
国投瑞银兴源6个月定期开放混合型基金中基金（FOF） 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：渤海银行股份有限公司

清算报告出具日：2025年9月23日

清算报告公告日：2025年9月25日

一、 重要提示

国投瑞银兴源6个月定期开放混合型基金中基金（FOF）（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[2022]294号《关于准予国投瑞银兴源6个月定期开放混合型基金中基金（FOF）注册的批复》注册募集，于2022年8月12日正式运作，基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为渤海银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《国投瑞银兴源6个月定期开放混合型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，在基金存续期内，发生以下任何一种情形时，基金合同将终止并进行基金财产清算，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：（1）某个开放期届满时，本基金的基金份额持有人数量不满200人的；（2）某个开放期届满时，本基金的基金资产净值低于5000万元的。本基金的第六个开放期为2025年8月12日至2025年9月8日，截至本次开放期届满，本基金的基金资产净值低于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，本基金的最后运作日为2025年9月10日，本基金自2025年9月11日起进入基金财产清算程序。

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2025年9月11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	国投瑞银兴源 6 个月定期开放混合型基金中基金（FOF）
基金简称	国投瑞银兴源 6 个月定开混合（FOF）
基金主代码	015246
基金运作方式	契约型、以定期开放方式运作
基金合同生效日	2022 年 8 月 12 日
最后运作日基金份额总额	49,709,720.65

投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金通过定量与定性研究相结合的方法进行资产配置和基金精选,力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以自上而下的资产配置和自下而上的投资标的精选为核心,追求有效风险控制下的长期稳健回报。 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,对各类资产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、基金投资策略: 在基金精选方面,本基金将注重选择与本基金资产配置目标匹配度高的被动指数(含增强和/或主动管理基金; 被动指数(含增强)型基金方面,通过对标的指数匹配性、跟踪误差、增强收益、基金资产规模、流动性、运营规则、交易折溢价、交易费用以及基金管理人在被动管理基金上的经验等因素的综合分析,选择合适的指数基金; 主动管理型基金方面,首先,管理人将考察基金公司的治理结构、高管团队和投研团队稳定性、激励机制和投研考核机制,以评估基金公司投研团队、业绩稳定性与持续性。其次,管理人将通过考量基金经理的能力优势,精选表现出相关能力优势或综合能力优势的基金经理管理的基金,借助基金经理创造超额收益的能力来优化组合的收益。最后,在具体基金选择方面,本基金基于基金风险收益特征、投资风格、基金规模、交易费用等因素的综合考虑筛选基金,力求寻找到体现基金经理超额收益创造能力、绩效持续稳定的基金。 3、其他资产的投资策略: (1) 股票投资策略, 本基金的股票投资策略主要采用“自下而上”选股策略,辅以行业分析进行组合优化。 (2) 存托凭证投资策略, 本基金将根据本基金的投资

	目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。 (3) 港股通标的股票投资,本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制适度参与港股市场投资,以增强整体收益。 (4) 债券投资策略,本基金将根据需要适度进行债券投资,在追求债券资产投资收益的同时兼顾流动性和安全性。本基金债券投资策略主要包括:久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。 (5) 资产支持证券,资产支持证券定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响,本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,以数量化模型确定其内在价值。 4、风险控制策略:本基金将采用多种风险评估与控制策略,对投资组合进行事前和事后的风险评估、监测与管理。	
业绩比较基准	$\text{中证 800 指数收益率} \times 25\% + \text{中债综合指数收益率} \times 70\% + \text{银行活期存款利率(税后)} \times 5\%$	
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金,其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金,低于股票型基金和股票型基金中基金。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	渤海银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银兴源 6 个月定开混合 (FOF) A	国投瑞银兴源 6 个月定开混合 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	015246	015247

最后运作日下属分级基金的份额总额	30,520,226.38 份	19,189,494.27 份
------------------	-----------------	-----------------

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》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 259,546,335.25 元，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2022 年 8 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 259,606,531.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 60,196.60 份基金份额。自 2022 年 8 月 12 日至 2025 年 9 月 10 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》、《基金合同》的有关规定，本基金的第六个开放期为 2025 年 8 月 12 日至 2025 年 9 月 8 日，截至本次开放期届满，本基金的基金资产净值低于 5000 万元，触发了上述《基金合同》终止的情形，无需召开基金份额持有人大会，进入资产变现及清算程序。本基金最后运作日为 2025 年 9 月 10 日，并从 2025 年 9 月 11 日起进入清算期。本基金清算期自 2025 年 9 月 11 日至 2025 年 9 月 23 日止。

