

招商丰嘉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:中国建设银行股份有限公司
清算报告出具日:2018年5月25日
重要提示
招商丰嘉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3月7日《关于准予招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]453号)注册公开募集,自2016年8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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。
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:(二)基金份额持有人大会决定终止”。根据《招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金合同》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,经履行适当程序后,《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《关于终止招商丰嘉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2018年4月11日刊登了《关于以通讯方式召开招商丰嘉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2018年4月12日、2018年4月13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4月14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4月15日刊登了《关于招商丰嘉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2018年5月16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 招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金
招商丰嘉混合
基金管理人 招商基金管理有限公司
基金托管人 中国建设银行股份有限公司
基金代码 002538
交易代码 002538
基金运作方式 契约型开放式
基金合同生效日 2016年8月11日
最后运作日(2018-5-15)基金份额总额 122,122.70份
投资目标 本基金通过将在基金资产在不同投资类别之间灵活配置,在控制下行风险的前提下为投资人获取稳健回报。

Table with 2 columns: 资产, 负债. 资产: 银行存款 110,009.54, 债权类资产 46,727.28, 权益类资产 313.57, 资产总计 157,050.39. 负债: 应付托管费 36.68, 应付销售服务费 15.30, 应付其他应付款 7.88, 负债合计 59.86. 净资产/所有者权益合计 157,050.39.

三、基金运作情况
本基金经中国证监会2016年3月7日证监许可[2016]453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8月9日向社会公开募集。本基金基金合同于2016年8月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总数为200,017,795.23份。自2016年8月11日至2018年5月15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》、《招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关规定,基金份额持有人大会于2018年5月14日表决通过,决定终止基金合同,并对本基金进行变更及清算程序。基金管理人已就该事项于2018年5月15日刊登了《关于招商丰嘉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》。本基金已于2018年5月16日起进入清算程序。
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:招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2018年5月15日

Table with 2 columns: 资产, 负债. 资产: 银行存款 110,009.54, 债权类资产 46,727.28, 权益类资产 313.57, 资产总计 157,050.39. 负债: 应付托管费 36.68, 应付销售服务费 15.30, 应付其他应付款 7.88, 负债合计 59.86. 净资产/所有者权益合计 157,050.39.

注:1.基金最后运作日2018年5月15日,招商丰嘉混合A资产净值为1,322元,份额为42,058.64份,资产净值为55,596.46元;招商丰嘉混合C资产净值为1,266元,份额为80,064.06份,资产净值为101,394.07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分类。
五、清算情况
自2018年5月16日至2018年5月25日止为清算期间,基金财产清算小组对基金资产、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《招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金》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。
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110,009.54元,是存储于基金托管人中国建设银行的活期银行存款。
(2)本基金最后运作日存出保证金46,727.28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,但不低于初始结算保证金基数”。基金管理人已于2018年5月16日向基金托管人出具了《招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金申请调回结算保证金申请书》,申请调回结算保证金,预期于6月4日,此笔款项会返还托管账户。
(3)本基金最后运作日应收利息313.57元,其中包括活期银行存款利息199.85元、上海结算担保金利息80.61元及深圳结算担保金利息33.11元。应收活期银行存款利息由托管银行于每季度3月6日、9月12日、12月21日(节假日顺延)结转入账,或在账户注销时一次性结清;结算担保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日、9月12日、12月21日(节假日顺延)结转入账。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36.68元,该款项已于2018年5月16日支付。
(2)本基金最后运作日应付托管费为15.30元,该款项已于2018年5月16日支付。
(3)本基金最后运作日应付销售服务费为7.88元,该款项已于2018年5月16日支付。
4. 清算期间的剩余资产分配情况

Table with 2 columns: 项目, 金额. 项目: 一、最后运作日2018年5月15日基金净资产, 156,990.53. 二、清算费用, 59.86. 三、清算费用, 59.86. 四、清算费用, 59.86. 五、清算费用, 59.86. 六、清算费用, 59.86. 七、清算费用, 59.86. 八、清算费用, 59.86. 九、清算费用, 59.86. 十、清算费用, 59.86.

