

天弘普惠养老保本混合型证券投资基金
清算报告

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

一、重要提示

天弘普惠养老保本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(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]729号《关于准予天弘普惠养老保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案,《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月27日正式生效。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

经与保证人重庆三峡担保集团股份有限公司协商一致,本基金第一个保本周期期满后,不再进行第二个保本周期的合作事宜,基金管理人也未能找到其他适合的担保机构,故本基金因未能符合保本基金存续条件,出现《基金合同》终止事由。基金管理人依据《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》和《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")的有关规定,提议终止《基金合同》。本基金基金合同终止及基金财产清算的公告详见2016年11月24日刊登在指定媒体的《天弘基金管理有限公司关于天弘普惠养老保本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》。

本基金从2016年11月29日起进入清算期,由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人平安银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2016年11月29日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金名称:天弘普惠养老保本混合型证券投资基金

(基金简称:天弘普惠养老保本混合。天弘普惠养老保本混合A,基金代码:001292;天弘普惠养老保本混合B,基金代码:001293)

2、基金运作方式:契约型开放式,以定期开放方式运作

3、基金合同生效日:2015年05月27日

4、最后运作日2016年11月28日,基金份额总额:445,449,129.95份,其中A类份额439,059,829.53份,B类份额6,389,300.42份。

5、投资目标:在严格控制风险的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,综合运用投资组合保险策略,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。

6、投资策略:本基金将采用恒定比例组合保本策略(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance),对资产配置建立和运用数量化的分析模型,动态地监控和调整本基金在安全资产与风险资产上的投资比例,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过积极稳健

的选择市场时机和精选个股进行投资，争取为基金资产获取更高的投资回报。具体而言，本基金的投资策略包括大类资产配置策略、安全资产投资策略和风险资产投资策略。

7、业绩比较基准：(一年期银行定期存款利率（税后）+0.50%)×2

8、风险收益特征：本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

9、基金管理人：天弘基金管理有限公司

10、基金托管人：平安银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

天弘普惠养老保本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(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]729号《关于准予天弘普惠养老保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期，首次募集期间为2015年5月19日至2015年5月25日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集445,434,592.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第570号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为445,449,129.95份基金份额，其中认购资金利息折合14,537.95份基金份额。

经与保证人重庆三峡担保集团股份有限公司协商一致，本基金第一个保本周期期满后，不再进行第二个保本周期的合作事宜，基金管理人也未能找到其他适合的担保机构，故本基金因未能符合保本基金存续条件，出现《基金合同》终止事由。基金管理人依据《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》和《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金从2016年11月29日起进入清算期，由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人平安银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所于2016年11月29日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

四、财务会计报告

资产负债表(已经审计)

会计主体：天弘普惠养老保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年11月28日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2016 年 11 月 28 日
资产：	
银行存款	487,990,229.20
结算备付金	47,511.58
存出保证金	30,735.72
交易性金融资产	162,989.28
其中：股票投资	—
基金投资	—
债券投资	162,989.28
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	—
应收利息	63,144.65
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	488,294,610.43
负债和所有者权益	最后运作日2016年11月28日
负债：	
短期借款	—
交易性金融负债	—
衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	—
应付证券清算款	—
应付赎回款	—

应付管理人报酬	261,939.97
应付托管费	37,420.00
应付销售服务费	38,223.36
应付交易费用	12,376.40
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	345,771.38
负债合计	695,731.11
所有者权益：	
实收基金	445,449,129.95
未分配利润	42,149,749.37
所有者权益合计	487,598,879.32
负债和所有者权益总计	488,294,610.43

注： 1、报告截止日 2016 年 11 月 28 日(基金最后运作日)，A 类基金份额净值 1.0947 元，B 类基金份额净值 1.0922 元，基金份额总额 445,449,129.95 份，其中 A 类基金份额 439,059,829.53 份，B 类基金份额 6,389,300.42 份。

2、本财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师薛竞、周祎签字出具了普华永道中天特审字（2016）第 1999 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

1、清算费用

按照《天弘普惠养老保本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财产中支付。

2、本基金第一个保本周期的到期日（即最后开放日）为 2016 年 11 月 28 日，基金份额持有人可在此日将第一个保本周期内持有到期的基金份额进行赎回（含转换转出），在 2016 年 11 月 29 日对其所申请的赎回份额进行确认并支付，具体支付金额如下：

单位：人民币元

项目	金额	时间备注
----	----	------

一、最后运作日2016年11月28日基金净资产	487,598,879.32	
减：基金净赎回金额	486,480,048.49	2016年11月29日支付
二、2016年11月29日基金净资产	1,118,868.13	其中当日计提银行存款利息30.20元，计提备付金利息2.14元，计提当日保证金利息1.39元，当日计提未变现的16凤凰EB(代码：132007)利息3.57元，即应收利息科目当日产生计提金额37.30元。

3、停止运作后的清算损益情况说明

截至停止运作日（2016年11月29日）止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币1,510,180.71元，备付金47,511.58元，保证金30,735.72元，应收利息63,181.95元，管理费、托管费、销售服务费、交易费用、预提费用（上清中债账户维护费、信息披露费用、审计费用）等负债695,731.11元，基金净资产1,118,868.13元。其中备付金47,511.58元，保证金30,735.72元于2016年1月份变现；应收利息将于12月末结息变现，此后新产生的利息将在销户结息时变现。

考虑到本基金清算的实际情况，在清算期间产生的银行间账户维护费、事务所律师费等其他清算费用，均由基金管理人承担，具体金额以缴费通知为准。

本基金的银行存款应收利息均为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由管理人承担。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人有权于收到基金托管人通知后当日将款项补足。

4、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，报中国证监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) 天弘普惠养老保本混合型证券投资基金 2016 年 11 月 28 日资产负债表及审计报告
- (2) 《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

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内至基金管理人的办公场所免费查阅。

天弘普惠养老保本混合型证券投资基金财产清算小组
2016 年 12 月 23 日