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：国投瑞银兴源 6 个月定期开放混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2025 年 9 月 10 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2025 年 9 月 10 日
资产：	
货币资金	24,147,787.49
存出保证金	-
交易性金融资产	15,029,695.41

其中：基金投资	15,029,695.41
应收清算款	-
应收申购款	10,311,251.83
其他资产	-
资产总计	49,488,734.73
负债：	
应付赎回款	1,405,047.08
应付管理人报酬	3,950.54
应付托管费	658.41
应付销售服务费	2,033.73
其他负债	114,371.18
负债合计	1,526,060.94
净资产：	
实收资金	49,709,720.65
其他综合收益	-
未分配利润	-1,747,046.86
净资产合计	47,962,673.79
负债和净资产总计	49,488,734.73

注：报告截止日 2025 年 9 月 10 日（基金最后运作日），基金份额总额 49,709,720.65 份，其中 A 类基金份额净值 0.9694 元，基金份额 30,520,226.38 份；C 类基金份额净值 0.9575 元，基金份额 19,189,494.27 份。

五、 清算情况

自2025年9月11日至2025年9月23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24,147,787.49元，其中银行存款人民币

11,729,778.66 元，银行存款本金人民币 11,703,065.98 元，银行存款应计利息人民币 26,712.68 元，2025 年 9 月 21 日银行存款结息人民币 34,186.96 元，已划入本基金托管账户。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；其他存款人民币 12,418,008.83 元，其他存款本金人民币 12,413,998.60 元。其他存款应计利息人民币 4,010.23 元，于 2025 年 9 月 11 日至 2025 年 9 月 15 日计提应计利息人民币 541.54 元。其他存款本金人民币 12,413,998.60 元及其他存款应计利息人民币 4,551.77 元已于 2025 年 9 月 15 日划入本基金托管账户。

2、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 15,029,695.41 元，其中基金投资人民币 15,029,695.41 元。截止清算结束日，基金投资均已处置变现，变现金额为人民币 14,992,663.44 元，该款项已于 2025 年 9 月 19 日前划入本基金托管账户。

3、应收申购款

本基金最后运作日的应收申购款为人民币 10,311,251.83 元。该款项已于 2025 年 9 月 12 日前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 1,405,047.08 元，上述款项已于 2025 年 9 月 16 日前支付。

2、应付管理人报酬

本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,950.54 元，上述款项已于 2025 年 9 月 12 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 658.41 元，上述款项已于 2025 年 9 月 12 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 2,033.73 元，上述款项已于 2025 年 9 月 12 日支付。

5、其他负债

本基金最后运作日其他负债为人民币 114,371.18 元，其中预提审计费人民币 31,192.37 元，预提信息披露费人民币 83,178.81 元。截止清算结束日其他负债为人民币 114,371.18 元，

上述款项于清算结束后支付。

（三）清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	附注	2025 年 9 月 11 日 至 2025 年 9 月 23 日止 清算期间
一、清算收益		-26,880.69
1. 利息收入	(1)	10,151.28
2. 投资收益（损失以“-”填列）	(2)	258,743.95
3. 公允价值变动损益（损失以“-”填列）	(3)	-295,775.92
二、清算支出		0.00
其他费用		0.00
三、清算净收益		-26,880.69

注（1）利息收入为计提的自2025年9月11日本基金进入清算程序起至2025年9月23日（清算结束日）的银行活期存款利息收入、其他存款利息收入。

（2）投资收益为自2025年9月11日本基金进入清算程序起至2025年9月23日（清算结束日）的交易性基金投资差价收入人民币258,743.95元。

（3）公允价值变动损益为自2025年9月11日本基金进入清算程序起至2025年9月23日（清算结束日）的交易性基金投资公允价值变动损益人民币-295,775.92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2025年9月10日基金净资产		47,962,673.79
加：清算期间净收益		-26,880.69
清算期间从持有人权益转出		0.00
二、清算终止日2025年9月23日基金净资产		47,935,793.10

根据本基金基金合同的约定，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，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

（一）备查文件目录

《国投瑞银兴源6个月定期开放混合型基金中基金（FOF）清算审计报告》

《上海源泰律师事务所关于国投瑞银兴源6个月定期开放混合型基金中基金（FOF）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>、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

国投瑞银兴源6个月定期开放混合型基金中基金（FOF）基金财产清算小组

2025年9月25日