

招商兴华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：浙商银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年1月8日

清算报告公告日：2018年2月9日

一、重要提示

招商兴华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 11 月 22 日《关于准予招商兴华灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2804 号文）注册公开募集，自 2016 年 12 月 16 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《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《招商兴华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，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《关于终止招商兴华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 2017 年 11 月 15 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兴华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 2017 年 11 月 16 日、2017 年 11 月 17 日陆续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会于 2017 年 12 月 21 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 2017 年 12 月 22 日刊登了《关于招商兴华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 2017 年 12 月 25 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。

1、基金概况

基金名称	招商兴华灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	招商兴华混合
基金主代码	004018
交易代码	004018

基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月16日
最后运作日(2017年12月22日)基金份额总额	5,006,803.49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,力争为投资人获取稳健回报。
投资策略	<p>资产配置策略: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,在各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>股票投资策略:本基金以定性和定量分析为基础进行股票投资。</p> <p>债券投资策略:本基金采用的固定收益品种主要投资策略包括:久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。</p> <p>权证投资策略:本基金对权证资产的投资主要是通过分析影响权证内在价值最重要的两种因素——标的资产价格以及市场隐含波动率的变化,灵活构建避险策略,波动率差策略以及套利策略。</p> <p>股指期货投资策略:本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。</p> <p>国债期货投资策略:本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险,本基金将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,适度运用国债期货提高投资组合运作效率。</p> <p>中小企业私募债券投资策略:中小企业私募债券具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。</p> <p>资产支持证券投资策略:本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上,对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。</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	浙商银行股份有限公司

下属基金份额的基金简称	招商兴华灵活配置 A	招商兴华灵活配置 C
下属基金份额的交易代码	004018	004019
最后运作日（2017 年 12 月 22 日）下属基金份额总额	5,006,774.82 份	28.67 份

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2016】2804 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 12 月 14 日向社会公开募集。本基金基金合同于 2016 年 12 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为 200,006,389.95 份。自 2016 年 12 月 16 日至 2017 年 12 月 22 日期间，本基金正常运作。

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》、《招商兴华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 2017 年 12 月 21 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 2017 年 12 月 22 日刊登了《关于招商兴华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 2017 年 12 月 25 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：招商兴华灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 22 日

单位：人民币元

	最后运作日 2017 年 12 月 22 日
资产：	
银行存款	5,538,324.20
存出保证金	60,510.63
应收利息	113.49
资产总计	5,598,948.32
负债：	
应付管理人报酬	2,007.06
应付托管费	669.02
应付交易费用	146.05
其他负债	3,000.00
负债合计	5,822.13

所有者权益：	
实收基金	5,006,803.49
未分配利润	586,322.70
所有者权益合计	5,593,126.19
负债和所有者权益总计	5,598,948.32

注：1、基金最后运作日 2017 年 12 月 22 日，招商兴华灵活配置 A 单位净值为 1.1171 元，份额为 5,006,774.82 份，资产净值为 5,593,094.10 元；招商兴华灵活配置 C 单位净值为 1.1193 元，份额为 28.67 份，资产净值为 32.09 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 2017 年 12 月 25 日至 2018 年 1 月 8 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《招商兴华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 5,538,324.20 元，是存储于基金托管人浙商银行的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日存出保证金 60,510.63 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”。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) 本基金最后运作日应收利息 113.49 元，包含活期银行存款应收利息 110.77 元和上海

结算保证金应收利息 2.72 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。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 2,007.06 元，该款项已于 2017 年 12 月 26 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为 669.02 元，该款项已于 2017 年 12 月 26 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付交易费用为 146.05 元，该款项已于 2017 年 12 月 26 日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为 3,000.00 元，该款项为预提由中央国债登记结算有限公司收取的账户维护费，该款项已于 2017 年 12 月 26 日支付。

4、清算期间的剩余资产分配情况

(1) 招商兴华灵活配置 A（基金代码：004018）

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日（2017 年 12 月 22 日）基金净资产	5,593,094.10
加：清算期间（2017 年 12 月 25 日至 2018 年 1 月 8 日）收入	2,040.89
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	1,992.41
利息收入-上海结算保证金利息收入（注 1）	48.48
减：清算期间（2017 年 12 月 25 日至 2018 年 1 月 8 日）费用	-
清算费用（注 2）	-
减：基金净赎回金额（于 2017 年 12 月 25 日确认的投资者赎回申请）	13.11
二、2018 年 1 月 8 日基金净资产	5,595,121.88

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的 2017 年 12 月 23 日、2017 年 12 月 24 日以及自 2017 年 12 月 25 日至 2018 年 1 月 8 日期间的银行存款利息和结算保证金利息；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、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；

(2) 招商兴华灵活配置 C（基金代码：004019）

单位：人民币元

项目	金额
----	----

一、最后运作日 2017 年 12 月 22 日基金净资产	32.09
加：清算期间（2017-12-25 至 2018-1-8）收入	0.01
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	0.01
利息收入-上海结算保证金利息收入（注 1）	-
减：清算期间（2017 年 12 月 25 日至 2018 年 1 月 8 日）费用	-
清算费用（注 2）	-
二、2018 年 1 月 8 日基金净资产	32.10

注：1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2017 年 12 月 23 日至 2018 年 1 月 8 日期间的银行存款利息和结算保证金利息；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、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 1 月 8 日本基金剩余财产为人民币 5,595,153.98 元，包括招商兴华灵活配置 A 人民币 5,595,121.88 元和招商兴华灵活配置 C 人民币 32.10 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 1 月 9 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)《招商兴华灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- (2)《关于招商兴华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。

招商兴华灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2018年1月8日