

天弘聚利灵活配置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：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇一八年一月十二日

清算报告公告日：二〇一八年三月二十日

## 一、重要提示

天弘聚利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(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]1450号《关于准予天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,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《天弘聚利灵活配置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,《天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月16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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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2018年1月12日刊登在指定媒介的《关于天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》。

本基金从2018年1月12日起进入清算期,由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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2018年1月12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:天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金  
(基金简称:天弘聚利混合,基金代码:001647)
- 2、基金运作方式:契约型开放式
- 3、基金合同生效日:2016年12月16日
- 4、最后运作日2018年1月11日,基金份额总额:174,232.43份。
- 5、投资目标:本基金力求通过资产配置和灵活运用多种投资策略,把握市场机会,在严格控制风险的前提下获取高于业绩比较基准的投资收益。
- 6、投资策略:本基金采取灵活资产配置,主动投资管理的投资模式。在投资策略上,本基金从两个层次进行,首先是进行大类资产配置,在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险,把握市场波动中产生的投资机会;其次是采取自下而上的分析方法,从定量和定性两个方面,通过深入的基本面研究分析,精选具有良好投资价值的个股和个券,构建股票组合和债券组合。
- 7、业绩比较基准:50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率

8、风险收益特征：本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

9、基金管理人：天弘基金管理有限公司

10、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

### 三、基金运作情况概述

天弘聚利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(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]1450号《关于准予天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，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《天弘聚利灵活配置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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集510,943,879.17元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2016)第1632号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为510,964,089.86份基金份额。

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2018年1月12日起进入清算期，由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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2018年1月12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：天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年1月11日

单位：人民币元

| 资产    | 最后运作日 2018年1月11日 |
|-------|------------------|
| 资产：   |                  |
| 银行存款  | 810,236.41       |
| 结算备付金 | 43,186.95        |

|                 |                        |
|-----------------|------------------------|
| 存出保证金           | 16,287.34              |
| 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            | 1,732.96               |
| 应收股利            | —                      |
| 应收申购款           | —                      |
| 递延所得税资产         | —                      |
| 其他资产            | —                      |
| 资产总计            | 871,443.66             |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>最后运作日2018年1月11日</b> |
| <b>负债：</b>      |                        |
| 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           | 334,154.95             |
| 应付管理人报酬         | 3,907.54               |
| 应付托管费           | 1,302.49               |
| 应付销售服务费         | —                      |
| 应付交易费用          | 496.42                 |
| 应交税费            | —                      |
| 应付利息            | —                      |
| 应付利润            | —                      |
| 递延所得税负债         | —                      |

|               |            |
|---------------|------------|
| 其他负债          | 292,497.20 |
| 负债合计          | 632,358.60 |
| <b>所有者权益：</b> |            |
| 实收基金          | 174,232.43 |
| 未分配利润         | 64,852.63  |
| 所有者权益合计       | 239,085.06 |
| 负债和所有者权益总计    | 871,443.66 |

注： 1、报告截止日 2018 年 1 月 11 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.3722 元，基金份额总额 174,232.43 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(2018)第 0261 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《天弘聚利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财产中支付。

2、本基金的最后运作日为 2018 年 1 月 11 日，基金份额持有人可在此日将持有到期的基金份额进行赎回，在 2018 年 1 月 12 日对其所申请的赎回份额进行确认并在 2018 年 1 月 16 日支付，具体金额如下：

单位：人民币元

| 项目                     | 金额         | 时间备注  |
|------------------------|------------|---|
| 一、最后运作日2018年1月11日基金净资产 | 239,085.06 |   |
| 减：基金净赎回金额              | 146,124.90 | 2018年1月16日支付  |
| 二、2018年1月12日基金净资产      | 92,959.45  | 其中当日计提银行存款利息11.62元，计提备付金利息1.94元，计提保证金利息0.73元，支付汇划手续费15.00元。 |

### 3、停止运作后的清算损益情况说明

截至停止运作日（2018年1月11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 810,236.41 元，结算备付金 43,186.95 元，存出保证金 16,287.34 元，应收利息 1,732.96 元，应付赎回款、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 632,358.60 元，基金净资产 239,085.06 元。其中应收利息将于 3 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内将款项补足。

#### 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）天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 1 月 11 日资产负债表及审计报告
- （2）通力律师事务所关于《天弘聚利灵活配置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。

天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组  
二〇一八年一月十二日