

# 招商招熹纯债债券型证券投资基金清算报告

2017-11-23

## 一、重要提示

招商招熹纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2016 年 10 月 9 日《关于准予招商招熹纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2307 号文）注册公开募集，自 2017 年 6 月 16 日起基金合同生效，基金管理人为招商基金管理有限公司，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《招商招熹纯债债券型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当终止基金合同，并对本基金进行变现及清算。截至 2017 年 10 月 18 日，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，触发基金合同终止情形，基金合同自动终止，基金管理人已就该事项于 2017 年 10 月 19 日刊登了《招商基金管理有限公司关于招商招熹纯债债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2017 年 10 月 19 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## 二、基金概况

基金名称	招商招熹纯债债券型证券投资基金
------	-----------------

基金简称	招商招熹纯债	
基金主代码	003616	
交易代码	003616	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年6月16日	
最后运作日(2017-10-18)基金份额总额	1,045,303.51份	
投资目标	在控制投资风险的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的回报。	
投资策略	<p>本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定资产在非信用类固定收益类证券(国债、中央银行票据等)和信用类固定收益类证券之间的配置比例。</p>	
业绩比较基准	中债综合指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中等风险/收益的产品。	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属基金份额的基金简称	招商招熹纯债 A	招商招熹纯债 C

下属基金份额的交易代码	003616	003617
最后运作日（2017-10-18）下 属基金份额总额	8,700.45 份	1,036,603.06 份

### 三、基金运作情况

本基金经中国证监会 2016 年 10 月 9 日证监许可【2016】2307 号文注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2017 年 3 月 14 日至 2017 年 6 月 12 日止期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2017 年 6 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 246,392,297.28 份（含募集期间利息结转的份额），其中招商招熹纯债 A 为 7,253,445.08 份、招商招熹纯债 C 为 239,138,852.20 份。自 2017 年 6 月 16 日至 2017 年 10 月 18 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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》、《招商招熹纯债债券型证券投资基金基金合同》等有关规定，本基金连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当终止基金合同，并对本基金进行变现及清算。截至 2017 年 10 月 18 日，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，触发基金合同终止情形，基金合同自动终止，基金管理人已就该事项于 2017 年 10 月 19 日刊登了《招商基金管理有限公司关于招商招熹纯债债券型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 2017 年 10 月 19 日起进入清算期。

### 四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：招商招熹纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017年10月18日

单位：人民币元

	最后运作日 2017年10月18日
<b>资产：</b>	
银行存款	1,057,603.42
存出保证金	1,024.15
应收利息	597.82
资产总计	1,059,225.39
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	154.58
应付托管费	51.54
应付销售服务费	102.19
负债合计	308.31
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	1,045,303.51
未分配利润	13,613.57
所有者权益合计	1,058,917.08
负债和所有者权益总计	1,059,225.39

注：1、基金最后运作日 2017 年 10 月 18 日，招商招熹纯债 A 单位净值为 1.0330 元，份额为 8,700.45 份，资产净值为 8,987.16 元；招商招熹纯债 C 单位净值为 1.0129 元，份额为 1,036,603.06 份，资产净值为 1,049,929.92 元。

2、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。本基金已将账面价值高于预计可收回金额的资产调整至预计可收回金额，并按预计结算金额计量负债。同时，不对资产、负债进行流动与非流动的划分。

## 五、清算情况

自 2017 年 10 月 19 日至 2017 年 10 月 31 日止为清算期间，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《招商招熹纯债债券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。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人承担并支付。

### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款 1,057,603.42 元，是存储于基金托管人中国建设银行的活期银行存款。

(3) 本基金最后运作日存出保证金 1,024.15 元, 是由中国证券登记结算公司上海分公司收取并保管的结算保证金。结算保证金每月调整一次, 根据《结算保证金管理业务指南》, “中国证券登记结算有限责任公司于每月初第二个交易日, 根据结算参与人对应结算备付金账户前 6 个月日均结算净额调整其结算互保金额度, 但不低于初始结算保证金基数”。基金管理人已于 2017 年 10 月 19 日向基金托管人出具了《招商招熹纯债债券型证券投资基金申请调回结算保证金申请书》, 申请调回结算保证金, 预期于 11 月 2 日, 此笔款项会返还托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收利息 597.82 元, 其中包括活期银行存款利息 596.47 元和上海结算保证金利息 1.35 元。应收活期银行存款利息由托管银行于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日 (节假日顺延) 结算入账, 或在账户注销时一次性结清; 上海结算保证金利息由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日 (节假日顺延) 结算入账。为保护基金份额持有人利益, 加快清盘速度, 基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 154.58 元, 该款项已于 2017 年 10 月 19 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为 51.54 元, 该款项已于 2017 年 10 月 19 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为 102.19 元, 该款项已于 2017 年 10 月 19 日支付。

### 4、清算期间的剩余资产分配情况

(1) 招商招熹纯债 A (基金代码: 003616)

单位: 人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2017 年 10 月 18 日基金净资产	8,987.16
加：清算期间（2017-10-19 至 2017-10-31）收入	2.34
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	2.33
利息收入-上海结算保证金利息收入（注 1）	0.01
减：清算期间（2017-10-19 至 2017-10-31）费用	0.76
清算费用（注 2）	-
其他费用（注 3）	0.76
二、2017 年 10 月 31 日基金净资产	8,988.74

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2017 年 10 月 19 日至 2017 年 10 月 31 日止清算期间的银行存款利息和上海结算保证金利息；A/C 类份额之间的收入分配按照各级别净值占比进行分配；

2、本次清算相关的清算费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付；

3、其他费用系自 2017 年 10 月 19 日至 2017 年 10 月 31 日止清算期间托管账户扣缴的银行划汇费；A/C 类份额之间的费用分摊按照各级别净值占比进行分摊。

（2）招商招熹纯债 C（基金代码：003617）

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2017 年 10 月 18 日基金净资产	1,049,929.92
加：清算期间（2017-10-19 至 2017-10-31）收入	273.15
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	272.56

利息收入-上海结算保证金利息收入（注1）	0.59
减：清算期间（2017-10-19至2017-10-31）费用	89.24
清算费用（注2）	-
其他费用（注3）	89.24
减：基金净赎回金额（于2017年10月19日确认的投资 者赎回申请）	1.01
二、2017年10月31日基金净资产	1,050,112.82

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2017年10月19日至2017年10月31日止清算期间的银行存款利息和上海结算保证金利息；A/C类份额之间的收入分配按照各  
级别净值占比进行分配；

2、本次清算相关的清算费用由基金管理人承担，不从基金财产中支付；

3、其他费用系自2017年10月19日至2017年10月31日止清算期间托管账户扣缴  
的银行划汇费；A/C类份额之间的费用分摊按照各级别净值占比进行分摊。

资产处置及负债清偿后，于2017年10月31日本基金剩余财产为人民币1,059,101.56  
元，包括招商招熹纯债A人民币8,988.74元和招商招熹纯债C人民币1,050,112.82元，  
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。

2017年11月1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。  
为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该  
金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫  
付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。



## 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，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

- (1) 《招商招熹纯债债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《关于招商招熹纯债债券型证券投资基金清算事宜之法律意见》

### 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免费查阅。

招商招熹纯债债券型证券投资基金财产清算小组

2017年10月31日