

# 招商稳锦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：恒丰银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年5月23日

清算报告公告日：2024年6月5日

## 一、重要提示

招商稳锦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 2021 年 9 月 7 日《关于准予招商稳锦混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2021〕2953 号）注册公开募集，自 2022 年 6 月 2 日起基金合同生效，基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

根据《招商稳锦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”中“二、《基金合同》的终止事由”中“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：……3、《基金合同》约定的其他情形”；根据《基金合同》第五部分“基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续五十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2024 年 5 月 16 日日终，本基金连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，已触发基金合同终止情形。本基金根据基金合同约定进入清算程序，无需召开基金份额持有人大会进行表决。基金管理人于 2024 年 5 月 17 日发布了《招商基金管理有限公司关于招商稳锦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 2024 年 5 月 17 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（深圳）律师事务所于 2024 年 5 月 17 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（深圳）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	招商稳锦混合型证券投资基金
基金简称	招商稳锦混合
基金主代码	013701
交易代码	013701
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 2 日
最后运作日（2024-5-16） 基金份额总额	2,571,281.37 份

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金以获取绝对收益为投资目的，采取稳健的投资策略，在控制投资风险的基础之上确定大类资产配置比例，力争使投资者获得较为合理的绝对收益。本基金的投资策略由大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、参与融资业务的投资策略、存托凭证投资策略等部分组成。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*15% +中债综合（全价）指数收益率*80% + 恒生综合指数收益率（经汇率调整后）*5%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。	
基金管理人	招商基金管理有限公司	
基金托管人	恒丰银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	招商稳锦混合 A	招商稳锦混合 C
下属分级基金的交易代码	013701	013702

### 三、 基金运作情况

本基金经中国证监会 2021 年 9 月 7 日证监许可（2021）2953 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 2022 年 3 月 4 日至 2022 年 5 月 31 日向社会公开募集。本基金基金合同于 2022 年 6 月 2 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 237,352,790.43 份。自基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

根据《招商稳锦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”中“二、《基金合同》的终止事由”中“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：……3、《基金合同》约定的其他情形”；根据《基金合同》第五部分“基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续五十个工作日

出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2024 年 5 月 16 日日终，本基金连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，已触发基金合同终止情形。本基金根据基金合同约定进入清算程序，无需召开基金份额持有人大会进行表决。

基金管理人于 2024 年 5 月 17 日发布了《招商基金管理有限公司关于招商稳锦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 2024 年 5 月 17 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：招商稳锦混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 5 月 16 日

单位：人民币元

项目	最后运作日(2024 年 5 月 16 日)
<b>资产：</b>	
银行存款	4,106,385.01
结算备付金	11,650.96
存出保证金	56,763.58
应收清算款	909,874.42
应收申购款	16,209.74
资产总计	5,100,883.71
<b>负债：</b>	
应付赎回款	2,220,662.29
应付管理人报酬	2,491.45
应付托管费	622.84
应付销售服务费	786.71
应付交易费用	12,470.74
其他负债	51,386.60
负债合计	2,288,420.63
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	2,571,281.37
未分配利润	241,181.71
所有者权益合计	2,812,463.08
负债和所有者权益总计	5,100,883.71

注：1、基金最后运作日 2024 年 5 月 16 日，招商稳锦混合型证券投资基金 A 类份额的单位净值为 1.0984 元，份额为 1,155,783.23 份，资产净值为 1,269,558.97 元；C 类份额单位净值为 1.0900 元，份额为 1,415,498.14 份，资产净值为 1,542,904.11 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。

## 五、 清算情况

自 2024 年 5 月 17 日至 2024 年 5 月 23 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《招商稳锦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 4,106,385.01 元，其中 4,091,926.32 元为存储于基金托管人恒丰银行股份有限公司的活期银行存款，14,458.69 元为应计活期银行存款利息。

(2) 本基金最后运作日结算备付金 11,650.96 元，其中 11,602.11 元是由中国证券登记结算公司收取并保管的结算备付金，48.85 元为应计结算备付金利息。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 6 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”。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返还的结算备付金。

(3) 本基金最后运作日存出保证金 56,763.58 元，其中 56,616.31 元是由中国证券登记结算公司收取并保管的结算保证金，147.27 元为应计结算保证金利息。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尚未返还的存出保证金。

(4) 本基金最后运作日应收清算款 909,874.42 元，已于 2024 年 5 月 17 日收到该款项。

(5) 本基金最后运作日应收申购款 16,209.74 元,已于 2024 年 5 月 17 日收到该款项。

### 3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款 2,220,662.29 元,该款项已于 2024 年 5 月 20 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬 2,491.45 元,该款项已于 2024 年 5 月 21 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费 622.84 元,该款项已于 2024 年 5 月 21 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费 786.71 元,该款项已于 2024 年 5 月 21 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付交易费用 12,470.74 元,其中应付佣金 12,313.24 元、应付中债登结算服务费 150.00 元、应付银行间交易手续费 7.50 元。应付佣金与应付中债登结算服务费已于 2024 年 5 月 21 日支付,银行间交易手续费于 2024 年 5 月 23 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债 51,386.60 元,该款项为应付赎回费 268.41 元、预提 2024 年报社信息披露费 44,918.19 元、账户维护费 6,200.00 元,分别于 2024 年 5 月 17 日、2024 年 5 月 22 日、2024 年 5 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 2024 年 5 月 16 日基金净资产	2,812,463.08
<b>加:</b> 清算期间 (2024-5-17 至 2024-5-23) 收入	484.59
其中: 利息收入-银行存款利息收入 (注 1)	390.68
利息收入-备付金利息收入 (注 1)	3.64
利息收入-保证金利息收入 (注 1)	17.85
其他业务收入-赎回费归资产收入 (注 2)	72.42
<b>减:</b> 清算期间 (2024-5-17 至 2024-5-23) 费用	273.60
其中: 投资收益 (注 3)	273.60
<b>减:</b> 基金净赎回金额 (于 2024 年 5 月 17 日确认的投资者申购赎回申请)	342,260.13
二、2024 年 5 月 23 日基金净资产	2,470,413.94

注: 1.利息收入系以当前适用的利率计提的自 2024 年 5 月 17 日至 2024 年 5 月 23 日止清算期间的利息, 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.其他业务收入为赎回费归基金资产的收入, 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.投资收益为 5 月 16 日卖券产生的股息红利税, A/C 类份额之间的收益分配按照各级别净值占比进行分摊;

资产处置及负债清偿后,于 2024 年 5 月 23 日本基金剩余财产为人民币 2,470,413.94 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,按基金份额持有人持有该

级别份额的比例进行分配。

2024年5月24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）《招商稳锦混合型证券投资基金清算审计报告》
- （2）《关于招商稳锦混合型证券投资基金清算事宜的法律意见书》

### 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。

招商稳锦混合型证券投资基金财产清算小组

2024年5月23日