

# 交银施罗德全球自然资源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：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年8月12日

清算报告公告日：2019年9月20日

## 一、重要提示

交银施罗德全球自然资源证券投资基金（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，由中国建设银行股份有限公司担任基金托管人，本基金根据2011年10月10日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准交银施罗德全球自然资源证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1628号文）进行募集，基金合同于2012年5月22日生效。

根据《交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金合同》中“八、基金份额持有人大会”之“（二）召开事由”约定：“1. 当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：（1）终止基金合同，但在基金规模低于5000万元的情况下除外”，以及“二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”之“（二）本基金合同的终止”约定：“4. 若基金规模低于5000万元，基金管理人有权在不召开基金份额持有人大会的情况下终止基金合同”；同时，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条，连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当提出解决方案。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，根据基金合同约定，本基金管理人决定终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，该基金合同终止无需召开基金份额持有人大会审议。基金管理人已于2019年7月24日、2019年7月26日就本基金基金合同终止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全球自然资源证券投资基金基金合同终止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全球自然资源证券投资基金基金合同终止及进入基金财产清算程序的提示性公告》。

本基金自2019年7月31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、基金托管人中国建设银行股份有限公司、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：交银施罗德全球自然资源证券投资基金

基金简称：交银全球资源混合(QDII)

基金交易代码：519709

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012年5月22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：中国建设银行股份有限公司

### 2、基金产品说明

#### 投资目标

在全球范围内精选自然资源相关行业的上市公司，通过积极主动的资产配置和组合管理，在有效控制组合下行风险的前提下力争实现资本的长期保值增值。

#### 投资策略

本基金的投资策略是通过对全球宏观经济、大宗商品价格和自然资源相关行业上市公司基本面的分析，根据宏观经济运行特点对不同自然资源类别相关资产价格或其所对应的大宗商品（如能源、贵金属、基本金属、农产品等）价格所产生的不同影响，利用基金管理人在大宗商品、自然资源及其相关产业等领域的专业研究，自上而下的选择明显受益于宏观经济运行特征的自然资源类别进行投资，同时在该资源类别内自下而上精选证券，挖掘定价合理、具备持续竞争优势、明显受益于相关资源价格上涨的上市公司股票进行投资，在有效控制下行风险的前提下，优化组合收益，构建具有长期投资价值的投资组合，实现资产的保值增值。

#### 业绩比较基准

MSCI

全球原材料总收益指数收益率

×65%+MSCI

全球能源总收益指数收益率

×35%

#### 风险收益特征

本基金为主要投资全球范围内自然资源相关行业上市公司的主动混合型基金，基金所投之标的与全球经济景气度、大宗商品市场表现及各相关产业联动性相对较高，波动性较大，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：交银施罗德全球自然资源证券投资基金

最后运作日：2019年7月30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

2019/7/30 2019/7/30

资产

:

负债

:

银行存款

31,882,044.69

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  
11,172,973.97  
资产支持证券投资  
-  
应付管理人报酬  
46,749.07  
基金投资  
-  
应付托管费  
9,090.09  
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  
-  
应收证券清算款  
-  
其他应付款  
-  
应收利息  
4,942.99  
应付利息  
-  
应收股利  
50,163.76  
应付利润  
-  
应收申购款  
-  
其他负债  
53,667.46  
其他资产  
-  
负债合计

11,282,480.59

所有者权益：

实收基金

14,307,948.92

未分配利润

6,346,721.93

所有者权益合计

20,654,670.85

资产合计

：31,937,151.44

负债与持有人权益总计：

31,937,151.44

四、清算报表附注

1、基金基本情况

交银施罗德全球自然资源证券投资基金（以下简称“本基金”）于2011年10月10日由中国证监会《关于核准交银施罗德全球自然资源证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]1628号文）准予募集，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《交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金合同》、《交银施罗德全球自然资源证券投资基金招募说明书》的有关约定，于2012年4月9日至2012年5月17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）“交银施罗德全球自然资源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《关于交银施罗德全球自然资源证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2012]338号）予以备案，本基金基金合同于2012年5月22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628,260,071.31元，折合628,260,071.31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260,126.83元，折合260,126.83份基金份额，本基金在基金合同生效日的基金份额总额628,520,198.14份。本基金基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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《交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金合同》的约定，本基金主要投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票，其中重点投资于与自然资源行业相关的上市公司股票。本基金还可投资于已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金，债券，货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