注:1.利息收入系以当前适用的利率估计计提的自2018年5月16日至2018年5月25日止清算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;
3.其他费用系于2018年5月16日至2018年5月25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摊按照各级别净值占比进行分摊。
资产处置及负债清偿后,于2018年5月25日本基金剩余财产为人民币157,018.63元,包括招商丰嘉混合A人民币55,606.45元和招商丰嘉混合C人民币101,412.18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。
2018年5月26日至清算划出日前一日,发行人在银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有。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(该金额可能与实际利息金额存在略微差异),供清算期间使用。基金管理人垫付的资金与实际利息金额到账日起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)《招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
(2)《关于招商丰嘉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、基金托管人、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
3. 查阅方式
投资者可在营业时间内免费查阅。
招商丰嘉灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组
2018年5月25日

证券代码:600157 证券简称:永泰能源
债券代码:122267、136351、136439、136520
债券简称:13永泰债、16永泰01、16永泰02、16永泰03
公告编号:临2018-106

永泰能源股份有限公司第十届监事会第十一次会议决议公告

本公司监事会及全体监事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
永泰能源股份有限公司(以下简称“本公司”)第十届监事会第十一次会议通知于2018年7月1日以书面形式和电子邮件发出,会议于

2018年7月4日以通讯方式召开,参与表决监事3人,实参与表决监事3人,符合《公司法》、《公司章程》的有关规定。经会议表决,一致审议通过了《关于公司为永泰集团有限公司提供担保的议案》(表决结果:同意3票,反对0票,弃权0票)。
监事会认为:永泰集团有限公司(以下简称“永泰集团”)本次借款主

要用于向本公司提供流动性支持,并由永泰集团提供反担保。本次关联担保遵循了公开、公平、公正原则,关联董事在表决时进行了回避,相关审议和表决程序符合法律法规的规定,不存在损害上市公司利益及中小股东利益情况,监事会一致同意本次关联担保事项。本议案由控股股东永泰集团以增加临时提案形式提出,将提交公司2018年度第五次临时股

东大会审议。
永泰能源股份有限公司监事会
二〇一八年七月五日

(上接 D2 版)
(3)最近两年及一期母公司现金流量表
单位:元

Table with 4 columns: 项目, 2018年1-3月, 2017年度, 2016年度. 项目: 一、经营活动产生的现金流量: 销售商品、提供劳务收到的现金 73,188,545.81, 232,357,383.58, 300,410,361.28. 二、投资活动产生的现金流量: 收回投资收到的现金 2,130,000,000.00, 4,288,000,000.00. 三、筹资活动产生的现金流量: 吸收投资收到的现金 4,879,929,996.44, 250,000,000.00.

注:上述各指标的具体计算公式如下(其中2018年1-3月指标未年化):

全部债务=长期债务+短期债务
短期债务=短期借款+应付票据+一年内到期的非流动负债
长期债务=长期借款+长期应付款(有息)+应付债券
流动比率=流动资产/流动负债
速动比率=(流动资产-存货)/流动负债
资产负债率=负债总额/资产总额
全部债务资本比率=全部债务/(长期债务+短期债务+所有者权益)
每股净资产=期末归属于母公司所有者权益/期末普通股股份总数
营业毛利率=(营业收入-营业成本)/营业收入
总资产报酬率=(利润总额+计入财务费用的利息支出)/平均资产总额
EBITDA=利润总额+计入财务费用的利息支出+折旧+摊销
EBITDA全部债务比=EBITDA/全部债务
EBITDA利息倍数=EBITDA/(资本化利息+计入财务费用的利息支出)
利息保障倍数=(利润总额+利息支出)/利息支出
应收账款周转率=营业收入/应收账款平均余额
存货周转率=营业成本/存货平均余额
每股经营活动的现金流量=经营活动产生的现金流量净额/期末普通股股份总数
每股净现金流量=现金及现金等价物净增加额/期末普通股股份总数
(四)管理层简评财务分析
公司的管理层结合公司合并报表口径的最近两年及一期的财务报表,对资产负债结构、现金流量、偿债能力、盈利能力、未来业务目标以及盈利能力的可持续性进行了如下分析:
1. 资产结构分析

Table with 6 columns: 项目, 2018年3月31日, 2017年12月31日, 2016年12月31日. 项目: 流动资产: 货币资金 894,318.69, 8.34, 727,096.81, 6.78, 719,431.56, 7.33. 非流动资产: 其他流动资产 57,145.15, 0.53, 76,707.89, 0.72, 52,060.85, 0.53. 流动资产合计 1,902,436.60, 17.74, 2,000,462.51, 18.67, 1,515,397.83, 15.45.

