

泰达宏利京天宝货币市场基金

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9月13日

清算报告公告日：2018年10月20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.....	8

重要提示

泰达宏利京天宝货币市场基金(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]3042号予以注册,于2017年3月10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《泰达宏利京天宝货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)根据《基金合同》“第五章 基金备案”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章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。”

本基金于2018年8月23日日终出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,从而触发基金合同终止条款。为维护基金份额持有人利益,基金管理人将终止《基金合同》并按照《基金合同》的约定履行基金财产清算程序,无须召开基金份额持有人大会。

本基金于2018年8月24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	泰达宏利京天宝货币市场基金
基金简称	泰达宏利京天宝
基金主代码	A类: 004414; B类: 004415;
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年3月10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8月23日
最后运作日基金份额总额	12,165,979.66份
投资目标	在严格控制风险，保持流动性的前提下，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的长期风险和收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

二、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2016]3042号《关于准予泰达宏利京天宝货币市场基金注册的批复》予以注册，由泰达宏利基金管理有限公司自2017年3月1日起至2017年3月8日止向社会公开发行募集，基金合同于2017年3月10日正式生效，募集规模为251,846,053.28份基金份额。自2017年3月10日至2018年8月23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《泰达宏利京天宝货币市场基金基金合同》“第五章 基金备案”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章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。”。本基金于2018年8月23日日终资产净值为12,165,979.66元，出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，从而触发基金合同终止条款。

为更好维护基金份额持有人的利益，基金管理人按照《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《泰达宏利京天宝货

币市场基金基金合同》的有关规定终止本基金《基金合同》并进行基金财产清算。
 本基金自 2018 年 8 月 24 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：泰达宏利京天宝货币市场基金

报告截止日：2018 年 8 月 23 日

单位：人民币元

	最后运作日 2018 年 8 月 23 日
资产：	
银行存款	7,798,927.64
交易性金融资产	
其中：股票投资	
债券投资	
买入返售金融资产	4,500,122.25
应收利息	13,121.84
资产总计	12,312,171.73
负债：	
应付管理人报酬	1,877.93
应付托管费	625.94
应付销售服务费	1,919.51
应付交易费用	3,297.10
应付利润	140.69
其他负债	138,330.90
负债合计	146,192.07
所有者权益：	
实收基金	12,165,979.66
未分配利润	
所有者权益合计	12,165,979.66
负债和所有者权益总计	12,312,171.73

四、清算情况

自 2018 年 8 月 24 日至 2018 年 9 月 13 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 9 月 13 日），部分资产尚未收回，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：

本基金最后运作日买入返售金融资产为人民币 4,500,122.25 元，该款项已于 2018 年 8 月 24 日划入托管账户。

1□ 本基金最后运作日应收利息为人民币 13,121.84 元。其中应收买入返售金融资产利息为人民币 198.30 元，已于 2018 年 8 月 24 日划入托管账户；应收活期银行存款利息为人民币 12,923.54 元，该款项将于 2018 年 9 月 21 日划入托管账户。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。

（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 1,877.93 元，该款项已于 2018 年 8 月 24 日支付。

2□ 本基金最后运作日应付托管费为人民币 625.94 元，该款项已于 2018 年 8 月 24 日支付。

3□ 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,919.51 元，该款项已于 2018 年 8 月 24 日支付。

4□ 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 3,297.10 元，其中应付中央国债登记结算有限责任公司交易费用为人民币 270.00 元，已于 2018 年 8 月 30 日支付；应付中国外汇交易中心交易费用为人民币 147.10 元，已于 2018 年 8 月 29 日支付；应付银行间市场清算所股份有限公司交易费用为人民币 2,880.00 元，已于 2018 年 8 月 30 日支付。

5□ 本基金最后运作日应付利润为人民币 140.69 元，已于 2018 年 8 月 24 日结转投资者份额。

6□ 本基金最后运作日其他负债为人民币 138,330.90 元，包括预提信息披露费、预提审计费和预提银行间账务维护费。其中预提信息披露费为人民币 103,561.20 元，该款项已于 2018 年 9 月 12 日支付；预提审计费为预提 2018 年审计费用，金额为人民币 29,589.30 元，该款项已于 2018 年 9 月 10 日支付；预提银行间账户维护费金额为人民币 5,180.40 元，该款项已于 2018 年 8 月 30 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 8 月 24 日至 2018 年 9 月 13 日止清算 期间
一、清算期间收益	
利息收入（注1）	3,700.93
清算期间收入小计（1）	3,700.93
二、清算期间费用	
银行划款手续费	107.38
银行间账户维护费	819.60
清算期间费用小计（2）	926.98
三、清算期间净收益（1）-（2）	2,773.95

注：

1□ 清算期间收入为自 2018 年 8 月 24 日至 2018 年 9 月 13 日止清算期间的银行存款利息收入。

(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 8 月 23 日基金净资产	12,165,979.66
加：清算期间净收益	2,773.95
减：基金净赎回金额（于 2018 年 8 月 24 日确认的投资者净赎回申请）	3,460,844.78
加：2018年8月24日结转的应付利润	140.69
二、2018 年 9 月 13 日基金净资产	8,708,049.52

截至本次清算期结束日 2018 年 9 月 13 日，本基金剩余财产为人民币 8,708,049.52 元。自本次清算期结束日次日 2018 年 9 月 14 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分配。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1□ 泰达宏利京天宝货币市场基金清算审计报告
- 2□ 《关于〈泰达宏利京天宝货币市场基金清算报告〉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。

泰达宏利京天宝货币市场基金财产清算组

2018 年 10 月 20 日

