

# 天弘乐享保本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：中信银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇一九年四月四日

清算报告公告日：二〇一九年五月二十九日

### 一、重要提示

天弘乐享保本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[2016]193号《关于准予天弘乐享保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,《天弘乐享保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)于2016年3月9日生效,本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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》、《关于避险策略基金的指导意见》(以下简称“《指导意见》”)、《天弘乐享保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定,天弘乐享保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)不再满足保本基金的存续条件,本基金出现《基金合同》终止事由并将依法进入基金财产清算程序,无需召开基金份额持有人大会。

《基金合同》终止及基金财产清算程序的安排详见2019年3月12日刊登在指定媒介的《天弘基金管理有限公司关于天弘乐享保本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》。

本基金自2019年3月19日起进入清算期。基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人中信银行股份有限公司、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已于2019年3月12日组成基金财产清算小组,于本基金进入清算期后履行了基金财产清算小组的职责,对本基金进行了清算,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

基金名称 天弘乐享保本混合型证券投资基金

基金简称 天弘乐享保本混合

基金主代码 002432

基金运作方式 契约型开放式,以定期开放的方式运作

基金合同生效日 2016年3月9日

基金最后运作日(2019年3月18日)基金份额总额 12,204,002.04份

投资目标 在严格控制风险的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,综合运用投资组合保险策略,力

求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。

#### 投资策略

本基金将采用恒定比例组合保本策略(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance),对资产配置建立和运用数量化的分析模型,动态地监控和调整本基金在稳健资产与风险资产上的投资比例,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过积极稳健的选择市场时机和精选个股进行投资,争取为基金资产获取更高的投资回报。具体而言,本基金的投资策略包括大类资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。

业绩比较基准 三年期银行定期存款利率（税后）+2.00%

#### 风险收益特征

本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

基金管理人 天弘基金管理有限公司

基金托管人 中信银行股份有限公司

基金保证人 重庆市三峡担保集团股份有限公司

#### 三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2016]193号《关于准予天弘乐享保本混合型证券投资基金注册的批复》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，本基金募集期间为自2016年2月25日至2016年3月7日，募集规模为963,029,109.41元（含认购资金在募集期间产生的利息88,054.86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214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3月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为963,029,109.41份基金份额（含募集期间利息结转的份额）。

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》、《指导意见》、《基金合同》的有关规定，如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，或不符法律法规和《基金合同》对基金的存续要求，则本基金将根据《基金合同》的规定终止并进入清算程序，无需召开基金份额持有人大会。根据2017年1月24日中国证监会发布的《指导意见》，现有保本基金在保本周期到期后，应当按照《指导意见》的要求对基金合同、招募说明书等文件进行修订，并履行相应程序，变更注册为避险策略基金；不按照《指导意见》要求进行修订的，应当转型为其他类型的基金或予以清算。本基金第一个保本周期到期时，结合市场情况，本基金无法按照《指导意见》关于避险策略基金的运作机制进行调整，故不再符合保本基金存续条件。本基金已触发上述《基金合同》约定的自动终止情形，本基金自2019年3月19日起进入清算期。基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人中信银行股份有限公司、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已于2019年3月12日组成基金财产清算小组，于本基金进入清算期后履行了基金财产清算小组的职责，对本基金进行了清算，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。

自《基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

#### 四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：天弘乐享保本混合型证券投资基金

报告截止日：2019年3月18日

单位：人民币元

资产 最后运作日 2019年3月18日

资产：

银行存款 19,917,978.83

结算备付金 6,000.47

存出保证金 73,535.45

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 174,537.01  
应收股利 —  
应收申购款 —  
递延所得税资产 —  
其他资产 —  
资产总计 20,172,051.76  
负债和所有者权益 最后运作日 2019 年 3 月 18 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 7,171,937.84  
应付管理人报酬 353,241.61  
应付托管费 58,873.59  
应付销售服务费 —  
应付交易费用 13,394.39  
应交税费 66,010.05  
应付利息 —  
应付利润 —  
递延所得税负债 —  
其他负债 164,000.00  
负债合计 7,827,457.48  
所有者权益：  
实收基金 12,204,002.04  
未分配利润 140,592.24  
所有者权益合计 12,344,594.28  
负债和所有者权益总计 20,172,051.76

注：1、报告截止日 2019 年 3 月 18 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0115 元，基金份额总额 12,204,002.04 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（2019）第 1904 号标准无保留意见的审计报告。

## 五、清算事项说明

### 1、清算费用

按照《基金合同》第二十部分“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 2019 年 3 月 18 日，基金份额持有人在此日的赎回申请，基金管理人在

2019年3月19日对其所申请的赎回份额进行确认并在2019年3月21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2019年3月18日基金净资产 12,344,594.28

减：基金净赎回金额 1,686,504.38 2019年3月20日支付转出款 12,974,.92 元，2019年3月21

日支付赎回款 1,673,529.46 元

二、2019年3月19日基金净资产 10,658,409.17

其中2019年3月19日计提银行存款利息 315.69 元， 计提

备付金利息 0.27 元，计提保证金利息 3.31 元，即应收利息

科目产生计提金额 319.27 元。

### 3、停止运作后的清算损益情况说明

截至最后运作日（2019年3月18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 19,917,978.83 元，备付金 6,000.47 元，保证金 73,535.45 元，应收利息 174,537.01 元，应付赎回款、管理费、托管费、交易费用、应交税费、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 7,827,457.48 元，基金净资产 12,344,594.28 元。其中应收利息已于3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，在清算期间产生的银行间账户维护费、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) 天弘乐享保本混合型证券投资基金2019年3月18日资产负债表及审计报告

(2) 上海市通力律师事务所关于《天弘乐享保本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。

天弘乐享保本混合型证券投资基金基金财产清算小组

二〇一九年四月四日