

招商安锦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：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日：2020年12月10日

清算报告公告日：2020年12月25日

一、 重要提示

招商安锦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 2019 年 11 月 15 日《关于准予招商安锦债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2019】2357 号）注册公开募集，自 2020 年 8 月 18 日起基金合同生效，基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《招商安锦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”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：……3、本基金基金合同生效后，连续 50 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 万元的，基金管理人应当终止本基金合同”；“第五部分 基金备案”的“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中约定，“《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，基金管理人应终止基金合同，且无需召开基金份额持有人大会。”

截至 2020 年 12 月 7 日日终，本基金已连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，已触发基金合同终止情形。本基金管理人据此决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序，且无需召开基金份额持有人大会。本基金自 2020 年 12 月 8 日起进入清算期。

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)和北京市中伦律师事务所于 2020 年 12 月 8 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，北京市中伦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	招商安锦债券型证券投资基金
基金简称	招商安锦债券
基金主代码	008458
交易代码	008458
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 18 日
最后运作日（2020-12-7）基金份额总额	161,858.56 份

投资目标	在严格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投资回报。	
投资策略	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、债券市场相对收益率、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。具体包括：（1）久期策略；（2）期限结构策略；（3）类属配置策略；（4）信用债投资策略；（5）回购投资策略；（6）个券挖掘策略；（7）资产支持证券的投资策略。	
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。	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	招商安锦债券 A	招商安锦债券 C
下属分级基金的交易代码	008458	008459
最后运作日（2020-12-7）下属分级基金的份额总额	55,581.11 份	106,277.45 份

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会 2019 年 11 月 15 日证监许可【2019】2357 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 2020 年 5 月 15 日至 2020 年 8 月 14 日向社会公开募集。本基金基金合同于 2020 年 8 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额（含利息结转的份额）总数为 337,771,467.19 份。自 2020 年 8 月 18 日至 2020 年 12 月 7 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

根据《招商安锦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”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：……3、本基金基金合同生效后，连续 50 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 万元的，基金管理人应当终止本基金合同”；“第五部分 基金备案”的“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中约定，“《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，基金管理人应终止基金合同，且无需召开基金份额持有人大会。”

截至 2020 年 12 月 7 日日终，本基金已连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，已触发基金合同终止情形。本基金管理人据此决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序，且无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人于 2020 年 12 月 8 日发布了《招商基金管理有限公司关于招商安锦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》，本基金自 2020 年 12 月 8 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：招商安锦债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 7 日

单位：人民币元

	最后运作日(2020 年 12 月 7 日)
资 产:	
银行存款	168,782.94
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
应收利息	4,964.08
资产总计	173,747.02
负 债:	
应付赎回款	-
应付管理人报酬	9.82
应付托管费	3.27
应付销售服务费	6.37
应付交易费用	-
其他负债	-
负债合计	19.46
所有者权益:	
实收基金	161,858.56
未分配利润	11,869.00

所有者权益合计	173,727.56
负债和所有者权益总计	173,747.02

注：1、基金最后运作日 2020 年 12 月 7 日，招商安锦债券 A 单位净值为 1.0973 元，份额为 55,581.11 份，资产净值为 60,991.14 元；招商安锦债券 C 单位净值为 1.0608 元，份额为 106,277.45 份，资产净值为 112,736.42 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 2020 年 12 月 8 日至 2020 年 12 月 10 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《招商安锦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 168,782.94 元，是存储于基金托管人浙商银行的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日应收利息 4,964.08 元，其中包括活期银行存款利息 2,849.08 元和最低备付金利息 2,115.00 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；最低备付金利息由中国证券登记结算有限责任公司于每季度 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 9.82 元，该款项已于 2020 年 12 月 9 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费 3.27 元，该款项已于 2020 年 12 月 9 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费 6.37 元，该款项已于 2020 年 12 月 9 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 2020 年 12 月 7 日基金净资产	173,727.56
加：清算期间（2020-12-8 至 2020-12-10）收入	4.92
其中：利息收入-银行存款利息收入（注 1）	4.92
利息收入-最低结算备付金利息收入（注 1）	-
利息收入-交易保证金利息收入（注 1）	-
利息收入-债券利息收入（注 2）	-
投资收益（注 3）	-
减：清算期间（2020-12-8 至 2020-12-10）费用	-
交易费用（注 4）	-
银行汇划费（注 5）	-
清算费用（注 6）	-
二、2020 年 12 月 10 日基金净资产	173,732.48

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2020 年 12 月 8 日至 2020 年 12 月 10 日止清算期间的利息；

2、债券利息收入系以当前适用债券利率计提的清算期间卖出前的债券利息；

3、投资收益为卖出债券产生的投资收益；

4、交易费用为卖出债券产生的应付交易费用；

5、银行汇划费为期间资金划付产生的费用；

6、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。

资产处置及负债清偿后，于 2020 年 12 月 10 日本基金剩余财产为人民币 173,732.48 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。

2020 年 12 月 11 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)《招商安锦债券型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《关于招商安锦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。

招商安锦债券型证券投资基金财产清算小组

2020年12月25日