

中融中证一带一路主题指数分级证券投资 基金清算报告

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：2020 年 11 月 25 日

清算报告公告日：2020 年 12 月 24 日

一、重要提示及目录

1、重要提示

中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”或“中融一带一路”)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〔2015〕760号文注册,于2015年5月14日基金合同生效,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“运作办法”)、《中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)的有关规定,中融基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,由基金管理人召集,以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于2020年10月21日表决通过了《关于终止中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同以及一带 A 份额、一带 B 份额终止上市有关事项的议案》,决定终止本基金基金合同。基金份额持有人大会的表决结果暨决议生效的公告详见2020年10月22日基金管理人网站(www.zrfunds.com.cn)上的《关于中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

本基金自2020年11月05日起进入清算程序。由基金管理人中融基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、上会会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所于2020年11月05日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由上会会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、目录

一、重要提示及目录.....	2
1、重要提示.....	2
2、目录.....	3
二、基金概况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清算事项说明.....	6
1、基本情况.....	6
2、清算原因.....	6
3、清算起始日.....	7
4、清算报表编制基础.....	7
五、清算情况.....	7
1、资产处置情况.....	7
2、负债清偿情况.....	8
3、所有者权益情况.....	9
4、清算期间的清算损益情况、.....	9
5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况.....	10
6、基金财产清算报告的告知安排.....	11
六、备查文件目录.....	11
1、备查文件目录.....	11
2、存放地点.....	11
3、查阅方式.....	11

二、基金概况

- 1、基金名称：中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金
- 2、基金简称：中融一带一路（基金代码：168201）、一带 A（基金代码：150265）、一带 B（基金代码：150266）
- 3、基金运作方式：契约型开放式
- 4、基金合同生效日：2015 年 5 月 14 日
- 5、2020 年 11 月 04 日（基金最后运作日）基金份额总额：123,926,933.97 份
- 6、投资目标：本基金采用指数化投资策略，通过严谨的数量化管理和严格的投资程序，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，实现对中证一带一路主题指数的有效跟踪。
- 7、投资策略：本基金主要采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证一带一路主题指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。
1. 资产配置策略
2. 股票投资组合构建
3. 债券投资策略
4. 股指期货投资策略
- 8、业绩比较基准： $95\% \times \text{中证一带一路主题指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$
- 9、风险收益特征：本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所自动分离或分拆的两类基金份额来看，一带一路 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征；一带一路 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。
- 10、基金管理人：中融基金管理有限公司
- 11、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金

最后运作日：2020 年 11 月 04 日

单位：人民币元

项目	基金最后运作日 2020 年 11 月 04 日
资产：	
银行存款	12,911,121.83
清算备付金	18,089.69
存出保证金	93,009.90
股票投资	129,461,147.39
应收利息	20,547.06
证券清算款	1,858,361.56
资产合计	144,362,277.43
负债：	
应付赎回款	5,941,882.97
应付赎回费	1,827.63
应付管理人报酬	19,246.54
应付托管费	4,234.24
应付交易费用	101,865.96
应交税费	1.56
其他应付款	70,652.17
预提费用	118,195.59
负债合计	6,257,906.66
所有者权益：	
实收基金	269,477,359.92
未分配利润	-131,372,989.15
所有者权益合计	138,104,370.77
负债及所有者权益合计	144,362,277.43

四、清算事项说明

1、基本情况

本基金经中国证监会证监许可〔2015〕760号文《关于准予中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金注册的批复》批准，由基金管理人中融基金管理有限公司依照《基金法》、《运作办法》和《基金合同》进行公开募集，并于2015年5月14日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证一带一路主题指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）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）。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证一带一路主题指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$ 。

2、清算原因

根据《基金合同》“第二十五部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“（二）本基金合同的终止”的约定：

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4. 基金合同约定的其他情形；
5. 法律法规和中国证监会规定的其它情况。

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》和《中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，基金管

理人经与基金托管人中国农业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，审议终止本基金基金合同相关事项的议案，会议审议并通过了终止基金合同相关事项的议案，并依法履行基金财产清算程序。

3、清算起始日

根据《基金合同》及《关于中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，2020年11月04日为本基金最后运作日，本基金于2020年11月05日进入清算期，故本基金清算起始日为2020年11月05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。本基金自最后运作日起，资产负债按实际清算价格计价。

五、清算情况

自2020年11月05日至2020年11月25日止为本基金清算报告期，中融一带一路自清算起始日起，中融一带一路基金财产清算小组成立，并对中融一带一路的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行，具体情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币12,911,121.83元，清算期间收到卖出股票款项共计人民币133,207,214.35元。清算期间支付赎回款、赎回费合计人民币9,942,119.80元，支付未结管理费19,246.54元，支付未结托管费4,234.24元，支付未结交易费用198,055.46元，支付未结律师费15,000.00元，支付未结三季度指数使用费43,851.10元，支付未结信息披露费101,311.83元，支付清算审计费16,883.76元，支付银行汇划费575.01元，支付增值税及附加1.56元。

截止本基金清算期结束日(2020年11月25日)银行存款余额为人民币135,777,056.88元。

(2) 本基金最后运作日清算备付金人民币18,089.69元，存出保证金人民币93,009.90元，其中清算备付金将于2020年12月02日由中国证券登记结算有限责任公司返还至托管户。根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，存出保证金将于所有证券交易结束后约6个月返还至托管户。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 1,858,361.56 元,该款项于 2020 年 11 月 05 日转入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收银行存款利息人民币 19,229.23 元、应收存出保证金利息人民币 73.25 元,应收结算备付金利息人民币 1,244.58 元,共计人民币 20,547.06 元。该款项将于 2020 年 12 月 21 日(银行季度结息日)结息至托管账户,具体金额以实际结息时为准。

