

泰达宏利信用合利定期开放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9月7日

清算报告公告日：2018年11月10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.....	8

重要提示

泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金(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[2012]1607号予以核准,于2013年3月19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《泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)第五部分“基金的备案”等有关规定:“若在开放期最后一日本基金的份额持有人数量不满200人,或者基金资产净值加上当日申购和基金转换中转入的基金份额对应的资产净值减去当日赎回和基金转换中转出的基金份额对应的资产净值低于5000万元,基金合同将于次日终止并根据基金合同第二十四部分的约定进行基金财产清算。”

本基金最近一个开放期为2018年7月13日起至2018年8月9日止,截至开放期最后一日日终,本基金的资产净值低于5000万元,触发上述基金合同终止情形,基金合同自动终止。

本基金于2018年8月10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	泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金
基金简称	泰达信用合利债券
基金主代码	000026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月19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8月9日
最后运作日基金份额总额	8,991,077.49份

投资目标	在追求基金资产安全的前提下，力争创造高于业绩比较基准的投资收益
投资策略	封闭期内，本基金的固定收益类资产投资将主要采取信用策略，同时辅之以目标久期调整策略、收益率曲线策略、信用利差配置策略等，并且对于可转债、资产支持证券等特殊债券品种将采用针对性投资策略；开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
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*1.2
风险收益特征	本基金为纯债基金，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

本基金经中国证监会证监许可[2012] 1607号《关于核准泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准，由泰达宏利基金管理有限公司自2013年2月25日至2013年3月15日止向社会公开发行募集，基金合同于2013年3月19日正式生效，募集规模为4,362,552,082.48份基金份额。自2013年3月19日至2018年8月9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《泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金基金合同》第五部分“基金的备案”等有关规定，“若在开放期最后一日本基金的份额持有人数量不满200人，或者基金资产净值加上当日申购和基金转换中转入的基金份额对应的资产净值减去当日赎回和基金转换中转出的基金份额对应的资产净值低于5000万元，基金合同将于次日终止并根据基金合同第二十四部分的约定进行基金财产清算。”本基金的最近的一个开放期为2018年7月13日起至2018年8月9日，截至开放期最后一日日终的资产净值为8,761,245.04元，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《泰达宏利信用合利定期开放债券型证券

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。本基金自 2018 年 8 月 10 日起进入清算期。

三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金
报告截止日：2018 年 8 月 9 日

单位：人民币元

	最后运作日 2018 年 8 月 9 日
资产：	
银行存款	8,827,983.22
结算备付金	609,090.91
存出保证金	8,399.12
应收利息	14,877.90
资产总计	9,460,351.15
负债：	
应付赎回款	407,637.08
应付管理人报酬	4,525.49
应付托管费	1,810.18
应付销售服务费	422.30
应付交易费用	2,572.62
应付税费	209,478.00
其他负债	72,660.44
负债合计	699,106.11
所有者权益：	
实收基金	8,991,077.49
未分配利润	-229,832.45
所有者权益合计	8,761,245.04
负债和所有者权益总计	9,460,351.15

四、清算情况

自 2018 年 8 月 10 日至 2018 年 9 月 7 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9月7日），部分资产尚未收回。根据基金管理人2018年8月10日发布的《关于泰达宏利信用合利定期开放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609,090.91元，该款项已于2018年9月4日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8,399.12元，该款项已于2018年9月4日由交易所备付金账户划入托管账户。

3□ 本基金最后运作日应收利息为人民币14,877.90元。其中应收活期银行存款利息为人民币14,155.20元，应收备付金利息为人民币712.55元，应收保证金利息为人民币10.15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。

(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4,525.49元，该款项已于2018年9月5日支付。

2□ 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,810.18元，该款项已于2018年9月5日支付。

3□ 本基金最后运作日应付赎回款为人民币407,637.08元，该款项分别于2018年8月10日和2018年8月13日支付。

4□ 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币422.30元，该款项已于2018年9月5日支付。

5□ 本基金最后运作日应付交易费用为人民币2,572.62元，全部为应付银行间交易费用，该款项分别于2018年8月27日和2018年8月29日支付。

6□ 本基金最后运作日应付税费为人民币 209,478.00 元，该款项为债券利息个税，考虑到税务风险，此次不予分配。

7□ 本基金最后运作日其他负债为人民币 72,660.44 元，包括应付信息披露费、预提审计费和应付赎回费。本基金最后运作日应付信息披露费为人民币 18,166.20 元，该款项已于 2018 年 8 月 29 日支付；本基金最后运作日预提审计费为预提的 2018 年审计费，金额为人民币 54,494.18 元，该款项已于 2018 年 8 月 20 日支付；本基金最后运作日应付赎回费为人民币 0.06 元，该款项分别于 2018 年 8 月 10 日和 2018 年 8 月 13 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 8 月 10 日至 2018 年 9 月 7 日止清算 期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	5,574.29
2、其他收入（注 2）	2.32
清算期间收入小计	5,576.61
二、清算期间费用	
清算期间费用小计（注 3）	6,080.00
三、清算期间净收益	-503.39

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 2018 年 8 月 10 日至 2018 年 9 月 7 日清算期间的银行存款、备付金及保证金利息。

2□ 其他收入为赎回费收入。

3□ 本次清算期间费用为银行汇划费、银行间账户维护费等。

(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 8 月 9 日基金净资产	8,761,245.04
加：清算期间净收益	-503.39
减：基金净赎回金额（于 2018 年 8 月 10 日确认	103,838.43

的投资者赎回申请)	
二、2018年9月7日基金净资产	8,656,903.22

截至本次清算期结束日2018年9月7日，本基金剩余财产为人民币8,656,903.22元。自本次清算期结束日次日2018年9月8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分配。

五、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1□ 《泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》
- 2□ 《关于泰达宏利信用合利定期开放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。

泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金财产清算组

2018年9月7日