

# 天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

清算报告出具日：二〇二六年九月九日

清算报告公告日：二〇二六年九月十八日

## 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》、《天弘策略精选灵活配置混合型发起式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》生效三年后继续存续的，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，本基金合同应当终止，并按照本基金合同的约定程序进行清算，且无需召开基金份额持有人大会。

截至 2026 年 08 月 13 日日终，天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金资产净值持续低于 5000 万元，本基金已连续 60 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 2026 年 08 月 14 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 2026 年 08 月 14 日起进入清算期，由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人招商证券股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于 2026 年 08 月 14 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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          | 天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 |
| 基金简称          | 天弘策略精选                 |
| 基金主代码         | 004694                 |
| 基金运作方式        | 契约型开放式、发起式             |
| 基金合同生效日       | 2017 年 06 月 21 日       |
| 基金管理人         | 天弘基金管理有限公司             |
| 基金托管人         | 招商证券股份有限公司             |
| 基金最后运作日基金份额总额 | 50,716,293.67 份        |
| 基金合同存续期       | 不定期                    |

|                            |                 |              |
|----------------------------|-----------------|--------------|
| 下属分级基金的基金简称                | 天弘策略精选 A        | 天弘策略精选 C     |
| 下属分级基金的交易代码                | 004694          | 004748       |
| 基金最后运作日下<br>属分级基金的份额<br>总额 | 49,946,471.16 份 | 769,822.51 份 |

## 2、基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金以追求绝对收益和给予持有人长期稳定的良好回报为目标，在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值；同时，力争获取超过中国股票市场平均收益的超额回报。                                                                                                                                                           |
| 投资策略   | 本基金将切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的公司选择相结合的策略。通过自下而上精选策略优选个股，通过公司研究团队精选出的股票备选库构建基金股票组合。同时通过自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态地优化管理，进一步优化整个组合的风险收益特征，避免投资过程中随意性造成的 Alpha 流失。主要投资策略有：资产配置策略、股票投资策略、债券等固定收益类资产的投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。                                                                                                                                                                                                         |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。                                                                                                                                                                                                 |

## 三、基金运作情况概述

天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）系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[2015]2642号《关于准予天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2017年6月21日生效，首次设立募集规模为15,205,783.53份基金份额。本基金的运作方式为契约型开放式、发起式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

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》、《天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，天弘策略精选灵活配置混合型发起式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 2026 年 08 月 13 日。本基金从 2026 年 08 月 14 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：天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

单位：人民币元

| 资 产      | 最后运作日2026年08月13日 |
|----------|------------------|
| 资 产：     |                  |
| 货币资金     | 45,738,218.62    |
| 结算备付金    | 1,391,861.26     |
| 存出保证金    | 88,061.82        |
| 交易性金融资产  | —                |
| 其中：股票投资  | —                |
| 基金投资     | —                |
| 债券投资     | —                |
| 资产支持证券投资 | —                |
| 贵金属投资    | —                |
| 其他投资     | —                |
| 衍生金融资产   | —                |
| 买入返售金融资产 | —                |
| 应收清算款    | —                |
| 应收股利     | —                |
| 应收申购款    | —                |

|               |                         |
|---------------|-------------------------|
| 递延所得税资产       | —                       |
| 其他资产          | —                       |
| 资产总计          | 47,218,141.70           |
| <b>负债和净资产</b> | <b>最后运作日2026年08月13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     | —                       |
| 应付清算款         | —                       |
| 应付赎回款         | 51,435.73               |
| 应付管理人报酬       | 10,116.29               |
| 应付托管费         | 1,686.06                |
| 应付销售服务费       | 90.90                   |
| 应付投资顾问费       | —                       |
| 应交税费          | —                       |
| 应付利润          | —                       |
| 递延所得税负债       | —                       |
| 其他负债          | 73,581.85               |
| 负债合计          | 136,910.83              |
| <b>净资产：</b>   |                         |
| 实收基金          | 50,716,293.67           |
| 未分配利润         | -3,635,062.80           |
| 净资产合计         | 47,081,230.87           |
| 负债和净资产总计      | 47,218,141.70           |

注：

1、报告截止日 2026 年 08 月 13 日(基金最后运作日)，天弘策略精选 A 份额净值 0.9287 元，天弘策略精选 C 份额净值 0.9036 元。

2、本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师蒋燕华、骆文慧签字出具了安永华明（2026）专字第 80007653\_B49 号无保留意见的审计报告。

## 五、基金财产分配

### 1、清算费用

按照《天弘策略精选灵活配置混合型发起式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、资产处置情况

截至最后运作日（2026 年 08 月 13 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 45,738,218.62 元，结算备付金 1,391,861.26 元，存出保证金 88,061.82 元，应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费等负债 136,910.83 元，资产净值 47,081,230.87 元。其中现金资产类中包含的应计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计利息均为预计金额，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。

### 3、清算期间的剩余资产分配情况

单位：人民币元

| 项目                                     | 金额            |
|----------------------------------------|---------------|
| 一、最后运作日（2026年08月13日）基金净资产              | 47,081,230.87 |
| 减：清算期间（2026年08月14日至2026年08月18日）基金净赎回金额 | 8,416.32      |
| 加：清算期间（2026年08月14日至2026年08月18日）收入      | 8,998.98      |
| 利息收入                                   | 8,997.83      |
| 其他收入                                   | 1.15          |
| 二、2026年08月18日基金净资产                     | 47,081,813.53 |

注：资产处置后，根据《基金合同》约定，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基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 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)天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2026 年 08 月 13 日清算审计报告

(2)上海市通力律师事务所关于《天弘策略精选灵活配置混合型发起式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。

天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金财产清算小组

2026 年 09 月 09 日