

泰达宏利收益增强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：2017年11月08日

清算报告公告日：2018年1月3日

目录

重要提示 3

一、基金概况 4

二、基金运作情况 5

三、财务会计报告 5

四、清算情况 7

五、备查文件 10

重要提示

泰达宏利收益增强债券型证券投资基金（以下简称本基金）转型自泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金（以下简称原基金），原基金于2013年4月26日经中国证监会证监许可[2013]608号文注册；原基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会于2015年8月6日表决通过了《关于泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，于2015年9月9日实施基金转型，自基金转型实施日起，由《泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《泰达宏利收益增强债券型证券投资基金基金合同》生效，原《泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

本基金基金资产净值自2017年6月29日起低于5000万元，截至2017年9月20日，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的利益，本基金按照《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《泰达宏利收益增强债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）的有关规定终止《基金合同》并进行基金财产清算，而无需召开基金份额持有人大会。本基金已于2017年9月21日、9月22日、10月10日、10月12日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站就本基金基金合同终止及基金财产清算事宜进行了相关公告。详情见《关于泰达宏利收益增强债券型证券投资基金基金合同终止的风险提示公告》、《关于泰达宏利收益增强债券型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额申购业务的公告》、《关于泰达宏利收益增强债券型证券投资基金基金合同终止的第二次风险提示公告》、《关于泰达宏利收益增强债券型证券投资基金暂停赎回、转换转出业务的公告》、《关于泰达宏利收益增强债券型证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》。

本基金于2017年10月12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于2017年10月12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。

一、基金概况

基金名称 泰达宏利收益增强债券型证券投资基金

基金简称 泰达宏利收益债券

基金主代码 000169

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2015年9月9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 2017年10月11日

最后运作日基金份额总额 9,323,596.29

投资目标 紧跟新常态下我国经济发展过程中的经济调控政策，灵活配置各类投资工具，力争为投资者创造显著超越业绩比较基准的投资收益。

投资策略 本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，并在基金合同约定的资产配置范围内以投资时钟理论为指导，通过对经济周期所处的发展阶段及其趋势的分析和判断以及不同资产类别的预期表现，对基金资产配置进行动态调整，在有效控制投资组合风险的基础上，提高基金资产风险调整后收益。

业绩比较基准 人民银行一年期银行定期存款基准利率税后收益率*1.25

风险收益特征 本基金为债券型基金，属于证券市场中的较低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

二、基金运作情况

本基金由泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金转型而来，于 2015 年 8 月 6 日经原基金基金份额持有人大会表决通过《关于泰达宏利高票息定期开放债券型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，根据基金份额持有人大会表决，于 2015 年 9 月 9 日实施基金转型，《泰达宏利收益增强债券型证券投资基金基金合同》同日生效。

截至 2017 年 9 月 20 日，本基金基金资产净值已连续 60 个工作日低于 5000 万元。为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《泰达宏利收益增强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 2017 年 10 月 12 日起进入清算期。

三、财务会计报告

（一）基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：泰达宏利收益增强债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 10 月 11 日

单位：人民币元

最后运作日

2017 年 10 月 11 日

资产：

银行存款 10,402,627.92

存出保证金 76,245.13

交易性金融资产 410,184.00

应收利息 4,301.50

资产总计 10,893,358.55

负债：

应付赎回款 790,178.90

应付管理人报酬 2,196.84

应付托管费 627.66

应付销售服务费 206.60

应付税费 568,448.76

其他负债 50,006.02

负债合计 1,411,664.78

所有者权益：

实收基金 9,323,596.29

未分配利润 158,097.48

所有者权益合计 9,481,693.77

负债和所有者权益总计 10,893,358.55

四、清算情况

自 2017 年 10 月 12 日至 2017 年 11 月 08 日止为本次清算期间，基金财产清算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组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，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组优先从基金财产中支付。考虑到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，本基金清算期间涉及的银行划款手续费由基金管理人代为支付。

