

招商丰达灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年4月20日

清算报告公告日：2018年6月12日

一、重要提示

招商丰达灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2016 年 3 月 1 日《关于准予招商丰达灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】382 号）注册公开募集，自 2016 年 8 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》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。根据《招商丰达灵活配置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“二、《基金合同》的终止事由”中约定，“有下列情形之一的，经履行适当程序后，《基金合同》应当终止： 1、基金份额持有人大会决定终止的”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止招商丰达灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，基金管理人已于 2018 年 3 月 9 日刊登了《招商基金管理有限公司关于以通讯方式召开招商丰达灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于 2018 年 3 月 12 日、2018 年 3 月 13 日陆续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会于 2018 年 4 月 10 日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效，基金管理人于 2018 年 4 月 11 日刊登了《关于招商丰达灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2018 年 4 月 12 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（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	招商丰达灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	招商丰达混合

基金主代码	002516	
交易代码	002516	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年8月25日	
最后运作日（2018-4-11） 基金份额总额	44,495,921.51 份	
投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报。	
投资策略	<p>本基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况，在权益类资产、固定收益类资产和现金三大类资产类别间进行相对灵活的配置，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例。</p> <p>本基金战略性资产类别配置的决策将从经济运行周期和政策取向的变动，判断市场利率水平、通货膨胀率、货币供应量、盈利变化等因素对证券市场的影响，分析类别资产的预期风险收益特征，通过战略资产配置决策确定基金资产在各大类资产类别间的比例，并参照定期编制的投资组合风险评估报告及相关数量分析模型，适度调整资产配置比例，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。</p>	
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率 + 50%×中债综合指数收益率	
风险收益特征	本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	招商丰达混合 A	招商丰达混合 C
下属分级基金的交易代码	002516	002517
最后运作日（2018-4-11） 下属基金份额总额	44,493,727.62 份	2,193.89 份

三、基金运作情况

本基金经中国证监会 2016 年 3 月 1 日证监许可【2016】382 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 2016 年 8 月 22 日至 2016 年 8 月 23 日向社会公开募集。本基金基金合同于 2016 年 8 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数（含利息结转的份额）为 800,005,093.71 份。自 2016 年 8 月 25 日至 2018 年 4 月 11 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》

、《招商丰达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，经本基金份额持有人大会 2018 年 4 月 10 日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于 2018 年 4 月 11 日刊登了《关于招商丰达灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。本基金从 2018 年 4 月 12 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：招商丰达灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 4 月 11 日

单位：人民币元

	最后运作日 2018 年 4 月 11 日
资产：	
银行存款	48,221,312.08
结算备付金	90,909.09
存出保证金	19,873.43
交易性金融资产	2,621,708.67
应收利息	20,424.98
资产总计	50,974,228.25
负债：	
应付管理人报酬	9,170.29
应付托管费	3,820.95
应付销售服务费	0.33
应付交易费用	608.70
其他应付款	190,441.94
负债合计	204,042.21
所有者权益：	
实收基金	44,495,921.51
未分配利润	6,274,264.53
所有者权益合计	50,770,186.04
负债和所有者权益总计	50,974,228.25

注：1、基金最后运作日 2018 年 4 月 11 日，招商丰达混合 A 单位净值为 1.141 元，份额

为 44,493,727.62 份，资产净值为 50,767,709.08 元；招商丰达混合 C 单位净值为 1.129 元，份额为 2,193.89 份，资产净值为 2,476.96 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 4 月 12 日至 2018 年 4 月 20 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。

由于本基金于 2018 年 4 月 20 日(清算结束日)仍持有限售股票导致部分资产尚未变现，故需进行二次清算。本基金将于上述未变现资产全部变现后进入二次清算程序，并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二次分配。

具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《招商丰达灵活配置混合型证券投资基金》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剩余财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款 48,221,312.08 元，是存储于基金托管人中国建设银行的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日结算备付金 90,909.09 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备付金。结算备付金每月调整一次，根据《结算备付金管理办法》，“中国证券登记结算有限责任公司在每月前 3 个营业日内，对结算参与人的最低结算备付金限额进行重新核算、调整。”。预期于 5 月 3 日，此笔款项会返还托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金 19,873.43 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”。基金管理人将于组合备付金余额清零后，向基金托管人出具《招商丰达灵活配置混合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，预计于提交申请次月，此笔款项会返还托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产 2,621,708.67 元，该金额为限售股票最后运作日估值金额，持仓明细如下：

