

招商招益一年定期开放债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年2月9日

清算报告公告日：2018年3月9日

一、重要提示

招商招益一年定期开放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 2015 年 11 月 26 日《关于准予招商招益一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】2755 号）注册公开募集，自 2015 年 12 月 25 日起基金合同生效，基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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》、《招商招益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》等有关规定，在本基金开放期的最后一日日终，基金资产净值低于 5000 万元的，基金合同将于该日次日终止并进行基金财产清算。截至本次开放期的最后一日（即 2018 年 1 月 31 日）日终，本基金基金资产净值低于 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 2018 年 2 月 1 日刊登了《招商基金管理有限公司关于招商招益一年定期开放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 2018 年 2 月 1 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	招商招益一年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	招商招益一年定开债
基金主代码	002215
交易代码	002215
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 25 日
最后运作日（2018-1-31）基金份额总额	5,521,114.95 份
投资目标	在严格控制风险的前提下追求基金资产长期稳健增值，力争为基金持有人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配的基础上，将视债券、银行存款、债券回购等大类资

	<p>产的市场环境实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守 本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种， 防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	中证短债指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均风 险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经中国证监会 2015 年 11 月 26 日证监许可【2015】2755 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 2015 年 12 月 7 日至 2015 年 12 月 23 日止期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2015 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 367,320,990.58 份（含募集期间利息结转的份额）。自 2015 年 12 月 25 日至 2018 年 1 月 31 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》、《招商招益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》等有关规定，在本基金开放期的最后一日日终，基金资产净值低于 5000 万元的，基金合同将于该日次日终止并进行基金财产清算。截至本次开放期的最后一日（即 2018 年 1 月 31 日）日终，本基金基金资产净值低于 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 2018 年 2 月 1 日刊登了《招商基金管理有限公司关于招商招益一年定期开放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 2018 年 2 月 1 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：招商招益一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018年1月31日

单位：人民币元

	最后运作日 2018年1月31日
资产：	
银行存款	7,174,272.41
应收利息	21,500.24
资产总计	7,195,772.65
负债：	
应付赎回款	1,187,118.07
应付交易费用	1,550.00
应付税费	21,619.79
其他负债	128,335.39
负债合计	1,338,623.25
所有者权益：	
实收基金	5,521,114.95
未分配利润	336,034.45
所有者权益合计	5,857,149.40
负债和所有者权益总计	7,195,772.65

注：1、基金最后运作日2018年1月31日，招商招益一年定开债单位净值为1.0608元，份额为5,521,114.95份，资产净值为5,857,149.40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2018年2月1日至2018年2月9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《招商招益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》第二十部分“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 7,174,272.41 元，是存储于基金托管人中国民生银行的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日应收利息 21,500.24 元，全部为活期银行存款利息。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。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赎回款为 1,187,118.07 元，该款项已于 2018 年 2 月 1 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付交易费用为 1,550.00 元，其中包括应付中央国债登记结算有限责任公司结算手续费 150.00 元，该款项已于 2018 年 2 月 5 日支付，应付上海清算所结算手续费 1,170.00 元，该款项由于暂未收到上海清算所付费单而尚未支付，应付中国外汇交易中心交易手续费 230.00 元，该款项由于暂未收到中国外汇交易中心付费单而尚未支付。

(3) 本基金最后运作日应交税费为 21,619.79 元，该款项已于 2018 年 2 月 8 日支付。

(4) 本基金最后运作日其他应付款为 4,500.00 元，其中应付中央国债登记结算有限责任公司账户维护费 1,500.00 元，该款项已于 2018 年 2 月 5 日支付，应付上海清算所结算手续费及交易手续费 3,000.00 元，该款项由于暂未收到上海清算所付费单而尚未支付。

(5) 本基金最后运作日预提费用为 123,835.39 元，该款项已于 2018 年 2 月 8 日支付。

4、清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2018 年 1 月 31 日基金净资产	5,857,149.40
加：清算期间（2018-2-1 至 2018-2-9）收入	1,025.09
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	1,025.09
减：清算期间（2018-2-1 至 2018-2-9）费用	83.74
清算费用（注 2）	-

其他费用（注 3）	83.74
减：基金净赎回金额（于 2018 年 2 月 1 日确认的投资者赎回申请）	523,501.01
二、2018 年 2 月 9 日基金净资产	5,334,589.74

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2018 年 2 月 1 日至 2018 年 2 月 9 日止清算期间的银行存款利息；

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 2018 年 2 月 1 日至 2018 年 2 月 9 日止清算期间托管账户扣缴的银行划汇费。

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 2 月 9 日本基金剩余财产人民币 5,334,589.74 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。

2018 年 2 月 10 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) 《招商招益一年定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2) 《关于招商招益一年定期开放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。

2018年2月9日