交银施罗德中证互联网金融

指数分级

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：2020 年 11 月 11 日
清算报告公告日：2020 年 11 月 26 日

一、重要提示

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金（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 2015 年 5 月 20 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中证互联网金融指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】941 号）进行募集，基金合同于 2015 年 6 月 26 日生效。

根据《交银施罗德中证互联网金融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”）“第二十四部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中，发生下列情形之一的，本基金应当终止：基金份额持有人大会决定终止等。根据 2020 年 10 月 29 日《关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2020 年 10 月 28 日表决通过了《关于终止交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。基金管理人已于 2020 年 11 月 3 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互联网金融 A 份额与交银互联网金融 B 份额终止上市的提示性公告》。

本基金自 2020 年 11 月 6 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：	交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金
基金简称：	互联网金融
基金交易代码：	164907（前端） 150317（A 类） 150318（B 类）
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2015 年 6 月 26 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	本基金采用指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差

	最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。		
投资策略	本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证互联网金融指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。		
业绩比较基准	中证互联网金融指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银互联网金融份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银互联网金融 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银互联网金融 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	交银 E 金融份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征	交银 E 金融 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征	交银 E 金融 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

最后运作日：2020 年 11 月 5 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
	2020/11/5		2020/11/5
资　产：		负债:	
银行存款	7,835,506.44	短期借款	-
结算备付金	56,526.96	交易性金融负债	-
存出保证金	9,161.92	衍生金融负债	-
交易性金融资产	61,571,657.05	卖出回购金融资产款	-

其中：股票投资	61,571,657.05	应付证券清算款	-
债券投资	-	应付赎回款	5,217,335.78
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	11,709.12
基金投资	-	应付托管费	2,576.01
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	17,073.29
应收证券清算款	3,957,721.77	应付税费	-
应收利息	14,820.89	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	172,692.63
其他资产	4,181.70	负债合计	5,421,386.83
		所有者权益：	
		实收基金	100,610,333.47
		未分配利润	-32,582,143.57
		所有者权益合计	68,028,189.90
资产合计:	73,449,576.73	负债与持有人权益总计：	73,449,576.73

四、清算报表附注

1、基金基本情况

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）2015 年 5 月 20 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中证互联网金融指数分级证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】941 号）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《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》、《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金招募说明书》的有关约定，于 2015 年 6 月 16 日至 2015 年 6 月 19 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）“交银施罗德中证互联网金融指数分级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《关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2015]1971 号）予以备案，本基金基金合同于 2015 年 6 月 26 日生效。本基金募集不包括认购资金利息共募集人民币 441,524,789.06 元，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 750 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 441,570,114.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 45,325.03 份基金份额。本基金的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《交银施罗德中证互联

网金融指数分级证券投资基金》的约定，本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具，以中证互联网金融指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货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《交银施罗德中证互联网金融指数分级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 2020 年 11 月 3 日发布的《关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之交银互联网金融 A 份额与交银互联网金融 B 份额终止上市公告》，2020 年 11 月 5 日未赎回的基金份额，于 2020 年 11 月 6 日全部进入清算程序。

2、清算原因

根据《交银施罗德中证互联网金融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”）“第二十四部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中，发生下列情形之一的，本基金应当终止：基金份额持有人大会决定终止等。根据 2020 年 10 月 29 日《关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2020 年 10 月 28 日表决通过了《关于终止交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。

3、清算起始日

根据《关于交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之交银互联网金融 A 份额与交银互联网金融 B 份额终止上市公告》，自 2020 年 11 月 6 日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为 2020 年 11 月 6 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 2020 年 11 月 6 日至 2020 年 11 月 11 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《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》第二十四部分“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 56,526.96 元、存出保证金为人民币 9,161.92 元，该款项将于 2020 年 11 月 11 日之后划入托管账户。

（2）本基金最后运作日应收利息为人民币共计 14,820.89 元。

（3）本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 3,957,721.77 元，该款项将于 2020 年 11 月 5 日之后划入托管账户。

（4）本基金最后运作日其他资产为人民币 4,181.70 元，该款项将于 2020 年 11 月 11 日之后划入托管账户。

（5）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 5,217,335.78 元，该款项已于 2020 年 11 月 10 日支付完毕。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 11,709.12 元，该款项将于 2020 年 11 月 11 日之后支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,576.01 元，该款项将于 2020 年 11 月 11 日之后支付。

（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 17,073.29 元，该款项将于 2020 年 11 月 11 日之后支付。

（6）本基金最后运作日其他负债为人民币 172,692.63 元，该款项将于 2020 年 11 月 6 日之后支付。

4、清算期间的损益情况

自 2020 年 11 月 6 日至 2020 年 11 月 11 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）	2,228.99
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）	-1,660,364.66
公允价值变动损益（损失以"-"填列）	1,231,054.56
其他收入（损失以"-"填列）	162.80
清算收入小计（1）	-426,918.31

二、清算费用	
银行划款手续费	-
交易费用	123,528.09
其他费用	-
清算费用小计（2）	123,528.09
三、清算净收益（1）-（2）	-550,446.40

注：上表所有的收入金额数据为包含了 2020 年 11 月 6 日至 2020 年 11 月 11 日的数据。

1：利息收入系计提的自 2020 年 11 月 6 日至 2020 年 11 月 11 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：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 2020 年 11 月 5 日基金净资产	68,028,189.90
加：清算期间净收益	-550,446.40
减：2020 年 11 月 6 日确认的净赎回款	3,877,679.09
二、2020 年 11 月 11 日基金净资产	63,600,064.41

资产处置及负债清偿后，2020 年 11 月 11 日本基金剩余财产为人民币 63,600,064.41 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 2020 年 11 月 6 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 2020 年 11 月 11 日止的应收利息共计人民币 2,228.99 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。2020 年 11 月 11 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）《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金清算审计报告》；

（2）《交银施罗德中证互联网金融指数分级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。

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金

基金财产清算小组

2020 年 11 月 26 日