

# 天弘智荟 6 个月持有期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：二〇二一年十一月十六日

清算报告公告日：二〇二一年十二月二日

## 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》、《天弘智荟6个月持有期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，《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50个工作日出现前述情形的，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。

截至2021年10月25日日终，天弘智荟6个月持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金资产净值低于5000万元，本基金已连续50个工作日基金资产净值低于5000万元。本基金已触发上述《基金合同》约定的自动终止情形，天弘基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）将自2021年10月26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10月26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）、上海源泰律师事务所于2021年10月26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，上海源泰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	天弘智荟6个月持有期债券型证券投资基金
基金简称	天弘智荟6个月
基金主代码	009389
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年11月04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(运作日后有赎回确认)	27,132,222.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘智荟6个月A	天弘智荟6个月C
下属分级基金的交易代码	009389	009390
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	10,942,781.35份	16,189,441.34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	主要投资策略包括：资产配置策略、目标久期策略及凸性策略、收益率曲线策略、信用债投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、杠杆投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
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

天弘智荟 6 个月持有期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[2020]536号《关于准予天弘智荟 6 个月持有期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《天弘智荟 6 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 287,488,155.98 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(2020)第 0947 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘智荟 6 个月持有期债券

型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 287,671,683.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 183,527.49 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》、《天弘智荟 6 个月持有期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，天弘智荟 6 个月持有期债券型证券投资基金出现了基金合同约定的终止事由，天弘基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与基金托管人协商一致后，决定终止基金合同并依法履行基金财产清算程序。本基金最后运作日为 2021 年 10 月 25 日。本基金从 2021 年 10 月 26 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：天弘智荟 6 个月持有期债券型证券投资基金

单位：人民币元

资产	最后运作日 2021年10月25日
<b>资产：</b>	
银行存款	92,767.50
结算备付金	368,924.19
存出保证金	1,080.18
交易性金融资产	33,018,100.00
其中：股票投资	—
基金投资	—
债券投资	33,018,100.00
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	999,818.82
应收利息	693,857.52
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	35,174,548.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>最后运作日 2021年10月25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	4,400,000.00
应付证券清算款	—
应付赎回款	2,743,846.93
应付管理人报酬	6,322.68
应付托管费	2,107.57
应付销售服务费	3,562.66
应付交易费用	—
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	151,200.00
负债合计	7,307,039.84
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	27,132,222.69
未分配利润	735,285.68
所有者权益合计	27,867,508.37
负债和所有者权益总计	35,174,548.21

注：1、报告截止日 2021 年 10 月 25 日(基金最后运作日)，天弘智荟 6 个月 A 份额净值 1.0289 元，天弘智荟 6 个月 C 份额净值 1.0259 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 3166 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《天弘智荟 6 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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 10 月 25 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 10 月 26 日对其所申请的赎回份额进行确认并在 2021 年 10 月 28 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10月25日基金净资产	27,867,508.37	
减：基金赎回金额	2,377,232.06	2021年10月28日支付
二、2021年10月26日基金净资产	25,489,095.75	期间发生利息收入1,647.84元；实现债券投资收益-110.00元；发生交易费用175.00元；发生回购付息：221.81元；发生汇划手续费21.59元；发生公允价值变动损益-2,300.00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 10 月 25 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 92,767.50 元，结算备付金 368,924.19 元，存出保证金 1,080.18 元，应收利息 693,857.52 元，应付赎回款、赎回费、管理费、

托管费、交易费用、预提费用等负债 2,907,039.84 元,资产净值 27,867,508.37 元。其中应收存款类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) 天弘智荟 6 个月持有期债券型证券投资基金 2021 年 10 月 25 日清算审计报告

(2) 上海源泰律师事务所关于《天弘智荟 6 个月持有期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。

天弘智荟 6 个月持有期债券型证券投资基金财产清算小组

二〇二一年十一月十六日