

中融中证一带一路主题指数分级证券投资 基金二次清算报告

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年1月20日

清算报告公告日：2021年2月24日

一、重要提示及目录

1、重要提示

中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”或“中融一带一路”)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(2015)760号文注册,于2015年5月14日基金合同生效,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“运作办法”)、《中融中证一带一路主题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”)的有关规定,中融基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致,由基金管理人召集,以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于2020年10月21日表决通过了《关于终止中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同以及一带 A 份额、一带 B 份额终止上市有关事项的议案》,决定终止本基金基金合同。基金份额持有人大会的表决结果暨决议生效的公告详见2020年10月22日基金管理人网站(www.zrfunds.com.cn)上的《关于中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

本基金自2020年11月05日起进入清算程序。由基金管理人中融基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、上会会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所于2020年11月05日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由上会会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

本基金首次清算期间为2020年11月05日至2020年11月25日。本基金的基金管理人于2020年12月24日对《中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金清算报告》进行了公告,并于2020年12月30日支付了第一次清算款。

本次清算为本基金第二次清算,清算期间为2020年11月26日至2021年1月20日。由基金管理人中融基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、上会会计师事务所(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,并由上会会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行二次清算审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、目录

一、重要提示及目录	2
1、重要提示.....	2
2、目录.....	3
二、基金概况	4
三、财务会计报告	5
四、清算事项说明	6
1、基本情况.....	6
2、清算原因.....	6
3、清算起始日.....	7
4、清算报表编制基础.....	7
五、清算情况	7
1、第二次清算期资产处置情况.....	7
2、第二次清算期负债清偿情况.....	8
3、第二次清算期间的清算损益情况.....	8
4、第二次清算期结束日的资产负债及剩余财产的分配情况.....	9
5、基金财产清算报告的告知安排.....	10
六、备查文件目录	10
1、备查文件目录.....	10
2、存放地点.....	10
3、查阅方式.....	10

二、基金概况

- 1、基金名称：中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金
- 2、基金简称：中融一带一路（基金代码：168201）、一带 A（基金代码：150265）、一带 B（基金代码：150266）
- 3、基金运作方式：契约型开放式
- 4、基金合同生效日：2015 年 5 月 14 日
- 5、2020 年 11 月 04 日（基金最后运作日）基金份额总额：123,926,933.97 份
- 6、投资目标：本基金采用指数化投资策略，通过严谨的数量化管理和严格的投资程序，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，实现对中证一带一路主题指数的有效跟踪。
- 7、投资策略：本基金主要采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证一带一路主题指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

 1. 资产配置策略
 2. 股票投资组合构建
 3. 债券投资策略
 4. 股指期货投资策略
- 8、业绩比较基准： $95\% \times \text{中证一带一路主题指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率（税后）}$
- 9、风险收益特征：本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所自动分离或分拆的两类基金份额来看，一带一路 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征；一带一路 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。
- 10、基金管理人：中融基金管理有限公司
- 11、基金托管人：中国农业银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金

单位：人民币元

项目	第二次清算期结束日 2021年01月20日	基金最后运作日 2020年11月04日
资产：		
银行存款	93,520.25	12,911,121.83
清算备付金	-	18,089.69
存出保证金	110,288.21	93,009.90
股票投资	-	129,461,147.39
应收利息	19,659.04	20,547.06
证券清算款	-	1,858,361.56
资产合计	223,467.50	144,362,277.43
负债：		
应付赎回款	-	5,941,882.97
应付赎回费	-	1,827.63
应付管理人报酬	-	19,246.54
应付托管费	-	4,234.24
应付交易费用	160.98	101,865.96
应交税费	-	1.56
其他应付款	149,000.00	70,652.17
预提费用	-	118,195.59
负债合计	149,160.98	6,257,906.66
所有者权益合计	74,306.52	138,104,370.77
负债及所有者权益合计	223,467.50	144,362,277.43

四、清算事项说明

1、基本情况

本基金经中国证监会证监许可〔2015〕760号文《关于准予中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金注册的批复》批准，由基金管理人中融基金管理有限公司依照《基金法》、《运作办法》和《基金合同》进行公开募集，并于2015年5月14日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证一带一路主题指数的成份股、备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）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的相关规定）。

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 中证一带一路主题指数收益率 $+5\% \times$ 同期银行活期存款利率（税后）。

2、清算原因

根据《基金合同》“第二十五部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“（二）本基金合同的终止”的约定：

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止的；
2. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
3. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
4. 基金合同约定的其他情形；
5. 法律法规和中国证监会规定的其他情况。

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《中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》有关规定，基金管

理人经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，审议终止本基金基金合同相关事项的议案，会议审议并通过了终止基金合同相关事项的议案，并依法履行基金财产清算程序。由于本基金一次清算结束时持有处于限售期的股票投资，因此本基金进行二次清算。

