

招商稳祥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：2018年11月23日

清算报告公告日：2018年12月28日

一、 重要提示

招商稳祥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 8 月 30 日《关于准予招商稳祥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】1990 号）注册公开募集，自 2016 年 10 月 11 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《招商稳祥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，“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。”

2018 年 11 月 12 日（含）至 2018 年 11 月 16 日（含）为本基金第二次开放期，开放期间投资者可办理申购、赎回及转换业务。截至本次开放期的最后一日（即 2018 年 11 月 16 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低于 5000 万元，已触发基金合同中约定的合同终止情形。本基金管理人据此应当终止基金合同，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 2018 年 11 月 19 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）和上海源泰律师事务所于 2018 年 11 月 19 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	招商稳祥定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	招商稳祥定开灵活混合
基金主代码	003355
交易代码	003355
基金运作方式	契约型，以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式
基金合同生效日	2016 年 10 月 11 日
最后运作日（2018-11-16） 基金份额总额	39,320,515.31 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。 <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	招商稳祥定开灵活混合 A	招商稳祥定开灵活混合 C
下属分级基金的交易代码	003355	003356
最后运作日（2018-11-16） 下属分级基金的份额总额	27,667,819.25 份	11,652,696.06 份

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会 2016 年 8 月 30 日证监许可【2016】1990 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 2016 年 9 月 13 日起至 2016 年 9 月 28 日止向社会公开募集。本基金基金合同于 2016 年 10 月 11 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 758,834,602.01 份。自 2016 年 10 月 11 日至 2018 年 10 月 18 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

根据《招商稳祥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，“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”。

根据基金管理人于 2018 年 11 月 7 日发布的《关于招商稳祥定期开放灵活配置混合型证券投资基金第二个开放期开放申购赎回及转换业务的公告》，2018 年 11 月 12 日（含）至 2018 年 11 月 16 日（含）为本基金第二次开放期，开放期间投资者可办理申购、赎回及转换业务。截至本次开放期的最后一日（即 2018 年 11 月 16 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低于 5000 万元，已触发基金合同中约定的合同终止情形。本基金管理人据此应当终止基金合同，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 2018 年 11 月 20 日发布了《招商基金管理有限公司关于招商稳祥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 2018 年 11 月 19 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：招商稳祥定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 11 月 16 日

单位：人民币元

	最后运作日 2018 年 11 月 16 日
资 产：	
银行存款	52,805,288.18
结算备付金	178,296.25
存出保证金	100,748.52
股票投资	3,466,861.93
债券投资	16,954,354.81
应收利息	130,936.69
应收证券清算款	3,527,603.32

资产总计	77,164,089.70
负 债:	
应付管理人报酬	65,748.82
应付托管费	12,327.93
应付销售服务费	9,531.90
应付交易费用	80,233.13
应付赎回款	37,362,326.74
应付税费	1,636.47
其他负债	269,011.20
负债合计	37,800,816.19
所有者权益:	
实收基金	39,320,515.31
未分配利润	42,758.20
所有者权益合计	39,363,273.51
负债和所有者权益总计	77,164,089.70

注：1、基金最后运作日 2018 年 11 月 16 日，招商稳祥定开灵活混合 A 单位净值为 1.0054 元，份额为 27,667,819.25 份，资产净值为 27,817,734.13 元；招商稳祥定开灵活混合 C 单位净值为 0.9908 元，份额为 11,652,696.06 份，资产净值为 11,545,539.38 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 11 月 19 日起至 2018 年 11 月 23 日止为本基金的清算期间，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。

截至 2018 年 11 月 23 日(清算结束日)，本基金仍持有未上市债券，本基金将于上述资产全部变现后，将变现后的财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款，并按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《招商稳祥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”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 52,805,288.18 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 178,296.25 元。其中 175,353.49 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”。此笔款项预期于 2019 年 1 月 3 日返还托管账户。

剩余 2,942.76 元为安信期货收取并保管的期货保证金，此笔款项已于 11 月 21 日返还托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金 100,748.52 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”。此款项预期于 12 月 4 日返还托管账户。

(4) 本基金最后运作日股票投资 3,466,861.93 元，持仓明细如下。截止至 2018 年 11 月 23 日交易所闭市，以下股票已全部卖出，卖券清算款预计最晚于 2018 年 11 月 26 日到账。

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	公允价值（人民币元）
1	300408	三环集团	100,000	1,913,000.00
2	300760	迈瑞医疗	6,407	708,934.55
3	300166	东方国信	50,000	630,500.00
4	601319	中国人保	37,013	178,032.53
5	300674	宇信科技	1,541	36,136.45
6	603900	莱绅通灵	20	258.40

