交银施罗德天运宝货币市场基金清算报告

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：2019 年 8 月 19 日

清算报告公告日：2019 年 9 月 19 日

一、重要提示

交银施罗德天运宝货币市场基金（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 2017 年 7 月 5 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天运宝货币市场基金注册的批复》（证监许可[2017]1136 号文）进行募集，基金合同于 2017 年 12 月 29 日生效。

根据《交银施罗德天运宝货币市场基金基金合同》（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，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，基金管理人可向中国证监会报告并提前终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。”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，截至 2019 年 8 月 1 日日终，本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，触发了《基金合同》中约定的基金合同终止条款，本基金将终止并依据基金财产清算程序进行财产清算，无需召开基金份额持有人大会。基金管理人已于 2019 年 8 月 2 日、2019 年 8 月 6 日就本基金基金合同触发终止情形及进入基金财产清算程序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天运宝货币市场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》、《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德天运宝货币市场基金基金合同触发终止情形及进入基金财产清算程序的提示性公告》。

本基金自 2019 年 8 月 9 日起进入清算程序，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）和上海市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，上海市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：　交银施罗德天运宝货币市场基金

基金简称：　交银天运宝货币

基金交易代码：　A 类：005002；E 类:005003

基金运作方式：　契约型开放式

基金合同生效日：　2017 年 12 月 29 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

在力求本金安全性和资产充分流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。

投资策略

本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法。

业绩比较基准 活期存款利率（税后）
风险收益特征
本基金属于货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，长期风险收益
水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
三、财务会计报告
资产负债表（经审计）
会计主体：交银施罗德天运宝货币市场基金
最后运作日：2019 年 8 月 8 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
2019/08/08 2019/08/08
资 产 ： 负债:
银行存款 9,836,337.52 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 - 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 -
资产支持证券投资 - 应付管理人报酬 429.28
基金投资 - 应付托管费 143.07
衍生金融资产 - 应付销售服务费 427.27
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 19,984.27 应付利息 -
应收股利 - 应付利润 851.65
应收申购款 - 其他负债 70,790.20
其他资产 - 负债合计 72,641.47
所有者权益：
实收基金 9,783,680.32
未分配利润
所有者权益合计 9,783,680.32
资产合计: 9,856,321.79 负债与持有人权益总计： 9,856,321.79
四、清算报表附注
1、基金基本情况
交银施罗德天运宝货币市场基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 7 月 5 日由中国证监会《关于准予交银施罗德天运宝货币市场基金注册的批复》（证监许可[2017]1136 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《交银施罗德天运宝货币市场基金基金合同》《交银施罗德天运宝货币市场基金招募说明书》的有关约定，自 2017 年 9 月 6 日至 2017 年 9 月 7 日、自 2017 年 11 月 28 日至 2017 年 12 月 5 日止公开募集。募集结束后，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）“交银施罗德天运宝货币市场基金设立验资报告”验证，并由中国证监会证券基金机构监管部《关于交银施罗德天运宝货币市场基金备案确认的函》（机构部函[2017]2994 号）予以备案，本基金基金合同于 2017 年 12 月 29 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 220,018,503.81 元，折合 220,018,503.81 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 9,969.42 元，折合 9,969.42 份基金份额，本基金在基金合同生效日的基金份额总额

220,028,473.23 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《交银施罗德天运宝货币市场基金基金合同》的约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

根据《交银施罗德天运宝货币市场基金基金合同》及交银施罗德基金管理有限公司于 2019 年 8 月 2 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德天运宝货币市场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》，2019 年 8 月 8 日未赎回的基金份额，于 2019 年 8 月 9 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，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，基金管理人可向中国证监会报告并提前终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。”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，截至 2019 年 8 月 1 日日终，本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，触发了《基金合同》中约定的基金合同终止条款，本基金将终止并依据基金财产清算程序进行财产清算，无需召开基金份额持有人大会。

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天运宝货币市场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》，自 2019 年 8 月 9 日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为 2019 年 8 月 9 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 2019 年 8 月 9 日至 2019 年 8 月 19 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《交银施罗德天运宝货币市场基金基金合同》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，本基金清算期间的审计费、律师费由基金管理人承担。

2、资产处置情况

本基金最后运作日应收利息为人民币共计 19,984.27 元，将于 2019 年 9 月 21 日按实际金额划入托管账户。

3、负债清偿情况

（1） 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 429.28 元，该款项于 2019 年 8 月 13 日支付。

（2）本基金最后运作日应付托管费为人民币 143.07 元，该款项于 2019 年 8 月 13 日支付。

（3）本基金最后运作日其他负债为人民币 70,790.20 元，其中应付审计费人民币 28,000.00 元和应付信息披露费人民币 33,000.00 元已于 2019 年 8 月 13 日支付；应付账户维护费人民币 9,300.00 元,其中 3,100.00 元已于 2019 年 8 月 13 日支付，6,200.00 元于 2019 年 8 月 16 日回冲。

4、清算期间的损益情况

自 2019 年 8 月 9 日至 2019 年 8 月 19 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） 2,972.74

清算收入小计（1） 2,972.74

二、清算费用

银行划款手续费 -

银行间账户维护费 -6,200.00

清算费用小计（2） -6,200.00

三、清算净收益（1）-（2） 9,172.74

注 1： 利息收入系计提的自 2019 年 8 月 9 日至 2019 年 8 月 19 日止清算期间的银行存款利息和存出保证金利息。

注 2：本基金清算期间的审计费、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 2019 年 8 月 8 日基金净资产 9,783,680.32

加：清算期间净收益 9,172.74

加：最后运作日次日红利再投 851.65

减：2019 年 8 月 9 日确认的净赎回款 3,191,441.47

二、2019 年 8 月 19 日基金净资产 6,602,263.24 资产处置及负债清偿后，2019 年 8 月 19 日本基金剩余财产为人民币 6,602,263.24 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 2019 年 8 月 9 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 2019 年 8 月 19 日止的应收利息共计人民币 23,253.12 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。2019 年 8 月 9 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）《交银施罗德天运宝货币市场基金清算审计报告》；

（2）《交银施罗德天运宝货币市场基金清算报告》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（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。

交银施罗德天运宝货币市场基金

基金财产清算小组

2019 年 9 月 19 日