3、清算起始日

根据《基金合同》及《关于中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，2020年11月04日为本基金最后运作日，故本基金第一次清算起始日为2020年11月05日。本基金截至第一次清算期结束日2020年11月25日仍持有处于限售期的股票投资，本基金于2020年11月26日进入第二次清算期，截至2021年1月20日（基金第二次清算期结束日）上述未变现股票投资均已变现。

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。本基金自最后运作日起，资产负债按实际清算价格计价。

五、清算情况

自2020年11月05日至2020年11月25日止为本基金第一次清算报告期，中融一带一路自清算起始日起，中融一带一路基金财产清算小组成立，并对中融一带一路的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行，具体情况已在本基金第一次清算报告中说明。

由于截至2020年11月25日本基金仍持有处于限售期的股票投资，本基金管理人对本基金进行第二次清算。自2020年11月26日至2021年1月20日为本基金第二次清算报告期。财产清算小组对中融一带一路的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行，具体情况如下：

1、第二次清算期资产处置情况

(1) 本基金第二次清算期间收到中登备付金、保证金调回人民币共计811.38元，支付份额持有人第一次清算分配款136,191,428.52元，收到存款结息共计人民币138,239.04元，支付银行划款手续费20.00元，收到管理人垫付资金人民币

149,000.00 元,收到卖出股票款项共计人民币 219,861.47 元(卖出股票明细如下表,其中“燕麦科技”变现款项已在本基金第一次清算时进行分配)。

股票名称	股票代码	数量(股)	卖出股票金额(元)	卖出日期
燕麦科技	688312	4,904	154,239.07	2020-12-08
恒誉环保	688309	2,345	65,622.40	2021-1-14

截止本基金第二次清算期结束日(2021 年 01 月 20 日)银行存款余额为人民币 93,520.25 元。

(2) 本基金第二次清算期结束日存出保证金人民币 110,288.21 元。根据中国证券登记结算有限责任公司的规定,存出保证金将于所有证券交易结束后约 6 个月返还至托管户。

(3) 本基金第二次清算期结束日应收银行存款利息人民币 19,495.52 元、应收存出保证金利息人民币 163.52 元,共计人民币 19,659.04 元。该款项将于 2021 年 3 月 21 日(银行季度结息日)结息至托管账户,具体金额以实际结息时为准。

2、第二次清算期负债清偿情况

(1) 本基金第二次清算期结束日应付交易费用为人民币 160.98 元,已于 2021 年 1 月 28 日支付。

(2) 本基金第二次清算期结束日其他应付款为人民币 149,000.00 元,为本基金管理人于第一次清算分配时垫付的资金,该款项将于银行存款利息及存出保证金结回托管户时归还基金管理人。

3、第二次清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	清算期(2020 年 11 月 26 日至 2021 年 1 月 20 日)发生额
一、清算期间收入	
1、存款利息收入	87,716.20
2、投资收益(损失以“-”填列)	-33,331.08
清算期间收入小计	54,385.12

二、清算期间费用	
1、交易费用（注 1）	400.59
2、其他费用（注 2）	20.00
清算期间费用小计	420.59
三、清算净收益（清算净损失以“-”表示）	53,964.53

注 1：利息收入包括本基金自二次清算期间 2020 年 11 月 26 日至 2021 年 1 月 20 日形成的银行存款利息收入 87,416.01 元、备付金利息收入 4.80 元、保证金利息收入 295.39 元，共计 87,716.20 元。

注 2：交易费用为卖出股票产生的费用。

注 3：清算期间产生银行划款手续费。

4、第二次清算期结束日的资产负债及剩余财产的分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、第一次清算期结束日 2020 年 11 月 25 日基金净资产	136,211,770.51
加：清算期间净收益	53,964.53
减：2020 年 12 月 30 日支付的第一次清算分配款	136,191,428.52
二、第二次清算期结束日 2021 年 1 月 20 日基金净资产	74,306.52

根据《基金合同》中关于基金财产清算的相关约定，基金财产清算小组将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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。同时，《基金合同》“十一、基金合同当事人及权利义务”中“（五）基金份额持有人”项下约定：“中融一带一路份额、一带一路 A 份额和一带一路 B 份额仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。如果一带一路 A 份额和一带一路 B 份额终止运作，则在终止一带一路 A 份额和一带一路 B 份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。”基金财产将按照上述分配原则进行分配。

本基金截至第一次清算期结束日（2020 年 11 月 25 日）所持处于限售期的股票投资，于第二次清算期结束日（2021 年 1 月 20 日）前均已变现，本基金管理人将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

2020 年 11 月 26 日至基金财产分配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。如前述利息和存出保证金在本基金财产分配划出日前尚未结清，则未结息部分（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）和未返还的存出保证金将由基金管理人中融基金管理有限公司以自有资金垫付至托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于利息结清后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

5、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审计报告、律师事务所出具法律意见书，一并报中国证监会备案并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）《中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金二次清算审计报告》；
- （2）《上海市通力律师事务所关于〈中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金二次清算报告〉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内至基金管理人的办公场所免费查阅。

中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金财产清算小组

2021年1月20日