

交银施罗德鑫选回报混合型证券投资 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司
清算报告出具日：2024年5月10日
清算报告公告日：2024年5月22日

一、重要提示

交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2020 年 12 月 14 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2020】3442 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2021 年 4 月 29 日正式生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）出现了基金合同终止事由，交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“本基金管理人”）应当在上述事由出现后终止基金合同并依法履行基金财产清算程序，此事项不需召开基金份额持有人大会。

本基金最后运作日为 2024 年 4 月 12 日，自 2024 年 4 月 13 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、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、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：	交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金	
基金简称：	交银鑫选回报混合	
基金交易代码：	011198	
基金运作方式：	契约型开放式	
基金合同生效日：	2021 年 4 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：	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称：	交银鑫选回报混合 A	交银鑫选回报混合 C
下属分级基金的交易代码：	011198	011199

2、基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，充分发挥专业研究与管理能力，追求超越业绩比较基准的投资收益，力争为投资者提供长期稳健的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，运用修正后的投资时钟分析框架，自上而

	下调整基金大类资产配置，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选个股和个券；在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争获取投资组合的较高回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%+中证综合债券指数收益率×80%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期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。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金

最后运作日：2024 年 4 月 12 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
	2024/4/12		2024/4/12
资 产：		负债：	
银行存款	250,490.36	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	19,282.74	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	9,151.47
资产支持证券投资	-	应付管理人报酬	69.36
基金投资	-	应付托管费	11.55
衍生金融资产	-	应付销售服务费	2.08
买入返售金融资产	-	应付交易费用	-
应收证券清算款	101,997.60	应付税费	-
应收利息	-	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	52,593.84
其他资产	-	负债合计	61,828.30
		所有者权益：	
		实收基金	308,985.48

		未分配利润	956.92
		所有者权益合计	309,942.40
资产合计:	371,770.70	负债与持有人权益总计:	371,770.70

四、清算报表附注

1、基金基本情况

交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2020年12月14日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2020】3442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《交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金基金合同》、《交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金招募说明书》的有关约定，负责公开募集。募集结束后，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）“交银施罗德鑫选回报混合型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《关于交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函【2021】1265号）予以备案。本基金募集不包括认购资金利息共募集人民币435,117,267.33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(2021)第0301号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金基金合同》于2021年4月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为435,117,267.33份基金份额（其中A类基金份额为240,059,963.33份，C类基金份额为195,057,304.00份），经中登公司确认的认购资金利息折合35,145.34份基金份额（其中A类基金份额为21,619.54份，C类基金份额为13,525.80份）。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《交银施罗德鑫选回报混合型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2024年4月13日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，2024年4月12日未赎回的基金份额于2024年4月13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“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：

“《基金合同》生效后，连续20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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金管理人提前终止《基金合同》，不需召开基金份额持有人大会。”

截至2024年4月12日日终，本基金的基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止事由，《基金合同》自动终止，基金管理人将根据法律法规的规定及《基金合同》的约定对本基金进行基金财产清算，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鑫选回报混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自2024年4月13日起，本基金进入清算程序。故本基金清算起始日为2024年4月13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2024年4月13日至2024年4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《交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金基金合同》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0元、存出保证金为人民币19,282.74元。
- (2) 本基金最后运作日应收利息为人民币共计120.97元。
- (3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币共计0元。
- (4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币101,997.60元，该款项于2024年4月15日划入托管账户。
- (5) 本基金最后运作日其他资产为人民币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9,151.47元，该款项于2024年4月15日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币69.36元，该款项于2024年4月25日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币11.55元，该款项于2024年4月25日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币2.08元，该款项于2024年4月25日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币52,593.84元，包括银行间交易费用4,593.84元，预提审计费48,000.00元，其中2024年4月16日支付银行间交易费用4,593.84元，剩余负债

于 2024 年 4 月 25 日之后支付。

4、清算期间的损益情况

自 2024 年 4 月 13 日至 2024 年 4 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）	95.89
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）	-
其他收入（损失以“-”填列）	-
清算收入小计（1）	95.89
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）	95.89

注：1、利息收入系计提的自 2024 年 4 月 13 日至 2024 年 4 月 25 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 2024 年 4 月 12 日基金净资产	309,942.40
加：清算期间净收益	95.89
二、2024 年 4 月 25 日基金净资产	310,038.29

资产处置及负债清偿后，2024 年 4 月 25 日本基金剩余财产为人民币 310,038.29 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，由基金管理人承担。

清算起始日 2024 年 4 月 13 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 2024 年 4 月 25 日止的应收利息共计人民币 95.89 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。2024 年 4 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) 《交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《交银施罗德鑫选回报混合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>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及基金托管人办公场所，供公众查阅、复制。

交银施罗德鑫选回报混合型证券投资基金
基金财产清算小组
2024年5月22日