

招商稳荣定期开放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：宁波银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年2月4日

清算报告公告日：2021年2月9日

一、 重要提示

招商稳荣定期开放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 9 月 2 日《关于准予招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2010 号）注册公开募集，自 2016 年 10 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，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《招商稳荣定期开放灵活配置混合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”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：……3、基金合同生效后，在开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，基金合同终止并根据基金合同的约定进行财产清算：（1）基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元；（2）基金份额持有人人数少于 200 人。”；“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，“本基金自《基金合同》生效后，在开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，基金合同终止并根据本基金《基金合同》第二十部分的约定进行财产清算：1、基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元；2、基金份额持有人人数少于 200 人。”

截至 2021 年 1 月 29 日日终，本基金基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额已低于 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 2021 年 1 月 30 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 2021 年 1 月 30 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	招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	招商稳荣定开灵活混合
基金主代码	003351
交易代码	003351

基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2016年10月25日	
最后运作日（2021-1-29）基金份额总额	20,640,577.77份	
投资目标	在严格控制风险的基础上，通过定期开放的形式保持适度流动性，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。	
投资策略	<p>本基金通过对我国宏观经济指标、国家产业政策、货币政策和财政政策及我国资本市场的运行状况等深入研究，判断我国宏观经济发展趋势、中短期利率走势、债券市场预期风险水平和相对收益率。结合本基金封闭期和开放期的设置，采用不同的投资策略。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 大类资产配置策略； 2. 股票投资策略； 3. 债券投资策略； 4. 权证投资策略； 5. 股指期货投资策略； 6. 国债期货投资策略； 7. 资产支持证券投资策略； 8. 中小企业私募债券投资策略； 9. 存托凭证投资策略。 <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的流动性，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，主要配置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	中证全债指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%	
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场型基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	招商稳荣定开灵活混合 A	招商稳荣定开灵活混合 C
下属分级基金的交易代码	003351	003352
最后运作日（2021-1-29）下属分级基金的份额总额	19,868,905.63份	771,672.14份

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会2016年9月2日证监许可【2016】2010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10月17日至2016年10月20日向社会公

开募集。本基金基金合同于 2016 年 10 月 25 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 1,815,860,375.25 份。自 2016 年 10 月 25 日至 2021 年 1 月 29 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

根据《招商稳荣定期开放灵活配置混合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”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：……3、基金合同生效后，在开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，基金合同终止并根据基金合同的约定进行财产清算：（1）基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元；（2）基金份额持有人人数少于 200 人。”；“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，“本基金自《基金合同》生效后，在开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，基金合同终止并根据本基金《基金合同》第二十部分的约定进行财产清算：1、基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元；2、基金份额持有人人数少于 200 人。”

截至 2021 年 1 月 29 日日终，本基金基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额已低于 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 2021 年 1 月 30 日发布了《招商基金管理有限公司关于招商稳荣定期开放灵活配置混合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 2021 年 1 月 30 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：招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 1 月 29 日

单位：人民币元

	最后运作日 2021 年 1 月 29 日
资 产：	

银行存款	5,980,724.22
结算备付金	13,589,723.43
存出保证金	4,197.95
交易性金融资产	12,138,393.80
应收利息	26,535.50
应收销售款	199.71
应收证券清算款	6,445,738.29
资产总计	38,185,512.90
负 债:	
应付管理人报酬	89,386.32
应付托管费	8,938.64
应付销售服务费	354.93
应付交易费用	20,785.58
应付税费	9,704.69
应付赎回款	14,108,217.04
其他应付款	83,000.00
负债合计	14,320,387.20
所有者权益:	
实收基金	20,640,577.77
未分配利润	3,224,547.93
所有者权益合计	23,865,125.70
负债和所有者权益总计	38,185,512.90

注：1、基金最后运作日 2021 年 1 月 29 日，招商稳荣定开灵活混合 A 单位净值为 1.1571 元，份额为 19,868,905.63 份，资产净值为 22,991,062.16 元；招商稳荣定开灵活混合 C 单位净值为 1.1327 元，份额为 771,672.14 份，资产净值为 874,063.54 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 2021 年 1 月 30 日至 2021 年 2 月 4 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 2021 年 2 月 4 日(清算结束日)仍持有未上市证券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《招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金》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剩余财产中支付。

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 5,980,724.22 元,是存储于基金托管人宁波银行的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日结算备付金 13,589,723.43 元。其中,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 2,731,739.13 元。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”。于 2021 年 2 月 2 日,结算备付金实际调回托管账户 1,183,239.13 元,剩余金额预计于下月第二个工作日调回托管账户。此外,由兴证期货、安信期货、中投天琪期货公司收取并保管的期货备付金共 10,857,984.30 元,上述期货备付金于 2 月 1 日调回托管账户 7,712,333.10 元,于 2 月 4 日调回托管账户 3,139,624.20 元,剩余 6,027.00 元预计于 2 月 5 日调回托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金 4,197.95 元,是由中国证券登记结算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《招商稳荣定期开放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 12,138,393.80 元，其中，未上市证券持仓明细如下：

