

天弘鑫安宝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：兴业银行股份有限公司

一、重要提示

天弘鑫安宝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]1102号《关于准予天弘鑫安宝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《天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")负责公开募集。经向中国证监会备案,本基金《基金合同》于2015年10月23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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《关于避险策略基金的指导意见》(以下简称"《指导意见》")的规定,对于《指导意见》施行前已经成立的保本基金,如不符合《指导意见》的有关规定,应在保本周期到期后对法律文件予以修订并变更注册为避险策略基金,未按照《指导意见》的要求进行修订的,应当转为其他类型的基金或予以清算。本基金第一个保本周期到期时,结合市场情况,本基金无法根据《指导意见》关于避险策略基金的运作机制进行调整,故根据本基金《基金合同》对于本基金保本周期到期后基金存续形式的约定,如本基金不再满足保本基金存续的要求,本基金将根据《基金合同》的规定终止并进入清算程序。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《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2017年4月18日刊登在指定媒介的《天弘基金管理有限公司关于天弘鑫安宝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2017年4月25日起进入清算期,由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所于2017年4月25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：天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金
(基金简称：天弘鑫安宝保本，基金代码：001486)
- 2、基金运作方式：契约型开放式，以定期开放的方式运作
- 3、基金合同生效日：2015年10月23日
- 4、最后运作日2017年4月24日，基金份额总额：739,354,674.96份。
- 5、投资目标：综合运用投资组合保险策略，严格控制风险，在为投资人提供投资金额安全保证的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
- 6、投资策略：本基金将主要采用恒定比例组合保本策略(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance)，以数量化的分析模型为基础，通过动态地监控和调整基金在安全资产与风险资

产上的投资比例，确保基金投资组合的风险暴露水平不超过基金可承担的损失限额（又称安全垫），以实现确保保本周期到期时本金安全的目标。同时，本基金通过积极稳健的股票投资策略，为基金实现资本增值。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： $(\text{一年期银行定期存款利率（税后）} + 0.50\%) \times 2$

8、风险收益特征：本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。

9、基金管理人：天弘基金管理有限公司

10、基金托管人：兴业银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

天弘鑫安宝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]1102号《关于准予天弘鑫安宝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《天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）负责公开募集。本基金以定期开放方式运作，存续期限不定，首次募集期间为自2015年10月15日至2015年10月21日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集739,321,900.00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988号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金《基金合同》于2015年10月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为739,354,674.96份基金份额，其中利息折份额为32,774.96份，归入基金资产。

根据《关于避险策略基金的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）的规定，对于《指导意见》施行前已经成立的保本基金，如不符合《指导意见》的有关规定，应在保本周期到期后对法律文件予以修订并变更注册为避险策略基金，未按照《指导意见》的要求进行修订的，应当转为其他类型的基金或予以清算。本基金第一个保本周期到期时，结合市场情况，本基金无法根据《指导意见》关于避险策略基金的运作机制进行调整，故根据本基金《基金合同》对于本基金保本周期到期后基金存续形式的约定，如本基金不再满足保本基金存续的要求，本基金将根据《基金合同》的规定终止并进入清算程序。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《基金合同》的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金从2017年4月25日起进入清算期，由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所于2017年4月25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：天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017年4月24日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2017 年 4 月 24 日
资产：	
银行存款	777,566,082.76
结算备付金	33,047.52
存出保证金	45,646.86
交易性金融资产	—
其中：股票投资	—
基金投资	—
债券投资	—
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	170,903.37
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	777,815,680.51
负债和所有者权益	最后运作日2017年4月24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	255,208.96
应付托管费	51,041.81
应付销售服务费	102,083.57
应付交易费用	58,998.99
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	317,373.60
负债合计	784,706.93
所有者权益：	
实收基金	739,354,674.96
未分配利润	37,676,298.62
所有者权益合计	777,030,973.58
负债和所有者权益总计	777,815,680.51

注： 1、报告截止日 2017 年 4 月 24 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0510 元，基金份额总额 739,354,674.96 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（2017）第 1897 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《天弘鑫安宝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 2017 年 4 月 24 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 2017 年 4 月 25 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2017年4月24日基金净资产	777,030,973.58	
减：基金净赎回金额	756,342,410.90	2017年4月25日支付
二、2017年4月25日基金净资产	20,689,422.39	其中当日计提银行存款利息955.07元，计提备付金利息1.49元，计提保证金利息2.05元，即应收利息科目当日产生计提金额958.61元；当日预提银行间账户维护费98.90元。

3、停止运作后的清算损益情况说明

截至停止运作日（2017 年 4 月 25 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 21,223,671.86 元，备付金 33,047.52 元，保证金 45,646.86 元，应收利息 171,861.98 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 784,805.83 元，基金净资产 20,689,422.39 元。其中备付金 33,047.52 元，保证金 45,646.86 于 2017 年 5 月份变现；应收利息将于 6 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、律师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) 天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金 2017 年 4 月 24 日资产负债表及审计报告
- (2) 通力律师事务所关于《天弘鑫安宝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。

天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金财产清算小组

2017 年 4 月 28 日