

# 招商盛达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:中国银行股份有限公司

清算报告出具日:2021年7月29日

清算报告公告日:2021年8月11日

## 一、重要提示

招商盛达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5月4日《关于准予招商盛达灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]1972号)注册公开募集,自2016年8月30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:(一)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:(一)基金份额持有人大会决定终止”;根据《招商盛达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,经履行相关程序后,《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《关于终止招商盛达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2021年6月17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盛达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2021年6月18日、2021年6月21日陆续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会于2021年7月19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2021年7月20日刊登了《关于招商盛达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)和北京市中伦律师事务所于2021年7月21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	招商盛达灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	招商盛达混合	
基金主代码	002823	
交易代码	002823	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年8月30日	
最后运作日 0021-07-20 基金份额总额	4,628,582.02份	
投资目标	本基金通过本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为投资者获取稳健回报。	
投资策略	大类资产配置策略:本基金依据定期公布的经济和金融数据以及投资视野对于宏观经济、货币政策、市场趋势的综合分析,重点关注GDP、增速、固定资产投资增速、净出口、通胀、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的动态趋势,同时强调金融市场投资者行为分析,关注资本市场资金供求关系变化等因素,在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济、货币政策对资本市场的影响方向和力度,形成资产配置的整体规划,灵活调整股票资产仓位。 股票投资策略:本基金采取自下而上的选股策略。 债券投资策略:本基金采用债券投资策略包括:久期策略、期限结构策略、个券选择策略和相对价值判断策略等,对于可转换公司债券等特殊品种,将根据其特点采取相应的投资策略。 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、波动率策略以及套利策略。 股指期货投资策略:本基金股指期货投资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。 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。 高信用等级证券投资策略:在控制风险的前提下,本基金对资产支持证券从五个方面综合评价,选择低估值品种进行投资。 存托凭证投资策略:在控制风险的前提下,本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入判断,进行存托凭证的投资。	

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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	招商盛达混合A	招商盛达混合C
下属分级基金的交易代码	002823	002824
最后运作日 0021-07-20 下属分级基金份额总额	3,023,840.01份	1,604,742.01份

## 三、基金运作情况

本基金经中国证监会2016年5月4日证监许可[2016]1972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8月1日至2016年8月26日止向社会公开募集,本基金基金合同于2016年8月30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376,197,608.43份。自2016年8月30日至2021年7月20日期间,本基金按基金合同约定正常运作。

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》、《招商盛达灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关规定,经基金份额持有人大会2021年7月19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2021年7月20日刊登了《关于招商盛达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2021年7月21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:招商盛达灵活配置混合型证券投资基金  
报告截止日:2021年7月20日

单位:人民币元

	最后运作日 2021年7月20日
资产:	
银行存款	8,166,858.77
结算备付金	162,857.14
存出保证金	12,741.34
应收利息	4,935.00
资产总计	8,347,392.25
负债:	
应付赎回款	160,572.80
应付赎回费	143.05
应付管理人报酬	17,055.06
应付托管费	2,842.48
应付销售服务费	82.56
其他负债	43,726.41
负债合计	224,422.36
所有者权益:	
实收基金	4,628,582.02
未分配利润	3,494,387.87
所有者权益合计	8,122,969.89
负债和所有者权益总计	8,347,392.25

注:1、基金最后运作日2021年7月20日,招商盛达灵活A单位净值为1.770元,份额为3,023,840.01份,资产净值为5,353,428.31元;招商盛达灵活C单位净值为1.726元,份额为1,604,742.01份,资产净值为2,769,541.58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7月21日至2021年7月29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《招商盛达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8,166,858.77元,是存储于基金托管人中国银行的活期银行存款。

(2)本基金最后运作日结算备付金162,857.14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重新核算、调整。”基金管理人已于2021年7月22日向基金托管人出具《招商盛达灵活配置混合型证券投资基金申请调回备付金及保证金申请书》,申请调回结算备付金,该款项预计于2021年8月3日返还托管账户。

(3)本基金最后运作日存出保证金12,741.34元,是由中国证券登记结算公司收取并保管的存出保证金。存出保证金每月调整一次,根据《结算备付金管理业务指南》,“中国证券登记结算有限责任公司于每月初第二个交易日,根据结算参与人对对应结算备付金账户前6个月日均结算净额调整其结算户保金额度,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尚未退还的存出保证金。

(4)本基金最后运作日应收利息4,935.00元,其中包括活期银行存款利息4,781.25元,结算备付金利息138.54元及存出保证金利息15.21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;结算备付金利息及存出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。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赎回款为160,572.80元,该款项已分别于2021年7月21日和7月22日支付。

(2)本基金最后运作日应付赎回费为143.05元,该款项已分别于2021年7月21日和7月22日支付。

(3)本基金最后运作日应付管理人报酬为17,055.06元,该款项已于2021年7月21日支付。

(4)本基金最后运作日应付托管费为2,842.48元,该款项已于2021年7月21日支付。

(5)本基金最后运作日应付销售服务费为82.56元,该款项已于2021年7月21日支付。

(6)本基金最后运作日其他负债43,726.41元,该款项为预提2021年报社信息披露费43,726.41元,该款项已于2021年7月21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7月20日基金净资产	8,122,969.89
加:清算期间 0021-7-21至2021-7-29 利息收入	739.88
利息收入-银行存款利息收入(注1)	668.78
利息收入-结算备付金利息收入(注1)	65.97
利息收入-存出保证金利息收入(注1)	5.13
加:其他收入-赎回费归资产(注2)	244.56
减:清算期间 0021-7-21至2021-7-29 费用	65.00
其他费用(注3)	65.00
减:基金净赎回金额(于2021年7月21日确认的投资者申购赎回申请)	497,098.21
二、2021年7月29日基金净资产	7,626,791.12

注:1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2021年7月21日至2021年7月29日清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息;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、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;

3、其他费用系自2021年7月21日至2021年7月29日清算期间托管账户扣缴的银行划汇费,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。

资产处置及负债清偿后,于2021年7月29日本基金剩余财产为人民币7,626,791.12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。

2021年7月30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)《招商盛达灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》

(2)《关于招商盛达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。

招商盛达灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组  
2021年7月29日