(5) 本基金最后运作日债券投资 16,954,354.81 元，持仓明细如下。以下债券除光电转债外，已在清算期全部卖出，卖券清算款也已到账。

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	公允价值（人民币元）
----	------	------	-------	------------

1	010303	03 国债(3)	100,000	10,049,000.00
2	136417	16 万达 02	44,000	4,388,120.00
3	132007	16 凤凰 EB	24,480	2,366,236.80
4	128047	光电转债	1,510	150,998.01

截至 2018 年 11 月 23 日(清算结束日)，本基金所持有的光电转债仍处于未上市状态，本基金将于上述资产全部变现后，将变现后的财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款，并按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(6) 本基金最后运作日应收利息 130,936.69 元，包含活期银行存款应收利息 25,028.57 元、最低备付金利息 1,569.42 元、期货保证金利息 3.54 元、结算保证金应收利息 256.74 元，债券应收利息 104,078.42 元。其中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；股指期货保证金利息将于期货账户注销时一次性结清；应收债券利息已于债券卖出交易中包含在变现对价当中。

(7) 本基金最后运作日应收证券清算款 3,527,603.32 元，该款项已于 2018 年 11 月 19 日结算入账。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为 65,748.82 元，该款项已于 2018 年 11 月 20 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为 12,327.93 元，该款项已于 2018 年 11 月 20 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为 9,531.90 元，该款项已于 2018 年 11 月 20 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为 80,233.13 元，其中应付佣金 79,179.45 元，该款项已于 2018 年 11 月 20 日支付，但因清算期仍有交易所卖出交易导致此费用在清盘期间又有发生，该款项待未上市资产变现后支付；其中应付银行间市场交易费用 1,053.68 元，该款项将于收到结算公司付费单后进行支付。

(5) 本基金最后运作日应付赎回款为 37,362,326.74 元，是最后运作日确认的 2018 年 11 月 14 日、11 月 15 日的投资者赎回申请，该款项已于 2018 年 11 月 19 日、11 月 20 日支付。

(6) 本基金最后运作日应交税费为 1,636.47 元，该款项待持仓债券处置变现后支付。

(7) 本基金最后运作日其他负债为 269,011.20 元, 该款项包含预提信息披露费 263,011.20 元、预提中债账户维护费 3,000.00 元、预提上清所账户维护费 3,000.00 元。其中信息披露费已于 2018 年 11 月 23 日支付; 预提中债账户维护费将于收到中债付费单后进行支付; 预提上清所账户维护费将于收到上清所付费单后进行支付。

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11月16日)基金净资产	39,363,273.51
加: 清算期间(2018年11月19日至2018年11月23日)收入	61,274.38
其中: 利息收入-银行存款利息收入(注1)	5,204.54
利息收入-债券利息收入(注1)	4,461.96
投资收益-股票投资(注2)	262,849.79
投资收益-债券投资(注2)	543,745.04
投资收益-股息红利税(注2)	-0.56
公允价值变动损益-股票投资(注3)	-234,604.83
公允价值变动损益-债券投资(注3)	-520,381.56
减: 清算期间(2018年11月19日至2018年11月23日)费用	7,082.07
其中: 交易费用-交易所交易费用(注4)	7,077.07
税金及附加(注5)	5.00
清算费用(注6)	-
减: 基金净赎回金额(于2018年11月19日确认的投资者赎回申请)	23,193,117.14
二、2018年11月23日基金净资产	16,224,348.68

注: 1、利息收入是以当前适用的利率计提的 2018 年 11 月 17 日至 2018 年 11 月 18 日以及 2018 年 11 月 19 日至 2018 年 11 月 23 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息和债券利息; 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、投资收益是清算期间卖出股票和债券产生的差价收入, 以及应缴股息红利税款; 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、公允价值变动损益是所持股票和债券在清算期间的公允价值变动损益, 以及卖出股票和债券时所结转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;

4、交易费用为清算期间卖出股票和债券产生的交易费用; A/C 类份额之间的费用分配按照各级别净值占比进行分配;

5、税金及附加系以 2018 年 11 月 17 日至 2018 年 11 月 18 日以及 2018 年 11 月 19 日

至 2018 年 11 月 23 日止清算期间计提的增值税和附加税；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；

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 2018 年 11 月 23 日本基金剩余财产为人民币 16,224,348.68 元，包括招商稳祥定期开灵活混合 A 人民币 7,135,151.76 元和招商稳祥定期开灵活混合 C 人民币 9,089,196.92 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 11 月 24 日至清算款划出日前一日的银行存款孳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)《招商稳祥定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《关于招商稳祥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。

招商稳祥定期开放灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2018 年 11 月 23 日