最近两年及一期末,公司资产总额分别为9,811,251.67万元、10,717,283.00万元和10,722,620.85万元,2018年3月末的总资产较2016年末增长9.20%。

从资产结构来看,公司非流动资产占比在最近两年及一期期末总体看相对稳定,最近一期末公司的非流动资产占总资产比重为82.26%。公司流动资产的主要科目为货币资金、应收票据、应收账款、预付款项和其他应收款,非流动资产的主要科目为无形资产、固定资产、商誉、在建工程和长期股权投资。
2. 负债结构分析
报告期内,公司的负债构成情况如下表所示:

Table with 6 columns: 负债, 2018年3月31日, 2017年12月31日, 2016年12月31日. 负债: 短期借款 1,370,282.43, 17.52, 1,319,338.06, 16.83, 1,206,908.96, 17.50. 应付票据 213,445.90, 2.73, 184,897.10, 2.36, 32,053.00, 0.46. 应付账款 255,526.15, 3.27, 231,355.30, 2.95, 222,377.44, 3.22.

最近两年及一期,发行人的流动比率和速动比率有所波动,主要是发行人正处于行业转型和规模扩张时期,为整合煤炭和电力资源所需短期内筹措的资金较多,而收购的相关资产主要表现为无形资产、固定资产等长期资产较多。与此同时,发行人所属部分电力项目产能未释放,需要持续对在建工程进行投入,也对经营业绩和短期偿债能力有所影响。最近两年及一期,发行人的利息保障倍数呈波动态势。2017年,利息保障倍数下降主要系煤炭采购价格上涨对电力板块营业利润产生一定负面影响,以及公司债务规模有所增加所致。2018年1-3月,利息保障倍数的增长系发行人盈利改善所致。总体而言,公司的息税前利润完全可覆盖公司的利息支出,利息保障倍数大于1。
(2) 长期偿债能力
最近两年及一期末,公司的资产负债率分别为70.31%、73.14%和72.95%,报告期内发行人资产负债率保持稳定但绝对值仍较高,主要是因为公司通过部分金融融资方式进行资产收购及在建项目投资所致。
5. 盈利能力分析
公司目前已初步实现向综合能源企业的战略转型,特别是自2015年5月收购了华能电力股份公司以来,公司主业开始全面涉足电力行业,煤炭、电力两大主要主营业务板块的均衡发展,石化贸易业务也在2016年开始实现收入,使得公司未来抗风险能力得到增强。
最近两年及一期,公司主要盈利指标如下:

产生的现金流量净额较高主要是当年实施非公开发行股票筹资484,000万元所致。

Table with 4 columns: 项目, 2018年3月末/2018年1-3月, 2017年末/2017年度, 2016年末/2016年度. 项目: 流动比率 0.49, 0.51, 0.44. 速动比率 0.47, 0.50, 0.43. 资产负债率(%) 72.95, 73.14, 70.31. 利息保障倍数 1.58, 1.22, 1.31.

Table with 4 columns: 指标名称, 2018年1-3月, 2017年度, 2016年度. 指标名称: 净利润(万元) 52,957.38, 86,711.57, 76,535.47. 归属于母公司所有者的净利润(万元) 51,052.95, 60,234.59, 66,903.67. 营业毛利率(%) 24.87, 28.03, 32.62. 总资产报酬率(%) 1.52, 4.11, 4.26.