(5) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 129,461,147.39 元(股票投资最后运作日估值金额)。本基金清算期间卖出所持有的剩余可流通股股票。

截止清算期结束日(2020 年 11 月 25 日),本基金持有的股票投资为人民币 253,432.16 元(股票投资于清算期结束日估值金额),为本基金持有的处于限售期的股票投资,本基金将于该类股票解除限售后及时进行变现。明细如下:

金额单位:人民币元

股票名称	股票代码	清算期结束日 (2020 年 11 月 25 日) 估值单价	数量(股)	清算期结束日 (2020 年 11 月 25 日) 估值总额
恒誉环保	688309	38.56	2,345	90,423.20
燕麦科技	688312	33.24	4,904	163,008.96

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日赎回款合计为人民币 5,941,882.97 元,应付赎回费为人民币 1,827.63 元,分别于 2020 年 11 月 5 日、11 月 06 日从托管账户划出。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 19,246.54 元,该款项已于 2020 年 11 月 11 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,234.24 元,该款项已于 2020 年 11 月 11 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 101,865.96 元,该款项已于 2020 年 11 月 11 日支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 1.56 元,该款项已于 2020 年 11 月 10 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他应付款为人民币 70,652.17 元, 其中人民币 40,000.00 元为第 3 季度指数使用费, 本基金管理人在取得中证指数有限公司的发票后于 2020 年 11 月 16 日进行了支付, 另根据中证指数公司的现行政策, 经本基金管理人与指数公司沟通对已计提的指数使用费进行了冲减, 即将原已计提的第 4 季度指数使用费 15,652.17 元冲减为人民币 3,851.10 元, 并于 2020 年 11 月 25 日支付。另有人民币 15,000.00 元为本基金清算期间产生的律师费, 已于 2020 年 11 月 12 日支付。

(7) 本基金最后运作日预提费用为人民币 118,195.59 元, 其中审计费用人民币 16,883.76 元, 该款项已于 2020 年 11 月 23 日支付; 信息披露费人民币 101,311.83 元, 该款项已于 2020 年 11 月 24 日支付。

3、所有者权益情况

最后运作日基金净资产为 138,104,370.77 元, 基金份额共 123,926,933.97 份; 清算期结束日本基金剩余财产为 136,211,770.51 元, 基金份额共 120,315,425.51 份。

4、清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	清算期 (2020 年 11 月 05 日至 2020 年 11 月 25 日) 发生额
一、清算期间收入	
1、存款利息收入 (注 1)	49,634.82
2、赎回费收入	24,811.24
3、投资收益 (损失以“-”号填列)	-3,043,986.24
4、公允价值变动损益 (损失以“-”填列)	5,328,309.26
清算期间收入小计	2,358,769.08
二、清算期间费用	
1、交易费用 (注 2)	239,374.96
2、其他费用 (注 3)	-11,226.06
清算期间费用小计	228,148.90
三、清算净收益 (清算净损失以“-”表示)	2,130,620.18

注 1: 存款利息收入包括中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金清算起始日 2020 年 11 月

05 日至 2020 年 11 月 25 日形成的银行存款利息收入人民币 49,529.82 元、备付金利息收入人民币 17.22 元、保证金利息收入人民币 87.78 元，共计人民币 49,634.82 元。

注 2：交易费用为卖出股票产生的费用。

注 3：其他费用为清算期间冲减的已计提的第 4 季度指数使用费人民币 11,801.07 元，清算期间产生银行汇划费人民币 575.01 元。

5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况

单位：人民币元	
项目	金额
一、最后运作日 2020 年 11 月 04 日基金净资产	138,104,370.77
加：清算期间净收益	2,130,620.18
减：清算期间确认的赎回款及赎回费（含赎回费收入）（注）	4,023,220.44
二、清算结束日 2020 年 11 月 25 日基金净资产	136,211,770.51

注：清算期间确认的赎回款及赎回费为 2020 年 11 月 4 日投资者提交的赎回申请。

根据《基金合同》中关于基金财产清算的相关约定，基金财产清算小组将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。同时，《基金合同》“十一、基金合同当事人及权利义务”中“（五）基金份额持有人”项下约定：“中融一带一路份额、一带一路 A 份额和一带一路 B 份额仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。如果一带一路 A 份额和一带一路 B 份额终止运作，则在终止一带一路 A 份额和一带一路 B 份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。”基金财产将按照上述分配原则进行分配。

由于本基金截至清算期结束日（2020 年 11 月 25 日）所持限售股票尚未解禁，本基金将于未变现资产全部变现后，将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2020 年 11 月 5 日至基金财产分配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。如前述利息和存出保证金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）和未返还的存出保证金将由基金管理人中融基金管理有限公司以自有资金垫付至托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起

孳生的利息将于利息结清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，将与会计师事务所出具的审计报告、律师事务所出具法律意见书，一并报中国证监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) 《中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金清算报告〉的法律意见》。

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内至基金管理人的办公场所免费查阅。

中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金财产清算小组

2020 年 11 月 25 日