

天弘金利灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：南京银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇一八年七月二十一日

清算报告公告日：二〇一八年九月二十日

一、重要提示

天弘金利灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]2221号《关于准予天弘金利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]2570号《关于天弘金利灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《天弘金利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)负责公开募集。经向中国证监会备案,本基金《基金合同》于2016年12月21日正式生效。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

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》以及本基金《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5000万元的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金合同应当终止,并按照基金合同的约定程序进行清算,无需召开基金份额持有人大会。

截至2018年7月19日日终,本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元,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2018年7月20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。本基金发生基金合同终止事由并进入清算程序的安排详见2018年7月20日刊登在指定媒介的《关于天弘金利灵活配置混合型证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》。

本基金从2018年7月20日起进入清算期,由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人南京银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所于2018年7月20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。

二、基金概况

- 1、基金名称：天弘金利灵活配置混合型证券投资基金
(基金简称：天弘金利混合，基金代码：002433)
- 2、基金运作方式：契约型开放式
- 3、基金合同生效日：2016年12月21日
- 4、最后运作日2018年7月19日，基金份额总额：326,064.18份。
- 5、投资目标：本基金力求通过资产配置和灵活运用多种投资策略，把握市场机会，在严格控制风险的前提下获取高于业绩比较基准的投资收益。

6、投资策略：本基金采取灵活资产配置，主动投资管理的投资模式。在投资策略上，本基金从两个层次进行，首先是进行大类资产配置，在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险，把握市场波动中产生的投资机会；其次是采取自下而上的分析方法，从定量和定性两个方面，通过深入的基本面研究分析，精选具有良好投资价值的个股和个券，构建股票组合和债券组合。

7、业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

8、风险收益特征：本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，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。

9、基金管理人：天弘基金管理有限公司

10、基金托管人：南京银行股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2015]2221号《关于准予天弘金利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]2570号《关于天弘金利灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《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，首次募集期间为2016年12月5日起至2016年12月16日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,371,068.98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(2016)第1635号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于2016年12月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,375,123.44份基金份额，其中认购资金利息折合4,054.46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，基金托管人为南京银行股份有限公司。

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》以及本基金《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5000万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金合同应当终止，并按照基金合同的约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会。截至2018年7月19日日终，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，触发上述《基金合同》约定的自动终止情形。本基金从2018年7月20日起进入清算期，由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人南京银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于2018年7月20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。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：天弘金利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年7月19日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2018 年 7 月 19 日
资产：	
银行存款	719,305.46
结算备付金	—
存出保证金	83,840.75
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	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	—
应收利息	612.37
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	803,758.58
负债和所有者权益	最后运作日2018年7月19日
负债：	
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	—
应付证券清算款	—
应付赎回款	9,939.56
应付管理人报酬	160,388.08
应付托管费	30.58
应付销售服务费	—
应付交易费用	27,938.88
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	316,253.09
负债合计	514,550.19
所有者权益：	
实收基金	326,064.18
未分配利润	-36,855.79
所有者权益合计	289,208.39
负债和所有者权益总计	803,758.58

注： 1、报告截止日 2018 年 7 月 19 日(基金最后运作日)，基金份额净值 0.8870 元，基金份额总额 326,064.18 份。

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，注册会计师薛竞、周祎签字出具了普华永道中天特审字(2018)第 2348 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《基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”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、本基金最后运作日为 2018 年 7 月 19 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 2018 年 7 月 20 日对其所申请的赎回份额进行确认并在 2018 年 7 月 24 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2018年7月19日基金净资产	289,208.39	
减：基金净赎回金额	13,722.81	2018年7月24日支付
二、2018年7月20日基金净资产	275,486.28	其中当日计提银行存款利息14.17元，计提保证金利息3.77元，即应收利息科目当日产生计提金额17.94元；当日产生赎回费17.24元。

3、停止运作后的清算损益情况说明

截至最后运作日（2018 年 7 月 19 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余额共人民币 719,305.46 元，保证金 83,840.75 元，应收利息 612.37 元，应付赎回款、管理费、托管费、交易费用、预提费用（上清中债账户维护费、信息披露费用、审计费用）等负债 514,550.19 元，基金净资产 289,208.39 元。其中应收利息将于 9 月末结息变现，此后新产生的利息将在销户结息时变现。

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基金管理人承担。

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) 天弘金利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 7 月 19 日资产负债表及审计报告

(2) 通力律师事务所关于《天弘金利灵活配置混合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。

天弘金利灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

二〇一八年七月二十一日