序号	证券代码	证券名称	成功认购日	数量(股/张)	最后运作日 估值价格 (元)	最后运作日估值 金额(元)
1	605337	李子园	2021-1-29	488	20.04	9,779.52
2	113042	上银转债	2021-1-27	760	100.00	75,998.50

截至本次清算期结束日（2021年2月4日），本基金所持部分证券尚未上市流通，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 26,535.50 元，其中包括活期银行存款利息 8,311.54 元、上海最低备付金利息 4,552.02 元、期货备付金利息 15,025.86 元、结算保证金利息 7.71 元、应收债券利息 87.36 元及应收买入返售金融资产利息-1,448.99 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；最低备付金利息及结算保证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；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。应收债券利息除未上市证券应收利息 2.50 元待上市变现后结算入账外，均已在清算期内结算入账。应收买入返售金融资产利息为交易所逆回购到期跨节假日结算产生的预结转金额，截至 1 月 31 日已完成该预结转金额的补提。

(6) 本基金最后运作日应收申购款 199.71 元，为 1 月 29 日确认的申购款，已于 2 月 1 日结算入账。

(7) 本基金最后运作日应收证券清算款为 6,445,738.29 元，为证券交易产生的应收清算款项，已分别于 2 月 1 日和 2 月 2 日结清。

(8) 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结算备付金未调回部分、交易保证金、应收银行存款利息、应收备付金利息，以及应收交易保证金利息。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 89,386.32 元，该款项已于 2021 年 2 月 1 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为 8,938.64 元, 该款项已于 2021 年 2 月 1 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为 354.93 元, 该款项已于 2021 年 2 月 1 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为 20,785.58 元, 该款项已于 2021 年 2 月 1 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付税费为 9,704.69 元, 该款项已于 2021 年 2 月 1 日支付。

(6) 本基金最后运作日应付赎回款为 14,108,217.04 元, 该款项已分别于 2021 年 2 月 1 日和 2 月 2 日支付。

(7) 本基金最后运作日其他应付款为 83,000.00 元, 该款项包含预提信息披露费 80,000.00 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。上述款项已于 2021 年 2 月 2 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 2021 年 1 月 29 日基金净资产	23,865,125.70
加：清算期间（2021-1-30 至 2021-2-4）利息收入	4,942.02
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	1,116.30
利息收入-债券利息收入（注 1）	7.32
利息收入-买入返售金融资产利息收入（注 1）	1,448.99
利息收入-备付金利息收入（注 1）	2,367.39
利息收入-结算保证金利息收入（注 1）	2.02
加：公允价值变动损益（注 2）	-1,189,940.43
加：清算期间（2021-1-30 至 2021-2-4）投资收益（注 3）	1,300,461.64
投资收益-股票投资收益（注 3）	1,293,948.57
投资收益-债券投资收益（注 3）	10,973.60
投资收益-股利收益（注 3）	-4,460.53
加：其他收入-赎回费归资产（注 4）	14.58
减：清算期间（2021-1-30 至 2021-2-4）费用	24,382.46
交易费用（注 5）	24,282.45
上清所预提查询费用（注 6）	100.00
税金及附加（注 7）	0.01
减：基金净赎回金额（于 2021 年 2 月 1 日确认的投资者赎回申请）	5,401,195.70
二、2021 年 2 月 4 日基金净资产	18,555,025.35
减：2021 年 2 月 4 日未上市证券市值（注 8）	107,137.04

减：2021年2月4日未上市证券应收利息	5.50
三、2021年2月4日基金可供分配净资产	18,447,882.81

注：1、利息收入系以当前适用的利率估计计提的自2021年1月30日至2021年2月4日止清算期间的银行存款利息、最低备付金利息、期货备付金利息和结算保证金利息，以及清算期间买入返售金融资产利息收入和债券利息收入；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股票、债券清算期间的公允价值变动损益；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；

3、投资收益系所持股票和债券在清算期间处置所得的投资收益；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；

4、其他收入系清算期间产生的赎回费用归基金资产部分所产生的收入；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；

5、交易费用系清算期间产生的交易费用；A/C类份额之间的费用分配按照各级别净值占比进行分摊；

6、上清所预提查询费用系上清所查询费用；A/C类份额之间的费用分配按照各级别净值占比进行分摊；

7、税金及附加系清算期间债券利息收入增值税为基础计提的附加税；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；

8、未上市证券除最后运作日已确认为资产的李子园（605337）和上银转债（113042）外，还包括2021年2月1日确认的华康股份（605077）和2021年2月3日确认的鑫铂股份（003038）。新确认资产的持仓明细如下：

序号	证券代码	证券名称	成功认购日	数量(股/张)	清算报告出具日估值价格(元)	清算报告出具日估值金额(元)
1	605077	华康股份	2021-2-1	330	51.63	17,037.90
2	003038	鑫铂股份	2021-2-3	239	18.08	4,321.12

资产处置及负债清偿后，于2021年2月4日本基金剩余财产为人民币18,555,025.35元，其中可供第一次清算分配财产为人民币18,447,882.81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（2021年2月4日）所持部分证券尚未上市流通，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。

2021年2月5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)《招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《关于招商稳荣定期开放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。

招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2021年2月4日