

泰达宏利多元回报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：2018年3月21日

清算报告公告日：2018年6月1日

目录

重要提示	3
一、基金概况.....	3
二、基金运作情况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清算情况.....	5
五、备查文件.....	9

重要提示

泰达宏利多元回报债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会证监许可[2015]2505号予以注册,于2016年4月13日成立并正式运作。

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》和《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)等有关规定,“自基金合同生效日起,出现如下情形之一的,基金合同应当终止并根据基金合同的约定进行基金财产清算,而无需召开基金份额持有人大会:1、连续60个工作日,基金资产净值低于5000万元;2、连续60个工作日,有效申请确认后基金份额持有人数量少于200人。”截至2018年1月18日日终,泰达宏利多元回报债券型证券投资基金的资产净值低于5000万元,触发上述基金合同终止情形,基金合同应当自动终止且无需召开基金份额持有人大会。

本基金于2018年2月1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	泰达宏利多元回报债券型证券投资基金
基金简称	泰达多元回报债券
基金主代码	002470/002471
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月13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	2018年1月31日
最后运作日基金份额总额	4,590,907.80份
投资目标	严控本基金下行风险的前提下,灵活运用多种投资策略,为基金份额持有人创造较高的投资收益。
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	本基金业绩比较基准：中证全债指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
下属分级基金的基金简称：	泰达多元回报债券 A	泰达多元回报债券 C
下属分级基金的交易代码：	002470	002471
最后运作日下属分级基金的份额总额	1,838,567.63 份	2,752,340.17 份

二、基金运作情况

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[2015]2505号《关于准予泰达宏利多元回报债券型证券投资基金注册的批复》注册，由泰达宏利基金管理有限公司于2016年3月14日至2016年4月8日向社会公开发行募集，基金合同于2016年4月13日正式生效，募集规模为618,915,324.20份基金份额。自2016年4月13日至2018年1月18日期间，本基金按基金合同正常运作。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》和《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金基金合同》等有关规定，“自基金合同生效日起，出现如下情形之一的，基金合同应当终止并根据基金合同的约定进行基金财产清算，而无需召开基金份额持有人大会：1、连续60个工作日，基金资产净值低于5000万元；2、连续60个工作日，有效申请确认后基金份额持有人数量少于200人。”自2017年10月26日起，截至2018年1月18日日终泰达宏利多元回报债券型证券投资基金的资产净值已连续60个工作日低于5000万元。

为更好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《泰达宏利多元回报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2018年2月1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: 泰达宏利多元回报债券型证券投资基金

报告截止日: 2018年1月31日 (基金最后运作日)

单位: 人民币元

	最后运作日 2018年1月31日
资产:	
银行存款	229,499.23
结算备付金	163,071.32
存出保证金	5,155.56
交易性金融资产	4,505,069.00
其中: 股票投资	516,669.00
债券投资	3,988,400.00
应收利息	71,353.22
资产总计	4,974,148.33
负债:	
应付赎回款	151,963.69
应付管理人报酬	13,919.13
应付托管费	3,976.91
应付销售服务费	2,751.47
应付税费	445.50
其他负债	34.48
负债合计	173,091.18
所有者权益:	
实收基金	4,590,907.80
未分配利润	210,149.35
所有者权益合计	4,801,057.15
负债和所有者权益总计	4,974,148.33

四、清算情况

自 2018 年 2 月 1 日至 2018 年 3 月 21 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，包括支付给会计师事务所、律师事务所的费用，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。

(二) 资产清算情况

截至本次清算期结束日（2018年3月21日），部分资产尚未收回，根据基金管理人2018年2月1日发布的《关于泰达宏利多元回报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、 本基金最后运作日结算备付金为人民币 163,071.32 元，该款项已于 2018 年 2 月 2 日和 2018 年 3 月 2 日分次由交易所备付金账户划入托管账户。
- 2、 本基金最后运作日存出保证金为人民币 5,155.56 元，该款项已于 2018 年 2 月 2 日划入托管账户。
- 3、 本基金最后运作日应收利息为人民币 71,353.22 元，其中应收申购款利息为人民币 0.03 元，已于 2018 年 2 月 6 日划入托管账户；应收债券利息为人民币 70,306.85 元，已于 2018 年 2 月 2 日随债券资产卖出款项划入托管账户；应收活期存款利息为人民币 678.90 元、应收结算备付金利息为人民币 357.75 元、应收保证金利息为人民币 9.69 元，已于 2018 年 3 月 21 日划入托管账户。
- 4、 本基金最后运作日持有的股票资产为人民币 516,669.00 元，该金额为停牌股票最后运作日估值金额之和。具体情况如下：

