

交银施罗德中债 1-5 年政策性金融 债指数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：上海浦东发展银行股份有限公司
清算报告出具日：2023 年 10 月 31 日
清算报告公告日：2023 年 11 月 16 日

一、重要提示

交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2022 年 3 月 16 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【2022】568 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2022 年 6 月 8 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《交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数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，交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金（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 2023 年 10 月 17 日，自 2023 年 10 月 18 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、基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司、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： | 交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金 | |
| 基金简称： | 交银中债 1-5 年政金债指数 | |
| 基金交易代码： | 015743 | |
| 基金运作方式： | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日： | 2022 年 6 月 8 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： | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称： | 交银中债 1-5 年政金债指数 A | 交银中债 1-5 年政金债指数 C |
| 下属分级基金的交易代码： | 015743 | 015744 |

2、基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标 |

| | |
|--------|---|
| | 的指数的有效跟踪。 |
| 业绩比较基准 | 中债-1-5 年政策性金融债指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金，其预期风险与预期收益理论上高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。 |

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金

最后运作日：2023 年 10 月 17 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 |
|----------|------------|-----------|------------|
| | 2023/10/17 | | 2023/10/17 |
| 资 产： | | 负债： | |
| 银行存款 | 183,371.09 | 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 | 748,117.21 | 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 | 748,117.21 | 应付赎回款 | - |
| 资产支持证券投资 | - | 应付管理人报酬 | 64.27 |
| 基金投资 | - | 应付托管费 | 21.42 |
| 衍生金融资产 | - | 应付销售服务费 | 40.94 |
| 买入返售金融资产 | - | 应付交易费用 | - |
| 应收证券清算款 | - | 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 | 8,549.59 | 其他负债 | 117,798.32 |
| 其他资产 | - | 负债合计 | 117,924.95 |
| | | 所有者权益： | |
| | | 实收基金 | 799,347.44 |
| | | 未分配利润 | 22,765.50 |
| | | 所有者权益合计 | 822,112.94 |

| | | | |
|-------|------------|-------------|------------|
| 资产合计: | 940,037.89 | 负债与持有人权益总计: | 940,037.89 |
|-------|------------|-------------|------------|

四、清算报表附注

1、基金基本情况

交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2022 年 3 月 16 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【2022】568 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《交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》、《交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数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）“交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数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《关于交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金备案确认的函》（基金成立备案函[2022]607 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 7,989,985,341.02 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(2022)第 0392 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 6 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,989,985,341.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.31 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数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 2023 年 10 月 18 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，2023 年 10 月 17 日未赎回的基金份额于 2023 年 10 月 18 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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。”

截至 2023 年 10 月 17 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中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，自 2023 年 10 月 18 日起，本基金进入清算程序。

故本基金清算起始日为 2023 年 10 月 18 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 2023 年 10 月 18 日至 2023 年 10 月 24 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《交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数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 0 元。
- (2) 本基金最后运作日应收利息为人民币共计 55.89 元。
- (3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币共计 748,117.21 元，该资产已于 2023 年 10 月 18 日处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 748,057.16 元，该款项于 2023 年 10 月 19 日划入托管账户。
- (4) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 0 元。
- (5) 本基金最后运作日其他资产为人民币 0 元。
- (6) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 8,549.59 元，该款项于 2023 年 10 月 18 日划入托管账户。

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 0 元。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 64.27 元，该款项于 2023 年 11 月 3 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 21.42 元，该款项于 2023 年 11 月 3 日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 40.94 元，该款项于 2023 年 11 月 3 日支付。
- (5) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 0 元。
- (6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 117,798.32 元，包括银行间交易费用 7,648.32

元，预提审计费 41,000.00 元，预提信披费 69,000.00 元，预提银行汇划费 150.00 元，其中 10 月 23 日支付银行间交易费用 7,648.32 元，剩余负债于 2023 年 10 月 24 日之后支付。

4、清算期间的损益情况

自 2023 年 10 月 18 日至 2023 年 10 月 24 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） | 56.16 |
| 债券利息收入 | - |
| 债券投资收益（损失以“-”填列） | -1,980.13 |
| 股票投资收益（损失以“-”填列） | - |
| 公允价值变动损益（损失以“-”填列） | 1,768.20 |
| 其他收入（损失以“-”填列） | 2.88 |
| 清算收入小计（1） | -152.89 |
| | |
| 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） | -152.89 |

注：1、利息收入系计提的自 2023 年 10 月 18 日至 2023 年 10 月 24 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 2023 年 10 月 17 日基金净资产 | 822,112.94 |
| 加：清算期间净收益 | -152.89 |
| 减：2023 年 10 月 18 日确认的净赎回款 | 4,374.23 |
| 二、2023 年 10 月 24 日基金净资产 | 817,585.82 |

资产处置及负债清偿后，2023 年 10 月 24 日本基金剩余财产为人民币 817,585.82 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 2023 年 10 月 18 日至清算款划出前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。截至 2023 年 10 月 24 日止的应收利息共计人民币 56.16 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。2023 年 10 月 24 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) 《交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数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。

交银施罗德中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金
基金财产清算小组
2023 年 11 月 16 日