

泰达宏利启明灵活配置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：北京银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年7月20日

清算报告公告日：2018年8月25日

目录

| | |
|---------------|---|
| 重要提示..... | 3 |
| 一、基金概况..... | 4 |
| 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..... | 8 |

重要提示

泰达宏利启明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【2016】2698号予以注册，于2017年3月1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》等有关规定和《泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定：“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、连续60个工作日，基金资产净值低于5000万元；2、连续60个工作日，有效申请确认后基金份额持有人数量少于200人。”截至2018年6月21日日终，泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金的资产净值已经连续60个工作日低于5000万元，触发上述基金合同终止情形，基金合同应当自动终止且无需召开基金份额持有人大会。

本基金于2018年6月22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、基金托管人北京银行股份有限公司、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 | 泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 泰达宏利启明混合 |
| 基金主代码 | 003918 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年3月1日 |
| 基金管理人 | 泰达宏利基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 北京银行股份有限公司 |
| 最后运作日 | 2018年6月21日 |
| 最后运作日基金份额总额 | 5,019,957.85 |
| 投资目标 | 本基金紧跟新常态下我国经济发展过程中的各类投资机遇，基于大类资产配置策略，力争为投资者创造较高投资收益。 |
| 投资策略 | 1、类别资产配置策略 |

| | |
|--------|--|
| | 2、股票投资策略 3、债券投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、股指期货投资策略 6、权证投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×25%。 |
| 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，其预期风险和预期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

本基金经中国证监会证监许可【2016】2698号《关于准予泰达宏利启明灵活配置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2017年2月16日至2017年2月23日向社会公开发行募集，基金合同于2017年3月1日正式生效，募集规模为600,484,434.16份基金份额。自2017年3月1日至2018年6月21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》等有关规定和《泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定：“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、连续60个工作日，基金资产净值低于5000万元；2、连续60个工作日，有效申请确认后基金份额持有人数量少于200人。”自2018年3月23日起，截至2018年6月21日日终，泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金的资产净值已连续60个工作日低于5000万元。

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《泰达宏利启明灵活配置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2018年6月22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：泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月21日

单位：人民币元

| | 最后运作日 2018年6月21日 |
|------------|---------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 3,994,255.14 |
| 结算备付金 | 654,545.45 |
| 存出保证金 | 134,504.14 |
| 交易性金融资产 | 621,915.41 |
| 其中：股票投资 | 558,854.3 |
| 债券投资 | 63,061.11 |
| 应收利息 | 167.47 |
| 资产总计 | 5,405,387.61 |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | 62.91 |
| 应付管理人报酬 | 1,819.74 |
| 应付托管费 | 303.3 |
| 应付销售服务费 | 1.26 |
| 应付交易费用 | 3,601.76 |
| 其他负债 | 141,370.24 |
| 负债合计 | 147,159.21 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 5,019,957.85 |
| 未分配利润 | 238,270.55 |
| 所有者权益合计 | 5,258,228.40 |
| 负债和所有者权益总计 | 5,405,387.61 |

四、清算情况

自2018年6月22日至2018年7月20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7月20日），部分资产尚未收回，根据基金管理人2018年6月22日发布的《关于泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》，为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金对该部分资产进行垫付。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654,545.45元，该款项已于2018年7月3日由交易所备付金账户划入托管账户。

2□ 本基金最后运作日存出保证金为人民币134,504.14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。

3□ 本基金最后运作日应收利息为人民币167.47元。其中应收债券利息为人民币52.08元，已于2018年6月22日随债券资产卖出款项划入托管账户；应收活期银行存款利息为人民币79.89元，应收备付金利息为人民币29.45元，应收保证金利息为人民币6.05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非停牌股票资产为人民币558,854.30元，该资产已于清算期间全部卖出，变现所得金额共计人民币552,506.25元；本基金最后运作日持有非停牌债券资产为人民币63,061.11元，该资产已于清算期间全部卖出，变现所得（含债券利息收入）金额共计人民币62,981.03元。

（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1,819.74元，该款项已于2018年7月4日支付。

2□ 本基金最后运作日应付托管费为人民币303.30元，该款项已于2018年7月4日支付。

3□ 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币1.26元，该款项已于2018年7月4日支付。

4□ 本基金最后运作日应付赎回款为人民币62.91元，该款项分别于2018年6月22日支付。

5□ 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 3,601.76 元，为应付佣金，该款项已于 2018 年 7 月 4 日支付。

6□ 本基金最后运作日其他负债为人民币 141,370.24 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 113,096.88 元，该款项已于 2018 年 7 月 18 日支付；本基金最后运作日预提审计费为预提的 2018 年审计费，金额为人民币 28,273.36 元，该款项已于 2018 年 7 月 16 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 2018 年 6 月 22 日至 2018 年 7 月 20 日止清 算期间 |
|---------------|--|
| 一、清算期间收益 | |
| 1、利息收入（注 1） | 3,346.81 |
| 2、变现损益（注 2） | -5,875.57 |
| 清算期间收入小计 | -2,528.76 |
| 二、清算期间费用 | |
| 清算期间费用小计（注 3） | 10,749.59 |
| 三、清算期间净收益 | -13,278.35 |

注：

1□ 利息收入系自 2018 年 6 月 22 日至 2018 年 7 月 20 日止清算期间的银行存款、备付金、保证金利息以及债券利息收入。

2□ 变现损益为股票变现损益和债券变现损益之和，股票变现损益为本次清算期间股票资产变现金额，与最后运作日估值金额相减的差额；债券变现损益为本次清算期间债券资产变现金额扣除清算期间债券利息后，与最后运作日估值金额相减的差额。

3□ 清算期间费用为银行汇划费、交易费用、账户维护费、基金卖出缴纳的红利税等。

(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 2018 年 6 月 21 日基金净资产 | 5,258,228.4 |
| 加：清算期间净收益 | -13,278.35 |
| 减：基金净赎回金额 | - |
| 二、2018 年 7 月 20 日基金净资产 | 5,244,950.05 |

截至本次清算期结束日 2018 年 7 月 20 日，本基金剩余财产为人民币 5,244,950.05 元。自本次清算期结束日次日 2018 年 7 月 21 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。

（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配。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1□ 泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告
- 2□ 《关于〈泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金清算报告〉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。

泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算组

2018 年 7 月 20 日