1) 本基金最后运作日（2018年1月31日）持有的全部股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	期末估值单 价 (人民币 元)	最后运作日估值金额 (人民币元)	备注
1	000006	深振业 A	29,900	11.43	341,757.00	指数收益法估值
2	600309	万华化学	4,800	36.44	174,912.00	停牌前一日收盘价
合计					516,669.00	

2) 本次清算期间（2018年2月1日至2018年3月21日）停牌股票复牌及处置情况：

本基金持有的 000006 深振业 A 已于 2018 年 3 月 8 日复牌，并于次日卖出，变现所得金额共计人民币 254,982.11 元。

截至本次清算期结束日（2018 年 3 月 21 日），本基金所持停牌股票 600309 万华化学尚未复牌。为加快清算速度，基金管理人泰达宏利基金管理有限公司将以自有资金人民币 174,912.00 元垫付至托管账户。待停牌股票变现后，若本基金所持停牌股票整体变现金额高于基金管理人为本基金停牌股票垫付的金额，则将差额按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人；若本基金所持停牌股票整体变现金额小于基金管理人为本基金停牌股票垫付的金额，则由基金管理人承担相应损失。

5、 本基金最后运作日持有的债券资产为人民币 3,988,400.00 元，应收债券利息为人民币 70,306.85 元，明细如下：

交易平台	债券名称	债券代码	最后运作日 估值单价 (人民币 元)	数量 (张)	最后运作日 成本总额(人 民币元)	最后运作日 估值总额 (人民币 元)
交易所	15国债12	019512	99.71	40,000.00	3,997,600.00	3,988,400.00
合计				40,000.00	3,997,600.00	3,988,400.00

以上债券资产已于 2018 年 2 月 1 日卖出，变现所得（含债券利息收入）金额共计人民币 4,059,401.97 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 13,919.13 元，该款项已于 2018 年 2 月 5 日支付。
- 2、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,976.91 元，该款项已于 2018 年 2 月 5 日支付。
- 3、 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 151,963.69 元，该款项分别于 2018 年 2 月 1 日和 2018 年 2 月 2 日支付。
- 4、 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 2,751.47 元，该款项已于 2018 年 2 月 5 日支付。
- 5、 本基金最后运作日应付税费为人民币 445.50 元，该款项为应付增值税及其附加，该款项已于 2018 年 3 月 9 日支付。

6、 本基金最后运作日其他负债为人民币 34.48 元，为应付赎回费，该款项分别于 2018 年 2 月 1 日和 2018 年 2 月 2 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 2018 年 2 月 1 日至 2018 年 3 月 21 日止清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	4,441.15
2、变现损益（注 2）	-86,097.00
3、其他收入（注 3）	0.66
清算期间收入小计	-81,655.19
二、清算期间费用	
清算期间费用小计（注 4）	8,579.67
四、清算期间净收益	-90,234.86

注：

- (1) 利息收入系自 2018 年 2 月 1 日至 2018 年 3 月 21 日止清算期间的银行存款、备付金、保证金利息以及债券利息收入。
- (2) 变现损益为股票变现损益和债券变现损益之和，股票变现损益为本次清算期间股票资产变现金额，与最后运作日估值金额相减的差额；债券变现损益为本次清算期间债券资产变现金额扣除清算期间债券利息后，与最后运作日估值金额相减的差额。
- (3) 其他收入为赎回费收入。
- (4) 清算期间费用为审计费、银行汇划费、交易费用等。

(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 2018 年 1 月 31 日基金净资产	4,801,057.15
加：清算期间净收益	-90,234.86
减：基金净赎回金额（于 2018 年 2 月 1 日确认的投资者赎回申请）	15,356.50

二、2018年3月21日基金净资产	4,695,465.79
-------------------	--------------

截至本次清算期结束日 2018 年 3 月 21 日，本基金剩余财产为人民币 4,695,465.79 元。自本次清算期结束日次日 2018 年 3 月 22 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，将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进行分配。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、 《泰达宏利多元回报债券型证券投资基金清算审计报告》
- 2、 《关于〈泰达宏利多元回报债券型证券投资基金清算报告〉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。

泰达宏利多元回报债券型证券投资基金基金财产清算组

2018 年 3 月 21 日