

# 天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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：二〇二五年一月二十日

清算报告公告日：二〇二五年一月二十三日

## 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》、《天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，《基金合同》生效满三年之日（指自然日），若基金资产净值低于 2 亿元的，本基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定即可按照本基金合同约定的程序进行清算，并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金《基金合同》生效日为 2021 年 12 月 21 日，《基金合同》生效之日起三年后的对应自然日为 2024 年 12 月 21 日。经本基金的基金注册登记机构确认，截至 2024 年 12 月 21 日，本基金规模低于 2 亿元，触发《基金合同》终止情形，基金管理人将按照《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止《基金合同》，无须召开基金份额持有人大会。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”）自 2024 年 12 月 22 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 2024 年 12 月 22 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 2024 年 12 月 23 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	天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
基金简称	天弘旗舰精选 3 个月持有混合发起式（FOF）
基金主代码	013089
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 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	10,981,755.03 份
基金合同存续期	不定期

下属分级基金的基金简称	天弘旗舰精选 3 个月持有混合发起式 (FOF) A	天弘旗舰精选 3 个月持有混合发起式 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	013089	013090
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	5,837,968.06 份	5,143,786.97 份

## 2、基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过资产配置策略和公募基金精选策略，进行积极主动的投资管理，力争为持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	资产配置策略、底层资产投资策略（基金投资策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、公募 REITs 投资策略）。
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率*75%+中债-新综合财富（总值）指数*20%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*5%。
风险收益特征	本基金为混合型发起式基金中基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

## 三、基金运作情况概述

天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) (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[2021]2160 号《关于准予天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 注册的批复》准予注册，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《天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 12,009,278.32 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 (2021) 第 1269 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

基金合同》于2021年12月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为12,011,014.40份基金份额，其中认购资金利息折合1,736.08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》、《天弘旗舰精选3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，天弘旗舰精选3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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2024年12月21日。本基金从2024年12月22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：天弘旗舰精选3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2024 年 12 月 21 日
<b>资产：</b>	
货币资金	1,144,957.00
结算备付金	11,998.46
存出保证金	4,288.22
交易性金融资产	9,036,227.77
其中：股票投资	1,075,500.49
基金投资	7,557,531.66
债券投资	403,195.62
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	97,386.14
应收股利	40.22
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	287.21
资产总计	10,295,185.02
<b>负债和净资产</b>	<b>最后运作日 2024 年 12 月 21 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	-18.79
应付清算款	348,093.91
应付赎回款	736,732.71
应付管理人报酬	2,659.12
应付托管费	542.75
应付销售服务费	495.72
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	17,818.53
负债合计	1,106,323.95
<b>净资产：</b>	
实收基金	10,981,755.03
未分配利润	-1,792,893.96
净资产合计	9,188,861.07
负债和净资产总计	10,295,185.02

注：

1、报告截止日 2024 年 12 月 21 日（基金最后运作日），天弘旗舰精选 3 个月持有混合发起式（FOF）A 份额净值 0.8391 元，天弘旗舰精选 3 个月持有混合发起式（FOF）C 份额净值 0.8341 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、费泽旭签字出具了安永华明（2025）专字第 80007653\_B01 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《天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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（2024 年 12 月 21 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 1,144,957.00 元，结算备付金 11,998.46 元，存出保证金 4,288.22 元，卖出回购金融资产款、应付清算款、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 1,106,323.95 元，资产净值 9,188,861.07 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。

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金于最后运作日持有的交易性金融资产均已变现，变现金额为 8,989,436.57 元。

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（2024年12月21日）基金净资产	9,188,861.07
减：清算期间（2024年12月22日至2024年12月31日）基金净赎回金额	17,032.42
加：清算期间（2024年12月22日至2024年12月31日）收入	-44,746.99
利息收入	2,864.62
公允价值变动收益	-483,465.47
投资收益	435,814.49
其他收入	39.37
减：清算期间（2024年12月22日至2024年12月31日）费用	18.82
利息支出	18.79
其他费用	0.03
二、2024年12月31日基金净资产	9,127,062.84

注：

1. 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。

2. 投资收益为清算期间持有的交易性金融资产的处置损益，同时将原计入该金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

### 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) 天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2024 年 12 月 21 日清算审计报告

(2) 上海市通力律师事务所关于《天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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。

天弘旗舰精选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 财产清算小组

2025 年 1 月 20 日