

施罗德添益债券型证券投资基金

清算报告

基金管理人: 施罗德基金管理(中国)有限公司

基金托管人: 交通银行股份有限公司

清算报告出具日: 2026年8月10日

清算报告公告日: 2026年8月15日

一、重要提示

施罗德添益债券型证券投资基金（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”）《关于准予施罗德添益债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2024]1323号）准予注册，由施罗德基金管理（中国）有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《施罗德添益债券型证券投资基金基金合同》进行募集，基金合同于2024年11月26日生效。本基金的基金管理人及登记机构为施罗德基金管理（中国）有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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》等法律法规和《施罗德添益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，并审议通过了《关于施罗德添益债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。

本基金基金合同终止及基金财产清算安排详见2026年7月28日发布在本基金管理人网站（www.schroders.cn）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn>）的《施罗德基金管理（中国）有限公司关于施罗德添益债券型证券投资基金基金份额持有人大会（2026年第二次）表决结果暨决议生效的公告》。本基金以2026年7月28日为最后运作日，清算期为2026年7月29日至2026年8月3日，由基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所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。

二、基金产品概况

基金简称	施罗德添益债券
基金主代码	022316
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年11月26日
最后运作日（2026年7月28日）基金份额总额	9,872,974.42份

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳定增值。	
投资策略	本基金将通过对宏观环境、货币和财政政策、利率走势、国家经济政策、资本市场资金环境、证券市场走势等因素综合分析，对当前市场的系统性风险、各类资产的市场容量、流动性及配置时机进行评估，以确定基金资产在各类资产的配置比例，并进行动态调整。本基金的债券投资组合策略包括久期配置策略、期限结构配置策略、类属资产配置策略、息差策略、信用债和资产支持证券投资策略。本基金的投资策略还包括金融衍生品投资策略。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*80% + 一年期定期存款利率(税后)*20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	施罗德基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	施罗德添益债券A	施罗德添益债券C
下属分级基金的交易代码	022316	022317
最后运作日（2026年7月28日）下 属分级基金的份额总额	8,948,544.09份	924,430.33份

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会《关于准予施罗德添益债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2024]1323号）准予注册，由施罗德基金管理（中国）有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《施罗德添益债券型证券投资基金基金合同》进行募集，基金合同于2024年11月26日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为1,324,169,912.99份基金份额。本基金的基金管理人及登记机构为施罗德基金管理（中国）有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《施罗德添益债券型证券投资基金基金合同》和《施罗德添益债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括现金、协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款等）、同业存单、国债期货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）。本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率*80% + 一年期定期存款利率（税后）*20%。

自2024年11月26日至2026年7月28日期间，本基金按基金合同正常运作。

四、财务会计报告

1、资产负债表

会计主体：施罗德添益债券型证券投资基金

报告截止日：2026年7月28日（最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2026年7月28日
资产：	

货币资金	1,708,236.16
结算备付金	20,066.56
存出保证金	-
交易性金融资产	8,357,417.81
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	8,357,417.81
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	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	10,085,720.53
负债和净资产	最后运作日 2026年7月28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	2,694.09
应付托管费	898.02
应付销售服务费	350.83
应付投资顾问费	-
应交税费	284.37
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	48,908.62
负债合计	53,135.93
净资产：	
实收基金	9,872,974.42
未分配利润	159,610.18
净资产合计	10,032,584.60
负债和净资产总计	10,085,720.53

注：（1）截至本基金最后运作日2026年7月28日，基金份额总额为 9,872,974.42 份，其中下属A类基金份额净值为 1.0165 元，份额总额为 8,948,544.09 份；下属C类基金份额净值为 1.0129元，份额总额为 924,430.33 份。

（2）本基金的清算财务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》的有关规定编制的。基金管理人编制清算财务报表是为基金财产清算目的依据相关法律法规向基金份额持有人进行信息披露以及提交中国证券监督管理委员会备案。因此，清算财务报表不适用于其他用途。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报表的特定性质，本清算财务报表仅包含最后运作日的资产负债表，未包括利润表、净资产变动表以及对应的比较期间的相关数据，未披露关联方关系及其交易以及与金融工具相关的风险。

五、清算情况

1、清算原因

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》等法律法规和《施罗德添益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人经与本基金的基金托管人交通银行股份有限公司协商一致，于 2026 年 6 月 24 日发布《施罗德基金管理（中国）有限公司关于以通讯方式召开施罗德添益债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告（2026 年第二次）》，以通讯方式组织召开了本基金的基金份额持有人大会，并审议通过了《关于施罗德添益债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》。

