

# 交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资 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：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年6月25日

清算报告公告日：2018年8月24日

## 一、重要提示

交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金（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，由兴业银行股份有限公司担任基金托管人，本基金根据 2016 年 3 月 11 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裕兴纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016] 496 号文）进行募集，基金合同于 2016 年 9 月 7 日生效。

根据《交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于 2018 年 5 月 15 日表决通过的《关于终止交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及本基金管理人于 2018 年 5 月 16 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德裕兴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》，本基金的最后运作日为 2018 年 5 月 16 日，自 2018 年 5 月 17 日起，本基金进入清算程序。

本基金自 2018 年 5 月 17 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、基金托管人兴业银行股份有限公司、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：	交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金
基金简称：	交银裕兴纯债债券
基金交易代码：	519774
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2016 年 9 月 7 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：	兴业银行股份有限公司

### 2、基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争较高的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，在分析和判断宏观经济趋势、货币及财政政策趋势和金

	融市场运行趋势的基础上，动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期、期限结构、债券类别配置策略，在严谨深入的分析基础上，综合考量政府债券、信用债等不同债券板块的流动性、供求关系和收益率水平等，深入挖掘价值被低估的标的券种。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，其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，属于证券投资基金中中等风险的品种。

### 三、财务会计报告

#### 资产负债表（经审计）

会计主体：交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金

最后运作日：2018年5月16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
	2018/05/16		2018/05/16
<b>资 产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	12,895.54	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	12,012,000.00	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	12,012,000.00	应付赎回款	-
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	1,717.58
基金投资	-	应付托管费	572.51
衍生金融资产	-	应付销售服务费	1,520.53
买入返售金融资产	-	应付交易费用	-
应收证券清算款	-	其他应付款	-
应收利息	347,660.23	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	86,720.00
其他资产	-	<b>负债合计</b>	<b>90,530.62</b>
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	11,920,934.85
		未分配利润	361,090.30
		<b>所有者权益合计</b>	<b>12,282,025.15</b>

资产合计:		负债与持有人权益总计:	
	12,372,555.77		12,372,555.77

#### 四、清算报表附注

##### 1、基金基本情况

交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2016年3月11日由中国证监会《关于准予交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]496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《交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关约定，于2016年8月31日至2016年9月1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）“交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金设立验资报告”验证，并由中国证监会证券投资基金监管部《关于交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2016]2125号）予以备案，本基金基金合同2016年9月7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200,061,410.40元，折合200,061,410.40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36,010.44元，折合36,010.44份基金份额，本基金在基金合同生效日的基金份额总额200,097,420.84份。本基金基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为兴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》等相关法律法规的规定和《交银施罗德裕兴纯债债券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国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、货币市场工具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）。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金不参与可转换债券投资（分离交易可转债除外）。

根据《交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于2018年5月15日表决通过的《关于终止交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及本基金管理人于2018年5月16日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德裕兴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》，本基金的最后运作日为2018年5月16日，自2018年5月17日起，本基金进入清算程序。

##### 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，连续二十个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当在定期报

告中予以披露。连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。”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，鉴于自《基金合同》生效后，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金管理人于 2018 年 4 月 9 日发布了《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2018 年 5 月 15 日基金份额持有人大会审议并表决通过了《关于终止交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，决定终止《基金合同》。本基金自 2018 年 5 月 17 日起进入清算程序，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《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德裕兴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》，自 2018 年 5 月 17 日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为 2018 年 5 月 17 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 5 月 17 日至 2018 年 6 月 25 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《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德裕兴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》，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，本基金的清算费用将由基金管理人承担。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金、存出保证金为人民币 0 元。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币共计 347,660.23 元，其中 347,210.96 元于 2018 年 5 月 23 日按实际金额划入托管账户；449.27 元于 2018 年 6 月 21 日按实际金额划入托管账户。

(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 0 元。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,717.58 元，该款项于 2018 年 6 月 5 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 572.51 元，该款项于 2018 年 6 月 5 日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,520.53 元，该款项于 2018 年 6 月 5 日支付。
- (5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 0 元。
- (6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 86,720.00 元，其中应付信息披露费人民币 52,000.00 元已于 2018 年 5 月 18 日、2018 年 6 月 8 日支付。债券账户维护费和预提银行费用人民币 4,720.00 元已于 2018 年 6 月 1 日支付。应付审计费人民币 30,000.00 元已于 2018 年 6 月 25 日支付。

### 4、清算期间的损益情况

自 2018 年 5 月 17 日至 2018 年 6 月 25 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）	18,933.77
债券利息收入	7,061.92
债券投资收益（损失以“-”填列）	1,716.00
清算收入小计（1）	27,711.69
二、清算费用（2）	
清算费用小计（2）	-
三、清算净收益（1）-（2）	27,711.69

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 5 月 17 日至 2018 年 6 月 25 日止清算期间的银行存款利息收入。

注 2：本基金清算期间的所有费用由基金管理人承担。

### 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 5 月 16 日基金净资产	12,282,025.15
加：清算期间净收益	27,711.69
减：2018 年 5 月 17 日确认的净赎回款	-

二、2018年6月25日基金净资产	12,309,736.84
-------------------	---------------

资产处置及负债清偿后，2018年6月25日本基金剩余财产为人民币12,309,736.84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。

清算起始日2018年5月17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6月25日止的应收利息共计人民币2,785.40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6月25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) 《交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《交银施罗德裕兴纯债债券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。

交银施罗德裕兴纯债债券型证券投资基金  
基金财产清算小组  
2018年8月24日