值。 6、可交换债券投资管理策略：本基金将结合对可交换债券的纯债部分价值以及对目标公司的股票价值的综合评估，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资。 7、国债期货投资管理策略：为更好地实现投资目标，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货等金融衍生品。本基金利用金融衍生品合约流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，提高投资组合的运作效率。

业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×7%+中证港股通综合指数收益率×3%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

三、 基金运作情况

本基金由国投瑞银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《基金合同》公开募集。基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 292,341,267.46 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（2024）第 0135 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2024 年 4 月 25 日生效，《基金合同》生效日的基金份额总额为 292,393,099.51 份基金份额，其中认购资金利息折合 51,832.05 份基金份额。自 2024 年 4 月 25 日至 2026 年 7 月 3 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》以及《基金合同》的有关规定，《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 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在履行清算程序后终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。根据《关于国投瑞银和嘉债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金的最后运作日为 2026 年 7 月 3 日，自 2026 年 7 月 4 日起进入清算期。本次清算期间为 2026 年 7 月 4 日至 2026 年 7 月 15 日。

四、 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：国投瑞银和嘉债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 7 月 3 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日
	2026 年 7 月 3 日
资产：	
货币资金	471,436.27
结算备付金	142,819.94
存出保证金	14,035.64
交易性金融资产	3,107,041.65
资产总计	3,735,333.50
负债：	
应付赎回款	1,133.36
应付管理人报酬	264.84
应付托管费	66.22
应付销售服务费	122.99
应交税费	109.18
其他负债	23,876.11
负债合计	25,572.70
净资产：	
实收资金	3,483,398.82
未分配利润	226,361.98
净资产合计	3,709,760.80
负债和净资产总计	3,735,333.50

注：报告截止日 2026 年 7 月 3 日（基金最后运作日），国投瑞银和嘉债券 A 类基金份额净值人民币 1.0709 元，国投瑞银和嘉债券 C 类基金份额净值人民币 1.0624 元，基金份额总额 3,483,398.82 份。其中国投瑞银和嘉债券 A 类基金份额 1,068,833.99 份；国投瑞银和嘉债券 C 类基金份额 2,414,564.83 份。

五、 清算情况

自2026年7月4日至2026年7月15日止的清算期间，本基金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。

基金资产处置、负债清偿及基金净资产分配情况如下：

（一） 资产处置情况

1、货币资金

本基金最后运作日货币资金为人民币471,436.27元，其中银行存款本金人民币471,346.74元，银行存款应计利息人民币89.53元。于清算期间计提应计利息人民币299.98元，基金管理人于清算结束后以自有资金垫付剩余银行存款应计利息款项。

2、结算备付金

本基金最后运作日结算备付金为人民币142,819.94元，其中本金人民币142,803.26元，应计利息人民币16.68元。于清算期间结算备付金本金人民币99,725.43元已划出至银行存款，计提应计利息人民币9.89元。截止至清算结束日结算备付金为人民币43,104.40元，其中本金人民币43,077.83元，应计利息人民币26.57元。基金管理人于清算结束后以自有资金垫付剩余结算备付金本金和应计利息款项。

3、存出保证金

本基金最后运作日存出保证金为人民币14,035.64元，其中本金人民币14,033.86元，应计利息人民币1.78元。于清算期间计提应计利息人民币1.56元。截止至清算结束日存出保证金为人民币14,037.20元，其中本金人民币14,033.86元，应计利息人民币3.34元。基金管理人于清算结束后以自有资金垫付剩余存出保证金本金和应计利息款项。

4、交易性金融资产

本基金最后运作日交易性金融资产为人民币3,107,041.65元，均为债券投资。截止至清算结束日，交易性金融资产均已处置变现，变现金额为人民币3,107,275.00元。该款项已于2026年7月7日划入本基金托管账户。

（二） 负债清偿情况

1、应付赎回款

本基金最后运作日应付赎回款为人民币1,133.36元。于清算期间确认应付赎回款人民币20,086.73元，其中应付国投瑞银和嘉债券型证券投资基金A类份额赎回款人民币0元，应付国投瑞银和嘉债券型证券投资基金C类份额赎回款人民币20,086.73元。上述款项已于2026年7月7日前（含当日）支付。

2、应付管理费

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币264.84元。上述款项已于2026年7月7日支付。

3、应付托管费

本基金最后运作日应付托管费为人民币66.22元。上述款项已于2026年7月7日支付。

4、应付销售服务费

本基金最后运作日应付销售服务费为人民币122.99元。上述款项已于2026年7月7日支付。

5、应交税费

本基金最后运作日应交税费为人民币109.18元。于清算期间因持有债券产生利息收入计提的增值税及附加税费人民币8.97元。上述款项已于2026年7月7日支付。

6、其他负债

本基金最后运作日其他负债为人民币23,876.11元，其中其他应付款人民币384.14元，应付交易费用人民币6,629.57元，预提审计费人民币7,562.40元，预提中债登账户维护费人民币4,500.00元，预提上清所账户维护费人民币4,800.00元。于清算期间2026年7月7日前（含当日）支付中债登账户维护费人民币4,500.00元，上清所账户维护费人民币4,800.00元、支付应付交易费用人民币6,135.00元，中债登政策性抵扣当期交易费用人民币15.00元。截止至清算结束日其他负债为人民币8,426.11元，该款项将于清算结束后支付。

（三）清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	附注	自2026年7月4日至2026年7月15日止清算期间
一、清算收益		
1、利息收入	(1)	311.43

2、投资收益	(2)	-673.66
3、公允价值变动损益	(3)	914.00
清算收益小计		551.77
二、清算支出		
1、税金及附加		0.96
2、其他费用		1,500.00
清算支出小计		1,500.96
三、清算净收益（损失以“-”填列）		-949.19

注：（1）利息收入为清算期间计提的银行活期存款利息收入、结算备付金利息收入、存出保证金利息收入。

（2）投资收益为清算期间内因持有交易性债券投资产生的利息收入人民币267.34元、交易性债券投资差价损失人民币941.00元。

（3）公允价值变动损益为清算期间内交易性债券投资公允价值变动损益人民币914.00元。

（4）其他费用为清算期间内2026年第3季度中债登账户维护费人民币1,500.00元。

（四）清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	附注	金额
一、最后运作日2026年7月3日基金净资产		3,709,760.80
加：清算期间净收益（损失以“-”填列）		-949.19
减：清算期间从持有人权益转出	(1)	25,441.62
二、清算结束日2026年7月15日基金净资产		3,683,369.99

注：（1）清算期间从持有人权益转出系本基金份额持有人于最后运作日2026年7月3日提交的赎回及转出申请，已于2026年7月7日支付基金赎回及转出款。

根据《基金合同》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，各类基金份额按基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。

清算结束日次日至清算款划出日前一日的货币资金、结算备付金和存出保证

金产生的利息归基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用，待结息日回款后再返还给基金管理人。

（五） 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，经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、 备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《国投瑞银和嘉债券型证券投资基金基金清算审计报告》
- 2、《上海源泰律师事务所关于国投瑞银和嘉债券型证券投资基金基金清算事宜之法律意见》

（二）存放地点

中国广东省深圳市福田区福华一路119号安信金融大厦18楼

存放网址：<http://www.ubssdic.com>

（三）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。

咨询电话：400-880-6868

国投瑞银和嘉债券型证券投资基金基金财产清算小组

2026年7月15日