

# 泰达宏利瑞利分级债券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：2019年3月26日

清算报告公告日：2019年5月30日

## 重要提示

泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金（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【2013】1293号予以注册，于2013年11月14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《泰达宏利瑞利分级债券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，如果连续60个工作日，基金资产规模低于5000万元，本基金合同终止。”截至2019年2月15日日终，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，基金管理人应终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。

本基金于2019年2月16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 泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金

基金简称 泰达宏利瑞利债券 A/泰达宏利瑞利债券 B

基金主代码 000387/000388

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2013年11月14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 2019年2月15日

最后运作日基金份额总额 0.00

## 投资目标

在有效控制风险的基础上，通过积极地主动管理，力求满足瑞利基金 A 份额持有人的稳健收益及流动性需求，同时满足瑞利 B 基金份额持有人资产长期稳定增值的需求。

## 投资策略

在债券类属资产配置的基础上，本基金将针对性地采取目标久期调整策略、收益率曲线策略、信用策略、特殊债券品种投资策略等，在严格控制风险的前提下，实现风险和收益的最佳配比。

业绩比较基准 中债综合指数收益率(全价)

## 风险收益特征

从基金资产整体运作来看，本基金为债券型基金，属于低风险基金产品，其预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基

金，高于货币市场基金。

## 二、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2013】1293号《关于准予泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金募集的批复》注册，由泰达宏利基金管理有限公司于2013年10月24日起至2013年11月11日向社会公开发行募集，基金合同于2013年11月14日正式生效，募集规模为2,033,626,254.60份基金份额。自2013年11月14日至2019年2月15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《泰达宏利瑞利分级债券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，如果连续60个工作日，基金资产规模低于5000万元，本基金合同终止。”至2019年2月15日日终，已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

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《泰达宏利瑞利分级债券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2019年2月16日起进入清算期。

## 三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2019年2月15日

单位：人民币元

最后运作日

2019年2月15日

资产：

银行存款 2,288.63

应收利息 233.32

资产总计 2,521.95

负债：

负债合计 0.00

所有者权益：

实收基金 0.00

未分配利润 2,521.95

所有者权益合计 2,521.95

负债和所有者权益总计 2,521.95

## 四、清算情况

自2019年2月16日至2019年3月26日止为本次清算期间，基金财产清算小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小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小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，清算费用由基金管理人承担。

### （二）资产清算情况

截至本次清算期结束日（2019年3月26日），应收利息清算情况如下：

本基金最后运作日应收利息为人民币 233.32 元。其中应收活期银行存款利息为人民币 46.38 元，应收备付金利息为人民币 186.94 元，已于 2019 年 3 月 21 日划入托管账户。

### （三）负债清偿情况

无。

### （四）本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目 自 2019 年 2 月 16 日至 2019 年 3 月 26 日止清算期间

#### 一、清算期间收益

1、利息收入（注 1） 1.81

清算期间收入小计 1.81

#### 二、清算期间费用

清算期间费用小计 -

三、清算期间净收益 1.81

表中相关项目具体说明如下：

利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2019 年 2 月 16 日至 2019 年 3 月 26 日清算期间的银行存款利息。

### （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 2019 年 2 月 15 日基金净资产 2,521.95

加：清算期间净收益 1.81

减：基金净赎回金额 -

二、2019 年 3 月 26 日基金净资产 2,523.76

截至本次清算期结束日 2019 年 3 月 26 日，本基金剩余财产为人民币 2,523.76 元。自本次清算期结束日次日 2019 年 3 月 27 日至本次清算款划出前一日期的银行存款产生的利息亦归基金份额持有人所有。

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除交纳所欠税款并清偿基金债务后，优先满足瑞利 A 的基金份额持有人的本金及约定收益分配（以基金合同终止日为准计算），剩余部分由瑞利 B 的基金份额持有人获得，并按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、《泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《通力律师事务所关于〈泰达宏利瑞利分级债券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。

泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金财产清算小组  
2019年3月26日