

泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金

清算报告

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年3月5日

清算报告公告日：2018年4月18日

目录

重要提示.....	3
一、基金概况.....	3
二、基金运作情况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清算情况.....	5
五、备查文件.....	9

重要提示

泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2015]945号予以注册,于2016年6月30日成立并正式运作。

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》和《泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)等有关规定,“自基金合同生效日起,出现如下情形之一的,基金合同应当终止并根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算,而无需召开基金份额持有人大会:1、本基金任一封闭期内连续60个工作日,基金资产净值低于5000万元;2、本基金任一开放期最后一日日终,基金资产净值低于2亿元;3、本基金任一开放期最后一日日终,有效申请确认后基金份额持有人数量少于200人。”本基金最近一个开放期为2017年12月25日至2017年12月29日,截至开放期最后一日日终,泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金的资产净值低于2亿元,触发上述基金合同终止情形,基金合同自动终止且无需召开基金份额持有人大会。

本基金于2017年12月30日起进入清算期,由基金管理人泰达宏利基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、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。

一、基金概况

基金名称	泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利增利混合
基金主代码	001568
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月30日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
最后运作日	2017年12月29日
最后运作日基金份额总额	81,105,954.26
投资目标	在严格控制风险及保持流动性基础上,力求实现基金财产持续稳定增值的目标。

投资策略	本基金将采取主动的资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：50% * 沪深 300 指数收益率 +50% * 中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

二、基金运作情况

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[2015]945号《关于准予泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金注册的批复》注册，由泰达宏利基金管理有限公司于2016年5月30日至2016年6月27日向社会公开发行募集，基金合同于2016年6月30日正式生效，募集规模为364,476,184.13份基金份额。自2016年6月30日至2017年12月29日期间，本基金按基金合同正常运作。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》和《泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，自基金合同生效日起，出现如下情形之一的，基金合同应当终止并根据基金合同第十九部分的约定进行基金财产清算，而无需召开基金份额持有人大会：1、本基金任一封闭期内连续60个工作日，基金资产净值低于5000万元；2、本基金任一开放期最后一日日终，基金资产净值低于2亿元；3、本基金任一开放期最后一日日终，有效申请确认后基金份额持有人数量少于200人。本基金的最近的一个开放期为2017年12月25日至2017年12月29日，截至开放期最后一日日终泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金的资产净值为78,515,880.60元，低于2亿元。

为更好维护基金份额持有人的利益，按照《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《泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定终止本基金《基金合同》并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。本基金自2017年12月30日起进入清算期。

三、财务会计报告

(一) 基金最后运作日资产负债表 (已经审计)

会计主体: 泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金

报告截止日: 2017 年 12 月 29 日

单位: 人民币元

	最后运作日 2017 年 12 月 29 日
资产:	
银行存款	12,840,061.85
结算备付金	848,261.31
存出保证金	31,962.58
交易性金融资产	75,808,950.21
应收利息	9,746.83
资产总计	89,538,982.78
负债:	
应付赎回款	9,983,308.58
应付管理人报酬	384,236.38
应付托管费	64,039.38
应付交易费用	233,494.57
其他负债	358,023.27
负债合计	11,023,102.18
所有者权益:	
实收基金	81,105,954.26
未分配利润	-2,590,073.66
所有者权益合计	78,515,880.60
负债和所有者权益总计	89,538,982.78

四、清算情况

自 2017 年 12 月 30 日至 2018 年 3 月 5 日止为本次清算期间, 基金财产清算组对本基金的基金财产进行清算, 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:

(一) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，包括支付给会计师事务所、律师事务所的费用，分配基金剩余财产的手续费等，根据基金合同的规定，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

(二) 资产清算情况

截至本次清算期结束日（2018年3月5日），部分资产尚未收回。各项资产清算情况如下：

1□ 本基金最后运作日结算备付金为人民币 848,261.31 元，该款项已于 2018 年 2 月 2 日划入托管账户。

2□ 本基金最后运作日存出保证金为人民币 31,962.58 元，该款项已于 2018 年 1 月 3 日划入托管账户。

3□ 本基金最后运作日应收利息为人民币 9,746.83 元。其中应收活期银行存款利息为人民币 8,427.07 元，应收备付金利息为人民币 308.26 元，应收保证金利息为人民币 11.52 元，应收直销申购款利息为人民币 999.98 元。为加快清算速度，基金管理人将以自有资金垫付至托管账户。

4□ 本基金最后运作日持有的股票资产为人民币 75,808,950.21 元，该金额为停牌股票和流通受限股票的最后运作日估值金额之和。具体情况如下：

(1)