（二）资产清算情况

截至本次清算期结束日（2017 年 11 月 08 日），部分资产尚未收回，根据基金管理人 2017 年 10 月 12 日发布的《关于泰达宏利收益增强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该部分资产进行垫付。各项资产清算情况如下：

1、本基金最后运作日存出保证金为人民币 76,245.13 元，该款项已于 2017 年 11 月 2 日划入托管账户。
2、本基金最后运作日应收利息为人民币 4,301.50 元。其中应收活期银行存款利息为人民币 4,235.37 元，应收备付金利息为人民币 3.80 元，应收保证金利息为人民币 62.33 元。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。

3、本基金最后运作日持有的股票资产为人民币 410,184.00 元，该金额为停牌股票最后运作日估值金额（停牌股票最后运作日估值金额=该只停牌股票的指数收益法价格*股票数量）。具体情况如下：

（1）停牌股票处置情况：

1) 本基金最后运作日（2017 年 10 月 11 日）持有的全部停牌股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	股票数量（股）	停牌价格
----	------	------	---------	------

				（人民币元） 最后运作日估值金额
--	--	--	--	------------------

				（人民币元）
--	--	--	--	--------

1	002006	精功科技	48,600	8.44	410,184.00
---	--------	------	--------	------	------------

合计				410,184.00
----	--	--	--	------------

2) 本次清算期间（2017 年 10 月 12 日至 2017 年 11 月 08 日）停牌股票复牌及处置情况：

本基金持有的 002006 精功科技已于 2017 年 11 月 2 日复牌，并于当日卖出，卖出所得金额共计 373,884.52 元。

（三）负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 2,196.84 元，该款项已于 2017 年 11 月 3 日支付。
2、本基金最后运作日应付托管费为人民币 627.66 元，该款项已于 2017 年 11 月 3 日支付。
3、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 206.60 元，该款项已于 2017 年 11 月 3 日支付。
4、本基金最后运作日应付赎回款为人民币 790,178.90 元，该款项分别于 2017 年 10 月 12 日、2017 年 10 月 13 日支付。

5、本基金最后运作日应付税费为人民币 568,448.76 元，该款项为债券利息个税，考虑到税务风险，此次不予分配。

6、本基金最后运作日其他负债为人民币 50,006.02 元，包括应付赎回费、预提审计费。本基金最后运作日应付赎回费为人民币 6.02 元，该款项已于 2017 年 10 月 12 日支付；本基金最后运作日预提审计费为预提的 2017 年审计费，金额为人民币 50,000.00 元，该款项已于 2017 年 11 月 6 日支付。

（四）本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目 自 2017 年 10 月 12 日至 2017 年 11 月 08 日止清算期间

一、清算收益

1、利息收入（注 1） 5,394.41

2、股票变现损益（注 2） -35,892.00

3、其他收入（注 3） 19.84

清算收入小计 -30,477.75

二、清算费用（注 4） -

四、清算净收益 -30,477.75

表中相关项目具体说明如下：

- 1、利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2017 年 10 月 12 日至 2017 年 11 月 08 日止清算期间的银行存款、备付金及保证金利息。
- 2、股票变现损益为本次清算期间卖出股票金额与其最后运作日估值金额的差额。
- 3、其他收入为赎回费收入。
- 4、本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

（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 2017 年 10 月 11 日基金净资产 9,481,693.77

加：清算期间净收益 -30,477.75

减：基金净赎回金额（于 2017 年 10 月 12 日确认的投资者赎回申请） 238,605.12

二、2017 年 11 月 08 日基金净资产 9,212,610.90

截至本次清算期结束日 2017 年 11 月 08 日，本基金剩余财产为人民币 9,212,610.90 元。自本次清算期结束日次日 2017 年 11 月 09 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，并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分配。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《泰达宏利收益增强债券型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于泰达宏利收益增强债券型证券投资基金清算的法律意见》

（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。

泰达宏利收益增强债券型证券投资基金基金财产清算组

2018 年 1 月 3 日