

创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

一、重要提示

创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2017]2442 号《关于准予创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金注册的批复》准予注册。由创金合信基金管理有限公司按照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期，首次募集期间为 2018 年 1 月 9 日至 2018 年 1 月 31 日，首次设立募集（不包括认购资金利息）人民币 68,365,796.39 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（2018）第 0032 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2018 年 2 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 68,378,462.98 份，其中认购资金利息折合 12,666.59 份。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”及“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”“二、《基金合同》的终止事由”的约定：基金合同生效日的第三个年度对日，若基金资产净值低于二亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。根据上述约定，截至 2021 年 2 月 7 日日终，本基金的基金资产净值低于二亿元，已触发基金合同终止事由，将根据《基金合同》规定进入基金财产清算程序并终止《基金合同》，不需召开基金份额持有人大会。

本基金于 2021 年 2 月 8 日在指定媒介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，详见《关于创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金从 2021 年 2 月 23 日起进入清算期，由基金管理人创金合信基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市锦天城（深圳）律师事务所于 2021 年 2 月 23 日成立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）对本基金进行清算审计，上海市锦天城（深圳）律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

- 1、基金名称：创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金（基金简称：创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数；基金代码：005567）
- 2、基金类型：股票型证券投资基金
- 3、基金托管人：招商银行股份有限公司
- 4、基金运作方式：契约型开放式
- 5、投资目标：紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化
- 6、风险收益特征：本基金为股票型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金紧密跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征
- 7、基金发售时间：2018 年 1 月 9 日至 2018 年 1 月 31 日
- 8、基金合同生效日：2018 年 2 月 7 日

三、财务会计报告

资产负债表（已审计）

会计主体：创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金
基金最后运作日：2021 年 2 月 22 日

单位：人民币元

资产	基金最后运作日：2021 年 2 月 22 日
资产：	
银行存款	30,671,551.80
结算备付金	42,189.24
存出保证金	2,891.59
交易性金融资产	47,509.62

其中：股票投资	47,509.62
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	5,096.48
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	30,769,238.73
负债和所有者权益	基金最后运作日：2021年2月22日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	2,050,655.82
应付管理人报酬	9,858.92
应付托管费	1,971.78
应付销售服务费	1,495.33
应付交易费用	16,647.17
应交税费	-
应付利息	-

应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	113,725.84
负债合计	2,194,354.86
所有者权益：	
实收基金	18,096,569.14
未分配利润	10,478,314.73
所有者权益合计	28,574,883.87
负债和所有者权益总计	30,769,238.73

注：1、基金最后运作日 2021 年 2 月 22 日，A 类基金份额净值 1.5828 元，C 类基金份额净值 1.5721 元，基金份额总额 18,096,569.14 份，其中 A 类基金份额 11,646,010.30 份，C 类基金份额 6,450,558.84 份。

2、本财务报告已经由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师郭素宏、李崇签字出具了普华永道中天特审字(2021)第 1144 号的无保留意见的审计报告。

四、基金财产分配

自 2021 年 2 月 23 日至 2021 年 3 月 19 日止为本次清算期间，基金财产清算小组对本基金的基金财产进行清算，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：

（一）、清算费用

按照《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。

从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金预先计提的相关费用不足以覆盖清算成本的情况下，将由基金管理人承担剩余费用。

（二）、资产清算情况

截至本次清算期结束日（2021年3月19日），部分资产尚未收回，为维护基金份额持有人利益并提高清算效率，基金管理人以自有资金对其中部分资产进行垫付。各项资产清算情况如下：

- 1、本基金最后运作日结算备付金为人民币 42,189.24 元，存出保证金为人民币 2,891.59 元，基金管理人将于基金清算资金分配前对尚未收回部分予以垫资。
- 2、本基金最后运作日的应收利息为人民币 5,096.48 元，为应收资金利息。
- 3、本基金最后运作日持有的股票投资共计人民币 47,509.62 元，已变现完毕。

（三）负债清偿情况

- 1、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,050,655.82 元，该款项已于 2021 年 2 月 23 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 9,858.92 元，该款项已于 2021 年 3 月 3 日支付完毕。
- 3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,971.78 元，该款项已于 2021 年 3 月 3 日支付完毕。
- 4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,495.33 元，该款项已于 2021 年 3 月 2 日支付完毕。
- 5、本基金最后运作日应付交易费用为人民币 16,647.17 元，该款项已于 2021 年 3 月 12 日支付完毕。
- 6、本基金最后运作日其他负债为人民币 113,725.84 元，为应付赎回费、清算审计费、信息披露费、指数使用费及汇划费。其中，应付赎回费为人民币 93.59 元，该款项已于 2021 年 2 月 23 日支付完毕；预提清盘审计费为人民币 48,000.00 元，该款项已于 2021 年 3 月 4 日支付完毕；预提信息披露费为人民币 58,333.33 元，该款项已于 2021 年 3 月 4 日支付完毕；预提指数使用费为人民币 6,456.30 元，该款项已于 2021 年 3 月 19 日支付完毕；汇划费为人民币 842.62 元，该款项将于产品托管户销户时支付；

（四）清算期间的损益情况

自 2021 年 2 月 23 日至 2021 年 3 月 19 日清算期间

单位：人民币元

项目	金额
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	6,856.49
3、公允价值变动损益	30,766.63
4、投资收益（注 2）	-27,934.23
5、赎回费收入	89.70
6、其他收入	-
清算收益小计	9,778.59
二、清算费用	
1、交易费用（注 3）	74.65
2、其他费用（注 4）	15,656.57
清算费用小计	15,731.22
三、清算净收益	-5,952.63

注：利息收入为以当前使用的利率预估计提的 2021 年 2 月 23 日至 2021 年 3 月 19 日的银行存款利息、交易所备付金及保证金利息。清算起始日至清算款划出前一日银行存款产生的利息、债券利息收入、交易所备付金及保证金产生的利息归基金份额持有人所有，基金管理人将于基金清算资金分配前对尚未结息部分予以垫资。基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

注 2：投资收益为 2021 年 2 月 23 日至 2021 年 3 月 19 日的股票投资收益。

注 3：交易费用为 2021 年 2 月 23 日至 2021 年 3 月 19 日的交易所市场交易费用。

注 4：其他费用为清盘律师费、MSCI 指数使用费支付税费差额及 2021 年 2 月 23 日至 2021 年 3 月 19 日的汇划费。其中，清盘律师费为人民币 15,000.00 元，MSCI 指数使用费支付税费差额为人民币 495.56 元，汇划费为人民币 161.01 元。

（五）剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2021 年 2 月 22 日基金净资产	28,574,883.87
减：基金赎回金额（于 2021 年 2 月 22 日提出的投资者赎回申请）	492,619.02
加：清算期间净收益	-5,952.63
二：本次清算期结束日 2021 年 3 月 19 日基金净资产	28,076,312.22

根据本基金的基金合同约定，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，按运作终止日基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人有权于收到基金托管人通知后当日内将款项补足。

（六）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清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时分配。

五、备查文件

1、备查文件目录

（1）创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金 2018 年 2 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 2 月 22 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告；

（2）关于《创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式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至基金管理人的办公场所免费查阅。

创金合信 MSCI 中国 A 股国际指数发起式证券投资基金基金财产清算小组

2021 年 4 月 8 日