

# 交银施罗德瑞利定期开放 灵活配置混合型 证券投资基金清算报告

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年5月31日

清算报告公告日：2018年7月19日

## 一、重要提示

交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由交银施罗德基金管理有限公司担任基金管理人，由招商银行股份有限公司担任基金托管人，本基金根据 2016 年 11 月 29 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2902 号文）进行募集，基金合同于 2017 年 2 月 24 日生效。

根据《交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）“第五部分 基金备案”中，“《基金合同》生效后，在任一开放期最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），发生下列情形之一的，本基金将自动终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会：1、基金份额持有人数量不满 200 人；2、当日基金资产净值加上当日净申购金额或者减去当日净赎回金额后低于 5000 万元。”的条款以及《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”的有关规定，本基金第二个开放期的最后一个开放日（即 2018 年 3 月 27 日）日终，基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额为 1,713,986.30 元，基金份额持有人人数 191 人，已触发《基金合同》中约定的本基金终止条款。为维护基金份额持有人的利益，根据《基金合同》有关规定，无须召开持有人大会，本基金将终止并进入清算程序。基金管理人已于 2018 年 3 月 24 日、2018 年 3 月 29 日就本基金基金合同终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告和提示性公告，详见《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告》、《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同触发终止情形及进入基金财产清算程序的公告》。

本基金自 2018 年 3 月 28 日起进入清算期，由基金管理人交银施罗德基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和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，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

### 1、基金基本情况

基金名称：	交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金简称：	交银瑞利定期开放灵活配置混合
基金交易代码：	004064
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2017 年 2 月 24 日

基金管理人名称:	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人名称:	招商银行股份有限公司

## 2、基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，力争为投资者提供长期稳健的投资回报
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，自上而下灵活调整基金大类资产配置比例和股票行业配置比例，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选股票和债券；在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争获取投资组合的较高回报。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其风险和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，属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

## 三、财务会计报告

### 资产负债表（经审计）

会计主体：交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金

最后运作日：2018 年 3 月 27 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日	负债和所有者权益	最后运作日
	2018/03/27		2018/03/27
<b>资 产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	31,036,393.97	短期借款	-
结算备付金	1,504,772.50	交易性金融负债	-
存出保证金	25,482.25	衍生金融负债	-
交易性金融资产	-	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	21,370,031.86
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	104,689.49
基金投资	-	应付托管费	17,448.24
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	64,680.44
应收证券清算款	-	应付税费	6,743.49

应收利息	7,243.04	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	308,948.44
其他资产	-	<b>负债合计</b>	21,872,541.96
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	10,016,588.03
		未分配利润	684,761.77
		<b>所有者权益合计</b>	10,701,349.80
<b>资产合计：</b>		<b>负债与持有人权益总计：</b>	
	32,573,891.76		32,573,891.76

#### 四、清算报表附注

##### 1、基金基本情况

交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2016年11月29日由中国证监会《关于准予交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2902号文）准予募集注册，由交银施罗德基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规的规定和《交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关约定，于2017年2月14日至2017年2月20日公开募集。募集结束后，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）“交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金设立验资报告”验证，并由中国证监会证券基金机构监管部《关于交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2017]469号）予以备案，本基金基金合同于2017年2月24日生效。本基金募集期间扣除认购费的实收基金（本金）人民币600,004,270.45元，折合600,004,270.45份基金份额；有效认购资金在初始销售期内产生的利息为人民币31,501.42元，折合31,501.42份基金份额，本基金在基金合同生效日的基金份额总额600,035,771.87份。本基金基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规的规定和《交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货、权证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）。

根据《交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及交银施罗德基金管理有限公司于2018年3月30日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，2018年3月27日未赎回的基金份额，于2018年3月28日全部进入清算程序。

## 2、清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中，“《基金合同》生效后，在任一开放期最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），发生下列情形之一的，本基金将自动终止基金合同并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会：1、基金份额持有人数量不满200人；2、当日基金资产净值加上当日净申购金额或者减去当日净赎回金额后低于5000万元。”的条款以及《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”的有关规定，本基金第二个开放期的最后一个开放日（即2018年3月27日）日终，基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额为1,713,986.30元，基金份额持有人人数191人，已触发《基金合同》中约定的本基金终止条款。为维护基金份额持有人的利益，根据《基金合同》有关规定，无须召开持有人大会，本基金将终止并依据基金财产清算程序进行财产清算。

