

百嘉百川 30 天持有期纯债债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：百嘉基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

清算报告出具日：2026 年 06 月 02 日

清算报告公告日：2026 年 06 月 09 日

一、重要提示

百嘉百川 30 天持有期纯债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证监许可〔2023〕1642 号《关于准予百嘉百川 30 天持有期纯债债券型证券投资基金注册的批复》进行募集，由百嘉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《百嘉百川 30 天持有期纯债债券型证券投资基金合同》（以下简称《基金合同》）负责公开募集。《基金合同》于 2024 年 4 月 29 日正式生效，基金管理人为百嘉基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

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》等法律法规规定及《基金合同》的有关约定，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于终止百嘉百川 30 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。该表决事项于 2026 年 05 月 07 日生效，详见基金管理人 2026 年 05 月 08 日于官网、证券时报、中国证监会基金电子披露网站上刊登的《关于百嘉百川 30 天持有期纯债债券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、中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市康达律师事务所于 2026 年 05 月 08 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，北京市康达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	百嘉百川30天持有期纯债债券型证券投资基金
基金简称	百嘉百川30天持有纯债债券
基金主代码	019056
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年04月29日
最后运作日基金份额总额 (2026年05月07日)	478,568.82份

投资目标	<p>本基金为纯债债券型基金，管理人主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的久期、期限结构、类属品种进行有效配置，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。</p>
投资范围	<p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、政府支持机构债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、地方政府债、次级债）、资产支持证券、债券回购、国债期货、银行存款、同业存单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的相关规定。</p> <p>本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券、可交换债券。</p> <p>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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p>
投资策略	<p>本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况进行调整，资产配置组合主要以债券等固定收益类资产配置为主，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。</p> <p>债券投资策略上，债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用债投资策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>本基金其他策略包括：信用债投资策略、国债期货投资策略。</p>
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	百嘉基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	百嘉百川30天持有纯 债债券A	百嘉百川30天持有纯债 债券C
下属分级基金的交易代码	019056	019057
最后运作日下属分级基金 的份额总额	94,682.84份	383,885.98份

三、基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可〔2023〕1642号《关于准予百嘉百川30天持有期纯债债券型证券投资基金注册的批复》进行募集。百嘉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。《基金合同》于2024年4月29日正式生效。首次募集份额合计200,230,241.93份（A类200,027,302.76份、C类202,939.17份）。

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》等法律法规规定及《基金合同》的有关约定，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议并表决通过了《关于终止百嘉百川30天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，该表决事项于2026年05月07日生效。本基金的最后运作日为2026年05月07日，自2026年05月08日起进入清算期。

四、财务会计报告(经审计)

资产负债表

会计主体：百嘉百川30天持有期纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2026年05月07日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	基金最后运作日（2026年05月07日）
资 产：	
货币资金	80,670.10
存出保证金	885.29
交易性金融资产	403,540.27

其中：债券投资	403,540.27
资产总计	485,095.66
负债和净资产	基金最后运作日（2026年05月07日）
负 债：	
应付赎回款	15,132.61
应付管理人报酬	27.78
应付托管费	9.24
应付销售服务费	14.94
应交税费	17.74
其他负债	2,684.92
负债合计	17,887.23
净资产：	
实收基金	478,568.82
未分配利润	-11,360.39
净资产合计	467,208.43
负债和净资产总计	485,095.66

注：1、基金最后运作日 2026 年 05 月 07 日，基金份额 A 类份额净值 0.9799 元，C 类份额净值 0.9754 元，基金份额总额 478,568.82 份，其中 A 类基金份额总额 94,682.84 份，C 类基金份额总额 383,885.98 份。

2、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》的有关规定编制的。于 2026 年 05 月 07 日（基金最后运作日），所有资产以可收回金额与账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

五、清算情况

自 2026 年 05 月 08 日至 2026 年 05 月 13 日止清算期间，百嘉百川 30 天持有期纯债债券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、清算费用

（1）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，根据百嘉基金管理有限公司《百嘉百川 30 天持有期纯债债券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》，本基金清算期间不计提管理费、托管费、销售服务费，且清算费用公证费、律师费、审计费等由基金管理人承担。

(2) 经与托管人协商，本基金计提清算期银行汇划费 60.00 元。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款 80,670.10 元，是存储于基金托管人上海银行股份有限公司管理的托管户的活期银行存款及按约定利率计提的利息。

(2) 本基金最后运作日存出保证金 885.29 元，是存放于证券经纪机构用于场内交易的资金及按约定利率计提的利息。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产 403,540.27 元，均为交易类债券投资资产，本基金已于 2026 年 5 月 8 日完成全部交易性金融资产的变现。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日其他负债 2684.92 元，为本基金计提的 2026 年度审计费和信息披露费，根据本基金实际运作情况，该费用于 2026 年 5 月 8 日核准冲销。

(2) 本基金最后运作日应付赎回款 15,132.61 元，该款项已于 2026 年 5 月 8 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 27.78 元，该款项已于 2026 年 5 月 11 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为 9.24 元，该款项已于 2026 年 5 月 11 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为 14.94 元，该款项已于 2026 年 5 月 11 日支付。

(6) 本基金最后运作日应付税费为 17.74 元，清算期内交易性金融资产计提的税费 0.50 元，该款项已于 2026 年 5 月 11 日合并支付 18.24 元。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2026 年 5 月 7 日基金净资产	467,208.43
加：清算期间（2026-5-8 至 2026-5-13）收入	
利息收入（注 1）	43.94
投资收益（注 2）	-6.51
公允价值变动损益（注 3）	56.80
减：清算期间（2026-5-8 至 2026-5-13）费用	
税金及附加（注 4）	0.06
其他费用（注 5）	-2624.92
二、2026 年 5 月 13 日基金净资产	469,927.52

注1、利息收入系自2026年5月8日至2026年5月13日止清算期间的银行存款、存出保证金计提利息。

注2、投资收益系清算期间卖出所持债券获得的投资收益。

注3、公允价值变动损益系清算期间所持债券的公允价值变动损益。

注4、税金及附加为清算期间债券资产所产生的税费。

注5、清算期冲销审计费、信披费2684.92元及计提银行汇划费60.00元，合计-2624.92元，实际银行划款费用与预提费用差额由管理人承担。

资产处置及负债清偿后，于清算结束日 2026 年 5 月 13 日本基金剩余财产为人民币 469,927.52 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。

清算结束日次日 2026 年 5 月 14 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，截至清算款划出日前一日的银行存款利息中仍未收到的部分将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。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。

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、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1)《百嘉百川 30 天持有期纯债债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《百嘉百川 30 天持有期纯债债券型证券投资基金清算事宜之法律意见》

2、存放地点

基金管理人办公场所：广州市海珠区新港东路 89 号索菲亚发展中心 24 楼

03-06 单元

3、查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人

客户服务电话：4008258838

百嘉百川 30 天持有期纯债债券型证券投资基金基金财产清算小组

2026 年 06 月 02 日