

泰达宏利亚洲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：2020年6月4日

清算报告公告日：2020年6月20日

目录

重要提示	2
一、基金概况.....	2
二、基金运作情况.....	3
三、财务会计报告.....	4
四、清算情况.....	5
五、备查文件.....	7

重要提示

泰达宏利亚洲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【2016】2074号予以注册，于2016年10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《泰达宏利亚洲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“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，无需召开基金份额持有人大会审议，基金管理人应当直接终止本基金合同”。本基金基金资产净值自2020年2月3日起低于5000万元，截至2020年4月27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2020年4月28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	泰达宏利亚洲债券型证券投资基金
基金简称	泰达宏利亚洲债券（QDII）
基金主代码	003463
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10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	2020年4月27日
最后运作日基金份额总额	17,039,985.35份
投资目标	本基金通过分析亚洲区域各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，

	在谨慎投资的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金为债券型的 QDII 基金，密切跟踪相关国家或地区经济的景气周期以及财政、货币政策变化，把握市场利率水平的运行态势，从宏观层面了解亚洲各国家、行业的景气情况、防范系统性的宏观经济、政治以及信用风险，从而确定基金资产在不同国家、不同行业以及不同债券品种之间的配置比例。	
业绩比较基准	摩根大通亚洲信用指数总报酬（JP Morgan Asian Credit Index Composite Total Return）*95%+中国人民银行公告人民币活期存款基准利率*5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险水平和预期收益都要低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。 本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。	
下属分级基金的基金简称：	泰达宏利亚洲债券（QDII）A	泰达宏利亚洲债券（QDII）C
下属分级基金的交易代码：	003463	003464
最后运作日下属分级基金的份额总额	12,514,296.11 份	4,525,689.24 份

二、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2016】2074号《关于准予泰达宏利亚洲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2016年10月12日向社会公开发行募集，基金合同于2016年10月14日生效，募集规模为698,402,253.26份基金份额。自2016年10月14日至2020年4月27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《泰达宏利亚洲债券型证券投资基金基金合同》等有关规定“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，无需召开基金份额持有人大会审议，基金管理人应当直接终止本基金合同”。本基金基金资产净值自2020年2月3日起低于5000万元，截至2020年4月27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《泰达宏利亚洲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 2020 年 4 月 28 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：泰达宏利亚洲债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 4 月 27 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日
	2020 年 4 月 27 日
资产：	
银行存款	5,787,960.42
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
债券投资	-
应收证券清算款	23,434,944.88
应收利息	2,316.61
应收股利	-
应收申购款	5,447.79
递延所得税资产	-
其他资产	798,586.71
资产总计	30,029,256.41
负债和所有者权益	最后运作日
	2020 年 4 月 27 日
负债：	
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	12,212,484.89
应付管理人报酬	20,745.49
应付托管费	5,186.36

应付销售服务费	1,772.79
应交税费	3,011.00
其他负债	113,635.19
负债合计	12,356,835.72
所有者权益：	
实收基金	17,039,985.35
未分配利润	632,435.34
所有者权益合计	17,672,420.69
负债和所有者权益总计	30,029,256.41

四、清算情况

自 2020 年 4 月 28 日至 2020 年 6 月 4 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。

（二）资产清算情况

截至本次清算期结束日（2020 年 6 月 4 日），部分资产尚未收回。根据基金管理人 2020 年 4 月 29 日发布的《关于泰达宏利亚洲债券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未到账的银行存款利息进行垫付。各项资产清算情况如下：

- 1、 本基金最后运作日应收利息为人民币 2,316.61 元，均为应收活期存款利息。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。
- 2、 本基金最后运作日应收申购款为人民币 5,447.79 元，该款项根据具体清算时间分笔分批划入托管账户，并已于 2020 年 4 月 30 日全部划入托管账户。
- 3、 本基金最后运作日其他资产为人民币 798,586.71 元，为国债期货备付金，该款项已于 2020 年 4 月 29 日划入托管账户。

（三）负债清偿情况

- 1、 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 12,212,484.89 元，该款项根据具体清算时间分笔分批进行支付，并已于 2020 年 5 月 12 日全部支付完毕。
- 2、 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 20,745.49 元，该款项已于 2020 年 5 月 8 日支付。
- 3、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 5,186.36 元，该款项已于 2020 年 5 月 8 日支付。
- 4、 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,772.79 元，该款项已于 2020 年 5 月 8 日支付。
- 5、 本基金最后运作日应付税费为人民币 3,011.00 元，该款项为应付增值税及其附加，该款项已于 2020 年 5 月 12 日支付。
- 6、 本基金最后运作日其他负债为人民币 113,635.19 元，其中应付审计费为人民币 79,343.74 元，该款项中人民币 60,000.00 为 2019 年度审计费，已于 2020 年 4 月 29 日支付，人民币 19,343.74 为清算期间审计费，已于 2020 年 6 月 2 日支付；其中应付上海证券报信息披露费为人民币 25,792.44 元，该款项已于 2020 年 6 月 1 日支付；其中应付赎回费为人民币 8,499.01 元，该款项根据具体清算时间分笔分批进行支付，并已于 2020 年 5 月 12 日全部支付完毕。

(四) 本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2020 年 4 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日止 清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	5,247.70
2、汇兑损益（注 2）	95,861.04
3、其他收入（注 3）	13.40
清算期间收入小计	101,122.14
二、清算期间费用	
清算期间费用小计（注 4）	-22,590.03
三、清算期间净收益	78,532.11

注：

- (1) 利息收入为自 2020 年 4 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日止清算期间的银行存款产生的利息收入。

- (2) 汇兑损益为自 2020 年 4 月 28 日至 2020 年 6 月 4 日止清算期间美元结汇产生的收入
- (3) 其他收入为于 2020 年 4 月 29 日确认的投资者赎回申请所产生的赎回费收入。
- (4) 清算期间费用为银行汇划费、律师费和 OOP 费用。

(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 2020 年 4 月 27 日基金净资产	17,672,420.69
加：清算期间净收益	78,532.11
加：基金申购金额（于 2020 年 4 月 29 日确认的投资者申购申请）	3,237.43
减：基金赎回金额（于 2020 年 4 月 29 日确认的投资者赎回申请）	2,905,323.47
二、2020 年 6 月 4 日基金净资产	14,848,866.76

截至本次清算期结束日 2020 年 6 月 4 日，本基金剩余财产为人民币 14,848,866.76 元。自本次清算期结束日次日 2020 年 6 月 5 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、《泰达宏利亚洲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<泰达宏利亚洲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

泰达宏利亚洲债券型证券投资基金财产清算小组

2020年6月4日