## 3、清算起始日

根据《交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自2018年3月28日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为2018年3月28日。

## 4、清算报表编制基础

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。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 五、清算情况

自2018年3月28日至2018年5月31日止清算期间，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。具体清算情况如下：

### 1、清算费用

按照《交银施罗德瑞利定期开放灵活配置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。但从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算期间的律师费由基金管理人承担。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 1,504,772.50 元、存出保证金为人民币 25,482.25 元。2018 年 4 月 3 日, 备付金调增 3,326,136.59 元, 保证金调减 25,482.25 元划入托管账户; 2018 年 5 月 3 日, 备付金调减 4,830,909.09 元划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币共计 7,243.04 元。

(3) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 0 元。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 21,370,031.86 元, 其中人民币 21,370,031.86 元已于 2018 年 3 月 29 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 104,689.49 元, 该款项于 2018 年 4 月 4 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 17,448.24 元, 该款项于 2018 年 4 月 4 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0 元。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 64,680.44 元, 其中人民币 60,334.48 元已于 2018 年 4 月 13 日支付, 人民币 1,375.96 元已于 2018 年 4 月 16 日支付, 人民币 2,970.00 元已于 2018 年 4 月 17 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 308,948.44 元, 其中应付 2017 年度审计费人民币 60,000 元于 2018 年 4 月 27 日支付, 应付 2018 年度审计费人民币 20,000 元于 2018 年 5 月 25 日支付; 应付信息披露费人民币 208,000.00 元已于 2018 年 5 月支付, 剩余预提信息披露费 8,548.44 元冲回; 因及时销户预提多出的中债账户维护费 1500 元、上清账户维护费 1900 元, 也已进行冲回处理。

### 4、清算期间的损益情况

自 2018 年 3 月 28 日至 2018 年 5 月 31 日止清算期间

项目	金额 (单位: 人民币元)
一、清算收益	
利息收入 (注 1)	11,314.26
债券利息收入	-
债券投资收益 (损失以“-”填列)	-
股票投资收益 (损失以“-”填列)	-
公允价值变动损益 (损失以“-”填列)	-
其他收入 (损失以“-”填列)	-
清算收入小计 (1)	11,314.26
二、清算费用	
银行划款手续费	5,386.66

交易费用	-
其他费用	-
其他费用（注2）	-11,948.44
清算费用小计（2）	-6,561.78
三、清算净收益（1）-（2）	17,876.04

注：上表所有的收入金额数据为包含了2018年3月28日至2018年5月31日的数据。

1：利息收入系计提的自2018年3月28日至2018年5月31日止清算期间的银行存款利息收入、清算备付金利息收入和存出保证金利息收入。

2：其他费用（注2）人民币-11,948.44元由冲回预提信息披露费-8,548.44元及冲回预提账户维护费-3,400元构成。

3：本基金清算期间的律师费由基金管理人承担。

#### 5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额（单位：人民币元）
一、最后运作日2018年3月27日基金净资产	10,701,349.80
加：清算期间净收益	17,876.04
减：2018年3月28日确认的净赎回款	8,988,053.09
二、2018年5月31日基金净资产	1,731,172.75

资产处置及负债清偿后，2018年5月31日本基金剩余财产为人民币1,731,172.75元，根据本基金的基金合同约定，依据基金从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、缴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。若后续清算中出现资产不足以支付债务的情况，以持有人利益考虑，由管理人承担。

清算起始日2018年3月28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。截至2018年5月31日止的应收利息共计人民币18,557.3元（以当前适用的利率预估），将由基金管理人以自有资金垫付，于清算款划出日前划入托管账户。2018年5月31日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦由基金管理人以自有资金垫付。实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

#### 6、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后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) 《交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

## 2、存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（<http://www.fund001.com>）查阅。

## 3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

交银施罗德瑞利定期开放灵活配置混合型证券投资基金  
基金财产清算小组  
2018年7月19日