序号	股票代码	股票名称	限售期	限售期开始日	预估上市日期	限售数量(股)	最后运作日估值价格(元)	最后运作日估值金额(元)
1	603156	养元饮品	12个月	2018-2-12	2019-2-12	37717	69.51	2,621,708.67

截至本次清算期结束日(2018年4月20日)，本基金所持限售股票尚未解禁，故需进行二次清算。本基金将于上述未变现资产全部变现后进入二次清算程序，并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二次分配。

(5) 本基金最后运作日应收利息 20,424.98 元，其中包括活期银行存款利息 20,295.02 元、上海最低备付金利息 110.72 元、上海结算保证金利息 18.82 元及期货账户备付金利息 0.42 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；期货备付金账户利息由期货公司于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月末结算入账，具体入账时间以期货公司支付备付金账户利息日为准，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管理人报酬为 9,170.29 元，该款项已于 2018 年 4 月 12 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为 3,820.95 元，该款项已于 2018 年 4 月 12 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为 0.33 元，该款项已于 2018 年 4 月 12 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为 608.70 元，该款项已于 2018 年 4 月 13 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他应付款为 190,441.94 元, 该款项包含预提信息披露费 155,341.94 元、预提持有人大会公证费 12,000.00 元、预提持有人大会律师费 20,000.00 元、预提中债账户维护费 1,500.00 元、预提上清所账户维护费 1,500.00 元及预提上清所查询费 100.00 元。其中信息披露费已于 2018 年 4 月 12 日支付, 持有人大会公证费已于 2018 年 4 月 16 日支付, 预提中债账户维护费已于 2018 年 4 月 16 日支付, 持有人大会律师费已于 2018 年 4 月 19 日支付、上清所账户维护费已于 2018 年 4 月 20 日支付上清所。

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 4 月 11 日基金净资产	50,770,186.04
加: 清算期间 (2018-4-12 至 2018-4-20) 收入	8,695.98
利息收入-银行存款利息收入 (注 1)	8,651.16
利息收入-上海最低备付金利息收入 (注 1)	36.81
利息收入-上海结算保证金利息收入 (注 1)	8.01
加: 公允价值变动损益 (注 2)	155,771.21
减: 清算期间 (2018-4-12 至 2018-4-20) 费用	9,980.00
清算费用 (注 3)	10,000.00
上清所预提查询费用冲销 (注 4)	-100.00
其他费用 (注 5)	80.00
二、2018 年 4 月 20 日基金净资产	50,924,673.23
减: 2018 年 4 月 20 日限售证券市值	2,777,479.88
三、2018 年 4 月 20 日基金可供分配净资产	48,147,193.35

注: 1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2018 年 4 月 12 日至 2018 年 4 月 20 日止清算期间的银行存款利息、上海最低备付金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、公允价值变动损益系所持限售股票清算期间的公允价值变动损益;

3、本次清算相关的清算费用优先从基金剩余财产中支付, 清算期间已支付清盘律师费用 (10,000.00 元), 剩余清算费用待收到缴款单即安排支付;

4、该冲销为本基金多预提的上清所查询费用 (100.00 元), 因上清所 2018 年 4 月未收取该笔费用, 故对多预提的查询费用于清算期间冲销, 并用于向基金份额持有人分配, A/C 类份额之间的费用分配按照各级别净值占比进行分配;

5、其他费用系自2018年4月12日至2018年4月20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2018年4月20日本基金剩余财产为人民币50,924,673.23元，其中可供第一次清算分配财产为人民币48,147,193.35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。由于本基金截至清算期结束日（2018年4月20日）所持限售股票尚未解禁，故需进行二次清算。本基金将于未变现资产全部变现后进入二次清算程序，并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二次分配。

2018年4月21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）《招商丰达灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- （2）《关于招商丰达灵活配置混合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。

招商丰达灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2018年4月20日