根据《交银施罗德全球自然资源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2019年7月24日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金合同终止及进入基金财产清算程序的公告》，2019年7月30日未赎回的基金份额，于2019年7月31日全部进入清算程序。

2、清算原因

根据《基金合同》中“八、基金份额持有人大会”之“（二）召开事由”约定：“1.当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：（1）终止基金合同，但在基金规模低于5000万元的情况下除外”，以及“二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”之“（二）本基金合同的终止”约定：“4.若基金规模低于5000万元，基金管理人有权在不召开基金份额持有人大会的情况下终止基金合同”；同时，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条，连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当提出解决方案。本基金已连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形，根据基金合同约定，本基金管理人

决定终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，该基金合同终止无需召开基金份额持有人大会审议。

### 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全球自然资源证券投资基金基金合同终止及进入基金财产清算程序的公告》，自2019年7月31日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为2019年7月31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7月31日至2019年8月12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《交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金合同》第二十部分“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) 本基金最后运作日应收利息为人民币共计4,942.99元。其中应收人民币存款利息4,940.58元，应收港币存款利息2.74（折合人民币2.41元），待款项实际到帐后划入托管户。

(2) 本基金最后运作日应收股利为人民币50,163.76元，待款项实际到帐后划入托管户。

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11,172,973.97元，其中人民币36,271.54元已于2019年7月31日支付，8,748.43元已于2019年8月1日支付，5,880,387.02元已于2019年8月2日支付，877,155.55元已于2019年8月5日支付，917,103.16元已于2019年8月6日支付，3,453,308.27元已于2019年8月7日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币46,749.07元，该款项于2019年8月6日完成支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币9,090.09元，该款项于2019年8月6日完成支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币53,667.46元。应付赎回费为人民币16,064.35元，其中人民币90.04元已于2019年7月31日支付，18.07元已于2019年8月1日支付，8,749.89元已于2019年8月2日支付，1,554.67元已于2019年8月5日支付，561.49元已于2019年8月6日支付，5,090.19元已于2019年8月7日支付。应付银行汇划费为人民币600.00元，按托管行扣款日支付。应付存托凭证保管费为2,003.11元，待账单出具后由托管户划付。应付审计费人民币15,000.00元，于2019年8月12日支付。应付信息披露费人民币20,000.00元，于2019年8月5日支付。

#### 4、清算期间的损益情况

自2019年7月31日至2019年8月12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）

5,742.94

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)

-

汇兑损益 (损失以

"-"

填列)

2,478.38

其他收入 (损失以

"-"

填列)

334.64

清算收入小计 (

1

)

8,555.96

二、清算费用

银行划款手续费

-

交易费用

-

其他费用

-

清算费用小计 (

2

)

-

三、清算净收益 (

1

)

-

(

2

)

8,555.96

注: 上表所有的收入金额数据为包含了2019年7月31日至2019年8月12日的数据。

1: 利息收入系计提的自2019年7月31日至2019年8月12日止清算期间的银行存款利息收入。

2: 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

2019

年

7

月

30

日基金净资产

20,654,670.85

加：清算期间净收益

8,555.96

减：

2019

年

7

月

31

日确认的净赎回款

716,326.23

二、

2019年8月12日基金净资产 19,946,900.58

资产处置及负债清偿后，2019年8月12日本基金剩余财产为人民币19,946,900.58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7月31日日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12日止的应收利息共计人民币10,686.09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12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）《交银施罗德全球自然资源证券投资基金清算审计报告》；
- （2）《交银施罗德全球自然资源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。

交银施罗德全球自然资源证券投资基金

基金财产清算小组

2019年9月20日

交银施罗德基金管理有限公司