

信澳恒瑞9个月持有期混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：2026年7月30日

清算报告公告日：2026年8月7日

一、 重要提示

信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2023 年 12 月 7 日《关于准予信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2023】2751 号）注册公开募集，自 2024 年 8 月 23 日起基金合同生效，基金管理人为信达澳亚基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。根据《信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》“第十九部分基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的“二、《基金合同》的终止事由”中约定，“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人已于 2026 年 6 月 5 日刊登了《关于以通讯方式召开信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2026 年 6 月 6 日、2026 年 6 月 8 日陆续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会于 2026 年 7 月 13 日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效，基金管理人于 2026 年 7 月 15 日刊登了《关于信澳恒瑞 9 个月持有期混合型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》。

基金管理人、基金托管人、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2026 年 7 月 16 日成立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）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、 基金概况

基金名称	信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	信澳恒瑞 9 个月持有期混合
基金主代码	020385
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 8 月 23 日
最后运作日基金份额总额 (2026 年 7 月 15 日)	2,309,644.00
投资目标	在严格控制基金资产投资风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货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)。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：本基金股票、存托凭证、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券资产占基金资产的比例为 10%-30%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%，同业存单的投资占基金资产的比例合计不超过 20%。本基

	金投资于可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的比例不超过基金资产的 20%。本基金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，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。	
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略。	
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*75%+中证 800 指数收益率*23%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金投资港股通标的股票的，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。	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信澳恒瑞 9 个月持有期混合 A	信澳恒瑞 9 个月持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	020385	020386
最后运作日下属分级基金	50,619.84	2,259,024.16

的份额总额		
-------	--	--

三、基金运作情况

信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证监会证监许可【2023】2751 号文《关于准予信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》的注册,由信达澳亚基金管理有限公司作为基金管理人向社会公开募集,基金合同于 2024 年 8 月 23 日生效。首次设立募集规模为 202,826,475.58 份基金份额。

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》、《信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,经本基金份额持有人大会 2026 年 7 月 13 日表决通过,决定终止基金合同,并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于 2026 年 7 月 15 日刊登了《关于信澳恒瑞 9 个月持有期混合型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》。本基金的最后运作日为 2026 年 7 月 15 日,自 2026 年 7 月 16 日起进入清算期。

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: 信澳恒瑞9个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日: 2026年7月15日

单位: 人民币元

	最后运作日 2026 年 7 月 15 日
资 产:	
银行存款	67,143.13
结算备付金	414,918.63
存出保证金	1,331.94
交易性金融资产	744,681.69
其中: 股票投资	238,195.66
债券投资	506,486.03
应收清算款	1,121,835.65
应收申购款	-

其他资产	18,600.00
资产总计	2,368,511.04
负 债:	
应付赎回款	—
应付管理人报酬	1,258.47
应付托管费	419.49
应付销售服务费	830.36
应交税费	37.57
其他负债	1,281.76
负债合计	3,827.65
所有者权益:	
实收基金	2,309,644.00
未分配利润	55,039.39
所有者权益合计	2,364,683.39
负债和所有者权益总计	2,368,511.04

注：报告截止日2026年7月15日（基金最后运作日），基金份额总额为2,309,644.00份，其中A类基金份额50,619.84份，基金份额净值1.0316元；C类基金份额2,259,024.16份，基金份额净值1.0237元。

五、清算情况

自2026年7月16日至2026年7月30日止清算期间，信澳恒瑞9个月持有期混合型证券投资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：

1、资产清算情况

（1）本基金最后运作日银行存款为人民币 67,143.13 元。其中包含应计利息人民币 103.96 元。支付清算款之日前未变现的部分，将由基金管理人信达澳亚基金管理有限公司以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

（2）本基金最后运作日结算备付金为人民币 414,918.63 元。包含上交所最低备付金本金人民币 413,440.97 元，上交所最低备付金利息人民币 103.05 元，深交所最低备付金本金人民币 1,374.19 元，深交所最低备付金利息人民币 0.42 元。支付清算款之日前未变现的部分，将由基金管理人信达澳亚基金管理有限公司以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