本基金最后运作日（2017年12月29日）持有的全部股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	停牌价格 (人民币 元)	最后运作日估值金额 (人民币元)	估值方法
1	600579	天华院	1,360,000	14.22	19,339,200.00	指数收益法
2	000900	现代投资	800,850	6.25	5,005,312.50	停牌前一日收盘价
3	600200	江苏吴中	393,082	10.73	4,217,769.86	流通受限股票估值方法
4	600416	湘电股份	1,417,004	11.58	16,408,906.32	流通受限股票估值方法
5	600579	天华院	1,360,000	13.59	18,482,400.00	流通受限股票估值方法
6	002298	中电鑫龙	1,014,885	8.47	8,596,075.95	流通受限股票估值方法
7	002303	美盈森	198,728	6.57	1,305,642.96	流通受限股票估值方法
8	002494	华斯股份	309,023	7.94	2,453,642.62	流通受限股票估值方法
合计					75,808,950.21	

注：依据中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引》的通知，本基金于 2017 年 12 月 5 日起开始执行流通受限股票估值方法（详见我司于

2017年12月2日发布的《泰达宏利基金管理有限公司关于调整旗下证券投资基金持有流通受限股票估值方法的公告》)。

(2) 本次清算期间(2017年12月30日至2018年3月5日)停牌股票复牌及处置情况:

(a) 本基金持有的600579天华院(非流通受限部分)已于2018年1月2日复牌,并于清算期间全部卖出,卖出所得金额共计16,880,471.46元。

(b) 截至本次清算期结束日(2018年3月5日),本基金所持流通受限股票均未至解除限售日。

截至本次清算期结束日(2018年3月5日),本基金持有停牌和流通受限股票资产人民币合计56,469,750.21元。根据基金管理人2017年12月30日发布的《关于泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》,从保护基金份额持有人利益的角度出发,本基金优先向除基金管理人以外的其他份额持有人分配剩余资产,剩余不足部分基金管理人以自有资金垫付。待剩余停牌和流通受限股票变现后,若本基金于清算结束日所持有的剩余停牌和流通受限股票恢复流通后的整体变现金额高于该部分股票最后运作日的估值金额,则将差额按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人;若本基金于清算结束日所持有的剩余停牌和流通受限股票恢复流通后的整体变现金额小于该部分股票最后运作日的估值金额,则由基金管理人承担相应损失。

(三) 负债清偿情况

1□ 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币384,236.38元,该款项已于2018年1月4日支付。

2□ 本基金最后运作日应付托管费为人民币64,039.38元,该款项已于2018年1月4日支付。

3□ 本基金最后运作日应付赎回款为人民币9,983,308.58元,该款项已于2018年1月2日支付。

4□ 本基金最后运作日应付交易费用为人民币233,494.57元,包括应付银行间交易费用和应付佣金。本基金最后运作日应付银行间交易费用为人民币3,988.81元,该

款项已于 2018 年 1 月 12 日支付；本基金最后运作日应付佣金为人民币 229,505.76 元，该款项已于 2018 年 3 月 5 日支付。

5□ 本基金最后运作日其他负债为人民币 358,023.27 元，包括应付信息披露费、预提审计费。本基金最后运作日应付信息披露费为人民币 298,353.33 元，该款项已于 2018 年 1 月 30 日支付；本基金最后运作日预提审计费为预提的 2017 年审计费，金额为人民币 59,669.94 元，该款项已于 2018 年 1 月 23 日支付。

(四) 本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2017 年 12 月 30 日至 2018 年 3 月 5 日止清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	11,534.43
2、股票变现损益（注 2）	-2,440,329.58
清算期间收入小计	-2,428,795.15
二、清算期间费用	
清算期间费用小计（注 3）	43,189.49
三、清算期间净收益	-2,471,984.64

表中相关项目具体说明如下：

1□ 利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2017 年 12 月 30 日至 2018 年 3 月 5 日止清算期间的银行存款、备付金及保证金利息。

2□ 股票变现损益为本次清算期间卖出股票金额与其最后运作日估值金额的差额。

3□ 本次清算期间费用为银行汇划费、交易费用等。

(五) 截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2017 年 12 月 29 日基金净资产	78,515,880.60
加：清算期间净收益	-2,471,984.64
减：基金净赎回金额（于 2018 年 1 月 2 日确认的投资者申购、赎回申请）	7,229,658.04
二、2018 年 3 月 5 日基金净资产	68,814,237.92

截至本次清算期结束日 2018 年 3 月 5 日, 本基金剩余财产为人民币 68,814,237.92 元。自本次清算期结束日次日 2018 年 3 月 6 日至本次清算款划出前一日的银行存款产生的利息(包括基金管理人垫付资金本金产生的利息)亦归基金份额持有人所有。

本基金所有剩余财产将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配, 根据基金管理人 2017 年 12 月 30 日发布的《关于泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》, 从保护基金份额持有人利益的角度出发, 本基金优先向除基金管理人以外的其他份额持有人分配剩余资产, 剩余不足部分基金管理人以自有资金垫付。

(六) 基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核, 将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后, 基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分析。

五、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1□ 《泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2□ 《关于泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金清算的法律意见》

(二) 存放地点备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

(三) 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金财产
清算组

2018年3月5日