2、清算起始日

根据《施罗德基金管理（中国）有限公司关于施罗德添益债券型证券投资基金基金份额持有人大会（2026 年第二次）表决结果暨决议生效的公告》，本基金以 2026 年 7 月 28 日为最后运作日。自 2026 年 7 月 29 日起，本基金进入清算程序，故本基金清算起始日为 2026 年 7 月 29 日。

六、基金财产分配

自 2026 年 7 月 29 日至 2026 年 8 月 3 日（清算结束日）止清算期间，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行本次清算，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、清算费用

根据《施罗德添益债券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”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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剩余财产中支付。

2、资产处置情况

（1）本基金 2026 年 7 月 28 日（最后运作日）货币资金余额为人民币 1,708,236.16 元，其中活期存款为人民币 1,706,836.98 元，应计活期存款利息为人民币 1,399.18 元。

应计利息中未结息的部分将由本基金的基金管理人先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

(2) 本基金 2026 年 7 月 28 日（最后运作日）结算备付金为人民币 20,066.56 元，其中结算备付金本金为人民币 20,063.30 元，应计结算备付金利息为人民币 3.26 元。截至 2026 年 8 月 3 日（清算结束日），该款项已划入托管账户。

(3) 本基金 2026 年 7 月 28 日（最后运作日）交易性金融资产为债券投资, 债券投资金额为人民币 8,357,417.81 元。截至 2026 年 8 月 3 日（清算结束日），上述交易性金融资产已全部处置并划入托管账户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金 2026 年 7 月 28 日（最后运作日）应付管理费为人民币 2,694.09 元。截至 2026 年 8 月 3 日（清算结束日），该款项已支付。

(2) 本基金 2026 年 7 月 28 日（最后运作日）应付托管费为人民币 898.02 元。截至 2026 年 8 月 3 日（清算结束日），该款项已支付。

(3) 本基金 2026 年 7 月 28 日（最后运作日）应付销售服务费为人民币 350.83 元。截至 2026 年 8 月 3 日（清算结束日），该款项已支付。

(4) 本基金 2026 年 7 月 28 日（最后运作日）应交税费为人民币 284.37 元。截至 2026 年 8 月 3 日（清算结束日），该款项已支付。

(5) 本基金 2026 年 7 月 28 日（最后运作日）其他负债余额为人民币 48,908.62 元，包括应付银行间账户维护费人民币 3,000.00 元、查询服务费人民币 100.00 元和信息披露费人民币 45,808.62 元。截至 2026 年 8 月 3 日（清算结束日），该款项已支付。

4、清算期间的损益情况

单位：人民币元

项目	自 2026 年 7 月 29 日至 2026 年 8 月 3 日止 清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	250.90

2、债券变现损益（注 2）	2,193.00
清算收益小计	2,443.90
二、清算费用	
1、税金及附加	0.97
清算费用小计	0.97
三、清算净收益	2,442.93

注：（1）利息收入金额为人民币 250.90 元，系以当前适用利率计提的 2026 年 7 月 29 日至 2026 年 8 月 3 日止清算期间的银行存款利息及结算备付金利息收入。

（2）债券变现损益为本次清算期间债券资产卖出总额与基金最后运作日债券资产市值的差额，扣除了交易费用和增值税费。

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 7 月 28 日）基金净资产	10,032,584.60
加：清算期间净收益	2,442.93
减：基金净赎回金额（于 2026 年 7 月 29 日确认的投资者赎回申请）	6,155.75
二、2026 年 8 月 3 日基金净资产	10,028,871.78

资产处置及负债清偿后，于 2026 年 8 月 3 日本基金剩余财产为人民币 10,028,871.78 元。根据本次基金份额持有人大会审议通过的《关于施罗德添益债券型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》及《施罗德添益债券型证券投资基金基金合同》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。

2026 年 8 月 4 日至本基金最后一笔清算款划出日前一日的货币资金产生的利息亦属基金份额持有人所有。如前述利息在本基金财产分配划出日前尚未结清，则未结息部分（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）将由基金管理人以自有资金垫付。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，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

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。

七、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 施罗德添益债券型证券投资基金财务报表及审计报告
- (2) 关于《施罗德添益债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的住所。其中，基金管理人的住所为中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号33楼33T52A单元。

3、查阅方式

投资人可以在营业时间内至基金管理人上述地址免费查阅。

施罗德添益债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二六年八月十五日