（3）本基金最后运作日存出保证金为人民币 1,331.94 元。包含上交所交易保证金本金人民币 894.05 元，上交所交易保证金利息 0.25 元。深交所交易保证金本

金人民币 437.64 元。支付清算款之日前未变现的部分，将由基金管理人信达澳亚基金管理有限公司以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

（4）本基金最后运作日股票投资为人民币 238,195.66 元，该资产项已于 2026 年 7 月 16 日、7 月 17 日、7 月 22 日完成变现。

（5）本基金最后运作日债券投资为人民币 506,486.03 元，该资产项已于 2026 年 7 月 17 日完成变现。

（6）本基金最后运作日应收清算款为人民币 1,121,835.65 元，该资产项已于 2026 年 7 月 16 日到账。

（7）本基金最后运作日其他资产为人民币 18,600.00 元，包含产品已垫付的 2026 年 1 季度和 2 季度银行间账户维护费。本基金 2026 年 7 月 20 日产品垫付了 2026 年 3 季度银行间账户维护费 3,100.00 元。以上款项均已于 2026 年 7 月 29 日返还到账。

2、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 1,258.47 元，该款项已于 2026 年 7 月 27 日安排支付。

（2）本基金最后运作日应付托管费为人民币 419.49 元，该款项已于 2026 年 7 月 27 日安排支付。

（3）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 830.36 元，该款项已于 2026 年 7 月 27 日安排支付。

（4）本基金最后运作日应交税费为人民币 37.57 元，该款项已于 2026 年 7 月 27 日安排支付。

（5）本基金最后运作日其他负债为人民币 1,281.76 元，该款项为应支付给券商的交易佣金，已于 2026 年 7 月 27 日安排支付。

3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2026年7月16日至 2026年7月30日止清算期间
一、收入	-3,207.88
1、利息收入	316.23

2、投资收益（损失以“-”填列）	-20,964.30
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	17,440.19
减：二、费用	110.00
1、其他费用	110.00
三、利润总额	-3,317.88
减：所得税费用	-
四、清算期间净收益	-3,317.88

注：1.利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2026 年 7 月 16 日（清算开始日）至 2026 年 7 月 30 日（本财务报表批准报出日）止清算期间的利息收入，包括银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息收入。

2.投资收益系清算期间卖出股票及债券产生的差价收入、股息红利税及交易费用。

3.公允价值变动收益系清算期间处置交易性金融资产产生的，为原计入交易性金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

4.其他费用为清算期间内银行汇划费人民币 110.00 元。

4、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、2026年7月15日（基金最后运作日）基金净资产	2,364,683.39
加：清算期间净收益	-3,317.88
减：清算期间确认的最后运作日赎回（含转出）申请导致的基金净资产变动	20.39
二、2026年7月30日（本财务报表批准报出日）基金净资产	2,361,345.12

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（本基金清算过程中发生的审计费、律师费由基金管理人承担）、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，具体方式如下：

2026 年 7 月 30 日本基金剩余财产为人民币 2,361,345.12 元，其中剩余未变现的资产为人民币 416,670.76 元，包括应收银行存款利息人民币 359.59 元、上交所最低备付金本金人民币 413,440.97 元、上交所最低备付金利息人民币 163.35 元、深交所最低备付金本金人民币 1,374.19 元、深交所最低备付金利息人民币 0.57 元、上交所交易保证金本金人民币 894.05 元、上交所交易保证金利

息 0.40 元、深交所交易保证金本金人民币 437.64 元。支付清算款之日前未变现的部分,将由基金管理人信达澳亚基金管理有限公司以自有资金在支付清算款之日进行垫付。

自 2026 年 7 月 30 日至清算款划出日前一日的归属于持有人的银行存款、结算备付金、存出保证金孳生的利息归份额持有人所有。基金管理人信达澳亚基金管理有限公司垫付的银行存款自资金到账日起至托管户销户为止孳生的利息归基金管理人所有,在相关账户销户后向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

5、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

1、备查文件目录

- (1) 《信澳恒瑞9个月持有期混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《关于信澳恒瑞9个月持有期混合型证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。

信澳恒瑞 9 个月持有期混合型证券投资基金财产清算小组

2026 年 7 月 30 日