

# 天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金 清算报告

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二一年四月十五日

清算报告公告日：二〇二一年四月二十九日

## 一、重要提示

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》、《天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金自基金合同生效之日起，在任一开放期的最后一日日终（登记机构完成最后一日申购、赎回业务申请的确认以后），如发生以下情形之一，则本基金将于该日次日按照基金合同的约定进入基金财产清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会：

- 1、基金份额持有人数量不满 200 人；
- 2、基金资产净值低于 5000 万元。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）本次开放期为 2021 年 2 月 22 日至 2021 年 3 月 19 日。截至本次开放期的最后一日（即 2021 年 3 月 19 日）日终，本基金的基金资产净值低于 5000 万元，已经触发基金合同终止事由。根据《基金合同》约定，本基金将于该日次日进入基金财产清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会。天弘基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）自 2021 年 03 月 20 日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

本基金从 2021 年 03 月 20 日起进入清算期，由基金管理人天弘基金管理有限公司、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）、上海市通力律师事务所于 2021 年 3 月 20 日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。

## 二、基金概况

### 1、基金基本情况

基金名称	天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	天弘穗利一年定开
基金主代码	006722
基金运作方式	契约型开放式，以定期开放的方式运作

基金合同生效日	2019年01月30日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
基金最后运作日基金份额总额	15,179,518.91份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘穗利一年定开A	天弘穗利一年定开C
下属分级基金的交易代码	006722	006723
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	9,640,702.01份	5,538,816.90份

## 2、基金产品说明

投资目标	本基金以债券为主要投资对象，合理控制信用风险，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金将在控制信用风险、谨慎投资的前提下，力争在获取持有期收益的同时，实现基金资产的长期稳定增值。基于此目标，本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，将规范的宏观研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，动态调整固定收益类资产配置比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上，综合考量各类债券的流动性、供求关系、风险及收益率水平等，自下而上地精选个券。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>

业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+一年期银行定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

### 三、基金运作情况概述

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[2018]1881号《关于准予天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 772,398,733.12 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0088 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2019 年 1 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 772,717,947.65 份基金份额，其中认购资金利息折合 319,214.53 份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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》、《基金合同》的有关规定，本基金已于 2021 年 3 月 19 日日终出现了基金合同约定的终止事由，本基金管理人经与基金托管人协商一致后，决定依法履行基金财产清算程序并终止基金合同。本基金最后运作日为 2021 年 03 月 19 日。本基金从 2021 年 03 月 20 日起进入基金财产清算程序。

### 四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金

单位：人民币元

资产	最后运作日 2021 年 03 月 19 日
----	------------------------

<b>资产：</b>	
银行存款	6,078,439.00
结算备付金	701,133.33
存出保证金	7,432.08
交易性金融资产	15,865,871.56
其中：股票投资	—
基金投资	—
债券投资	15,865,871.56
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	—
应收利息	186,338.82
应收股利	—
应收申购款	2,018.66
递延所得税资产	—
其他资产	3,757.19
资产总计	22,844,990.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>最后运作日 2021年03月19日</b>
<b>负债：</b>	
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	6,423,999.80
应付管理人报酬	12,429.35
应付托管费	4,143.12
应付销售服务费	2,971.62
应付交易费用	—
应交税费	686.11

应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	80,000.46
负债合计	6,524,230.46
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	15,179,518.91
未分配利润	1,141,241.27
所有者权益合计	16,320,760.18
负债和所有者权益总计	22,844,990.64

注：1、报告截止日 2021 年 03 月 19 日(基金最后运作日)，天弘穗利一年定开 A 份额净值 1.0777 元，天弘穗利一年定开 C 份额净值 1.0708 元。

2、本财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师张振波、林佳璐签字出具了普华永道中天特审字(2021)第 2110 号标准无保留意见的审计报告。

## 五、基金财产分配

### 1、清算费用

按照《基金合同》的约定，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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

### 2、最后运作日资产处置情况

本基金最后运作日为 2021 年 03 月 19 日，基金份额持有人可在此日将持有到期的基金份额进行赎回，基金管理人在 2021 年 03 月 22 日对其所申请的赎回份额进行确认并在 2021 年 03 月 24 日支付赎回款，具体金额如下：

单位：人民币元

项目	金额	时间备注
一、最后运作日2021年03月19日 基金净资产	16,320,760.18	
减：基金赎回金额	1,018,673.61	2021年03月24日支付
减：基金转出金额	656.47	2021年03月23日交收

加：基金申购金额	19,067.69	2021年03月22日-23日交收
二、2021年03月22日基金净资产	15,355,899.06	期间发生利息收入2,736.88元；实现债券投资收益-9,375.78元；发生其他收入30.2元；发生交易费用17.33元；计提附加税0.77元；发生汇划手续费62.05元；发生公允价值变动损益42,090.12元。

### 3、停止运作后的清算损益情况说明

截至最后运作日（2021年03月19日）止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款6,078,439.00元，结算备付金701,133.33元，存出保证金7,432.08元，债券投资15,865,871.56元，应收利息186,338.82元，应收申购款2,018.66元，应收证券清算款3,757.19元；应付赎回款、赎回费、管理费、托管费、销售服务费、应交税费、预提审计费负债总计6,524,230.46元，资产净值16,320,760.18元。其中应付赎回款、赎回费、销售服务费、应交税费均于2021年04月15日之前支付，应收利息将于每季度结息日结算入账，此后新产生的利息将在销户结息时一次性结清。

考虑到本基金清算的实际情况，在清算期间产生的律师事务所律师费等其他清算费用，均由基金管理人承担，具体金额以缴费通知为准。

本基金的银行存款应收利息均为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

### 4、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

(1)天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金 2021 年 03 月 19 日清算审计报告

(2)上海市通力律师事务所关于《天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

二〇二一年四月十五日