6. 未来业务发展目标及盈利能力的可持续性
(1) 未来业务目标
未来公司将紧紧围绕优质综合能源供应商发展战略,坚持“稳中求进、稳中有为”的发展原则,以经济效益为中心,紧紧抓住电力、煤炭、石化三大核心产业,深挖潜力,增加盈利,巩固公司稳步发展的管理基础,进一步提升公司整体经营业绩,促进公司持续健康发展。
公司将在稳定现有煤炭产业1,000万吨/年原煤产量的基础上,加快电力、石化和新能源产业发展,尽快实现1,000万千瓦以上运营电力装机容量,1,000万吨/年油品加工能力,巩固与夯实煤电一体化战略发展基础,形成综合性、跨区域能源产业集团。同时,公司将紧跟电力体制改革和国企改革步伐,力争在核电高科技和清洁能源领域、售电领域和混合所有制方面取得进一步突破,促进公司能源产业结构的优化与转型升级。
公司将通过广东惠州大亚湾码头和江苏张家港码头项目,大力拓展所属石化、煤炭相关的大宗商品物流业务,延伸产业链,增加附加值,提升公司综合竞争力。公司将逐步实现2,000万吨/年油品货吞吐能力、1,000万吨/年油品动态仓储能力,成为全国最大规模的民营油品仓储及保税油库之一,同时还将形成1,000万吨/年的煤炭货吞吐能力,实现公司能源与物流业务的协调发展。
(2) 盈利能力的可持续性分析
结合公司报告期内资产结构、财务状况以及各项业务的开展情况,未来公司的盈利能力具有可持续性,并将得到进一步增强。公司将充分发挥所拥有的煤炭、石化等产业资源优势,经营管理优势、人力资源优势,致力于优质综合能源供应商发展战略,不断提升公司经营业绩和核心竞争力,促进公司可持续发展。未来随着宏观经济的改善,在建项目投资投产,公司战略转型完成以及各产业板块协同的协同优势,公司盈利能力将得到较大幅度提升。
四、本次债券发行的募集资金用途
本次发行公司债券的募集资金扣除发行费用后拟用于偿还存续的公司债券及适用的法律法规允许的其他用途。
本次债券发行后将进一步优化公司的财务结构,增强公司短期偿债能力,并降低公司长期融资成本,同时为公司业务发展提供稳定的中长期资金支持,符合公司和全体股东的利益,使公司更有能力面对市场的各种挑战,保持主营业务持续稳定增长,并进一步提高公司盈利能力和核心竞争力。
五、其他重要事项
(一) 对外担保情况
截至2018年3月31日,本公司对合并报表范围内的子公司提供担保金额1,723,394.78万元,对合并报表范围外的其他公司提供担保金额72,500万元。
(二) 重大未决诉讼及仲裁情况
截至2018年3月31日,公司不存在应披露的对公司财务状况、经营成果、业务活动、未来前景等可能产生重大影响的未决诉讼或仲裁事项。特此公告。

单位:万元

Table with 4 columns: 项目, 2018年1-3月, 2017年度, 2016年度. 项目: 经营活动产生的现金流量净额 182,807.09, 458,245.90, 406,464.53. 投资活动产生的现金流量净额 9,657.40, -800,748.43, -1,305,232.18. 筹资活动产生的现金流量净额 -100,318.53, 396,464.78, 922,176.68.

(1) 经营活动产生的现金流量
最近两年及一期,公司经营产生的现金流量净额分别为406,464.53万元、458,245.90万元和182,807.09万元。2017年度发行人经营活动产生的现金流量净额比2016年度增长12.74%,主要是销售商品、提供劳务收到的现金同比增加所致。
(2) 投资活动产生的现金流量
最近两年及一期,公司投资活动产生的现金流量净额分别为-1,305,232.18万元、-800,748.43万元和9,657.40万元。最近两年,公司投资活动产生的现金流量净额持续为负,主要原因是:(1)购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金较多。最近两年及一期分别为659,061.84万元、424,748.73万元和128,112.65万元,上述资金主要用于公司煤矿、电厂技改项目支出;(2)投资支付的现金较多,最近两年及一期分别为944,223.14万元、242,189.68万元和8,797.95万元,主要用于子公司相关股权投资。
(3) 筹资活动产生的现金流量
最近两年及一期,公司筹资活动产生的现金流量净额分别为922,176.68万元、396,464.78万元和-100,318.53万元,2016年筹资活动