

# 招商睿诚定期开放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：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年7月31日

清算报告公告日：2018年9月7日

## 一、重要提示

招商睿诚定期开放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 7 月 25 日《关于准予招商睿诚定期开放混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】1692 号）注册公开募集，自 2017 年 4 月 28 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》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《招商睿诚定期开放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，在履行相关程序后，《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《关于终止招商睿诚定期开放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 5 月 18 日刊登了《关于以通讯方式召开招商睿诚定期开放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 5 月 21 日、2018 年 5 月 22 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 6 月 20 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 6 月 21 日刊登了《关于招商睿诚定期开放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 6 月 28 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	招商睿诚定期开放混合型证券投资基金
基金简称	招商睿诚定开混合
基金主代码	003326

交易代码	003326
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年4月28日
最后运作日（2018-6-27） 基金份额总额	50,029,686.83份
投资目标	在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，追求较高回报率，力争实现基金资产长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采取运作周期和到期开放期相结合的运作方式，在每个运作周期内，本基金在封闭期内封闭运作，封闭期与封闭期之间的期间开放期定期开放。本基金在封闭期与开放期（包括期间开放期和到期开放期）采取不同的投资策略。</p> <p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金的投资组合在债券久期与运作周期进行适当匹配的基础上，将视大类资产的市场环境实施积极的投资组合管理，以获取较高的组合投资收益。本基金的具体投资策略包括：（1）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）可转换债券和可交换债券投资策略、（6）股指期货投资策略、（7）国债期货投资策略、（8）中小企业私募债券投资策略、（9）资产支持证券投资策略。</p> <p>2、开放期投资策略</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	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。
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2016年7月25日证监许可【2016】1692号文注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定自2017年1月25日至2017年4月24日止向社会公开募集。本基金基金合同于2017年4月28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200,028,814.04份。自2017年4月28日至2018年6月27日期间，本基金按基金合同约定正常运作（2018年6月21日至2018年6月27日期间根据基金份额持有人大会决议开放办理基金的赎回和转换转出业务）。

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》、《招商睿诚定期开放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 6 月 20 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 6 月 21 日刊登了《关于招商睿诚定期开放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》。根据基金份额持有人大会决议，基金管理人于 2018 年 6 月 21 日刊登了《关于开放招商睿诚定期开放混合型证券投资基金赎回和转换转出业务的公告》，本基金自 2018 年 6 月 21 日起至 2018 年 6 月 27 日开放基金的赎回和转换转出业务。本基金从 2018 年 6 月 28 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：招商睿诚定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 27 日

单位：人民币元

	最后运作日 2018 年 6 月 27 日
<b>资 产：</b>	
银行存款	14,297,010.81
结算备付金	49,358.93
存出保证金	22,529.94
交易性金融资产	16,869,804.64
买入返售金融资产	20,000,000.00
应收利息	203,036.07
应收证券清算款	154,444.64
资产总计	51,596,185.03
<b>负 债：</b>	
应付赎回款	10.10
应付赎回费	0.09
应付管理人报酬	58,127.20
应付托管费	7,750.30
应付交易费用	59,759.57
应交税费	0.91

其他应付款	29,000.00
负债合计	154,648.17
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	50,029,686.83
未分配利润	1,411,850.03
所有者权益合计	51,441,536.86
负债和所有者权益总计	51,596,185.03

注：1、基金最后运作日 2018 年 6 月 27 日，招商睿诚定开混合单位净值为 1.0282 元，份额为 50,029,686.83 份，资产净值为 51,441,536.86 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 6 月 28 日至 2018 年 7 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。

由于本基金于 2018 年 7 月 31 日(清算结束日)仍持有限售股票尚未解禁、临时停牌股票尚未复牌,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《招商睿诚定期开放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 14,297,010.81 元，是存储于基金托管人中国民生银行的

活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日结算备付金 49,358.93 元,是由中国证券登记结算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 8 月 2 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 22,529.94 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,向基金托管人提出申请调回结算保证金,预期于 8 月 2 日,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 16,869,804.64 元,投资组合情况如下:

序号	项目	金额(元)
1	股票	10,285,648.74
2	债券	6,584,155.90
3	合计	16,869,804.64

其中因认购新发证券而于最后运作日持有的限售股票持仓明细如下:

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)
603156	养元饮品	12个月	2018-2-12	2019-2-12	52,804	54.52	2,878,874.08

其中最后运作日持有的临时停牌股票持仓明细如下:

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	复牌日期	最后运作日估值价格(元)	数量(股)	最后运作日估值金额(元)
601390	中国中铁	2018-5-7	重大事项	-	7.47	1,700	12,699.00

截至本次清算期结束日(2018年7月31日),本基金所持限售股票尚未解禁、临时停牌股票尚未复牌,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) 本基金最后运作日买入返售金融资产 20,000,000.00 元,该项投资已于 2018 年 7 月 3 日到期结算入账。

(6) 本基金最后运作日应收利息 203,036.07 元,其中包括活期银行存款利息 3,900.72

元、最低备付金利息 13.32 元、结算保证金利息 6.06 元、债券利息 195,499.53 元及回购利息 3,616.44 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；债券利息已于清算期间卖出债券时结算入账；回购利息已于 2018 年 7 月 3 日回购到期日结算入账。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尚未收讫的利息。

(7) 本基金最后运作日应收证券清算款 154,444.64 元，该款项已于 2018 年 6 月 28 日结算入账。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为 10.10 元，该款项已于 2018 年 6 月 29 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付赎回费为 0.09 元，该款项已于 2018 年 6 月 29 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 58,127.20 元，该款项已于 2018 年 6 月 28 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为 7,750.30 元，该款项已于 2018 年 6 月 28 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用为 59,759.57 元，该款项已于清算期间支付，其中，应付上清算所结算手续费 560.00 元已于 2018 年 6 月 28 日支付，应付佣金 58,405.42 元已于 2018 年 7 月 4 日支付，应付中债结算手续费 440.00 元已于 2018 年 7 月 6 日支付，应付外汇交易中心交易手续费 354.15 元已于 2018 年 7 月 17 日支付。

(6) 本基金最后运作日应交税费 0.91 元，该款项已于 2018 年 7 月 12 日支付。

(7) 本基金最后运作日其他应付款 29,000.00 元，该款项包含预提清算审计费 20,000.00 元、预提 2018 年 2 季度中债账户维护费 4,500.00 元、预提 2018 年 2 季度上交所账户维护费 4,500.00 元。其中上交所账户维护费已于 2018 年 6 月 28 日支付、预提中债账户维护费已于 2018 年 7 月 6 日支付，预提清算审计费将于清算审计完成并收到会计师事务所付费单后支付。

### 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 6 月 27 日基金净资产	51,441,536.86
加：清算期间（2018-6-28 至 2018-7-31）收入	-160,100.46
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	25,524.33
利息收入-最低备付金利息收入（注 1）	157.52
利息收入-结算保证金利息收入（注 1）	36.58
利息收入-债券利息收入（注 2）	13,261.84
利息收入-买入返售证券利息收入（注 3）	21,698.62
股票投资收益（注 4）	1,321,115.37
债券投资收益（注 5）	16,545.35
股利收益（注 6）	8,690.89
公允价值变动损益（注 7）	-1,567,130.96
减：清算期间（2018-6-28 至 2018-7-31）费用	15,044.70
交易费用（注 8）	14,994.62
其他费用（注 9）	50.08
二、2018 年 7 月 31 日基金净资产	51,266,391.70
减：2018 年 7 月 31 日限售证券市值	2,632,646.48
三、2018 年 7 月 31 日基金可供分配净资产	48,633,745.22

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2018 年 6 月 28 日至 2018 年 7 月 31 日止清算期间的银行存款利息、最低备付金利息和结算保证金利息；

2、利息收入-债券利息收入系清算期间所持有债券投资的利息收入；

3、利息收入-买入返售证券利息收入系清算期间所持有买入返售证券的利息收入；

4、股票投资收益系清算期间卖出所持股票获得的差价收入；

5、债券投资收益系清算期间卖出所持债券获得的差价收入；

6、股利收益系清算期间所持股票获得的分红收入；

7、公允价值变动损益系所持股票及债券清算期间的公允价值变动损益；

8、交易费用系清算期间卖出所持股票及债券所支付的交易费用；

9、其他费用系自 2018 年 6 月 28 日至 2018 年 7 月 31 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 7 月 31 日本基金剩余财产为人民币 51,266,391.70 元，其中可供第一次清算分配财产为人民币 48,633,745.22 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 7 月 31 日）所持限售股票尚未

解禁、所持临时停牌普票尚未复牌，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8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)《招商睿诚定期开放混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《招商睿诚定期开放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。

招商睿诚定期开放混合型证券投资基金财产清算小组

2018年7月31日