

泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金

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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2020年9月9日

清算报告公告日：2020年9月18日

目录

重要提示	2
一、基金概况.....	2
二、基金运作情况.....	3
三、财务会计报告.....	4
四、清算情况.....	5
五、备查文件.....	7

重要提示

泰达宏利睿选稳健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【2016】2077号予以注册，于2017年1月23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《泰达宏利睿选稳健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”）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第十九部分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”。本基金基金资产净值自2020年5月22日起低于5000万元，截至2020年8月17日日终，已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，基金管理人应终止《基金合同》并依法履行基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会。

本基金于2020年8月18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、基金托管人招商银行股份有限公司、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	泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泰达睿选稳健混合
基金主代码	004000
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月23日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
最后运作日	2020年8月17日
最后运作日基金份额总额	6,427,676.48份
投资目标	通过现代风险模型技术进行基金风险预算，在严控本基金

	下行风险的前提下，灵活运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采取目标风险的投资策略，也就是通过优化投资过程，限制预期波动率，将风险维持在固定的低风险水平，从而实现风险约束下投资组合 alpha 的最大化，以便获得尽可能高回报。从长期来看，目标风险策略能够达到市场平均收益，在风控控制方面效果显著，从而提高风险调整后收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

二、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2016】2077号《关于准予泰达宏利睿选稳健灵活配置混合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12月26日起至2017年1月19日期间向社会公开发行募集，基金合同于2017年1月23日生效，募集规模为441,053,393.59份基金份额。自2017年1月23日至2020年8月17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《泰达宏利睿选稳健灵活配置混合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第十九部分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。”本基金基金资产净值自2020年5月22日起低于5000万元，截至2020年8月17日日终，已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

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《泰达宏利睿选稳健灵活配置混合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2020年8月18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：泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020年8月17日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日
	2020年8月17日
资产：	
银行存款	7,298,984.53
结算备付金	1,378,511.31
存出保证金	19,371.27
交易性金融资产	
其中：股票投资	
债券投资	
应收证券清算款	
应收利息	11,796.30
应收股利	
应收申购款	128,078.82
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	8,836,742.23
负债和所有者权益	最后运作日
	2020年8月17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	1,424,175.31
应付管理人报酬	18,272.54
应付托管费	3,045.42
应付销售服务费	
应交税费	
其他负债	134,740.83
负债合计	1,580,234.10
所有者权益：	
实收基金	6,427,676.48
未分配利润	828,831.65
所有者权益合计	7,256,508.13

负债和所有者权益总计	8,836,742.23
-------------------	---------------------

四、清算情况

自 2020 年 8 月 18 日至 2020 年 9 月 9 日止为本次清算期间，基金财产清算小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小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小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（2020 年 9 月 9 日），部分资产尚未收回。根据基金管理人 2020 年 8 月 18 日发布的《关于泰达宏利睿选稳健灵活配置混合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未到账的银行存款利息进行垫付。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 1,378,511.31 元，其中 1,089,463.69 已于 2020 年 9 月 2 日划入托管账户。剩余部分为加快清算速度，基金管理人将以自有资金垫付至托管账户。
- 2、 本基金最后运作日存出保证金为人民币 19,371.27 元，已于 2020 年 9 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 11,796.30 元，其中应收活期存款利息为 8,305.89 元、应收清算备付金利息为 3,426.17 元、应收保证金利息为 64.24 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。
- 4、 本基金最后运作日应收申购款为人民币 128,078.82 元，该款项根据具体清算时间分笔分批划入托管账户，并已于 2020 年 8 月 18 日全部划入托管账户。

（三）负债清偿情况

- 1、 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 1,424,175.31 元，该款项根据具体清算时间分笔分批进行支付，并已于 2020 年 8 月 18 日全部支付完毕。

2、 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 18,272.54 元，该款项已于 2020 年 8 月 26 日支付。

3、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,045.42 元，该款项已于 2020 年 8 月 26 日支付。

4、 本基金最后运作日其他负债为人民币 134,740.83 元，其中应付赎回费为人民币 16.11 元，已于 2020 年 8 月 18 日支付；应付佣金为人民币 14,816.28 元，已于 2020 年 8 月 26 日支付；应付审计费为人民币 37,703.90 元，已于 2020 年 8 月 26 日支付；应付中证报信息披露费为人民币 75,410.10 元，已于 2020 年 8 月 26 日支付。其他应付款包括预提中债上清账户维护费 6,200.00 元，已于 2020 年 8 月 21 日支付；预提 2020 年 8 月 1 日-2020 年 8 月 17 日银行汇划费 594.44 元，该款项已于 2020 年 9 月 7 日全部支付完毕。

(四) 本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2020 年 8 月 18 日至 2020 年 9 月 9 日止 清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	2,358.02
2、汇兑损益	
3、其他收入（注 2）	0.32
清算期间收入小计	2,358.34
二、清算期间费用	
清算期间费用小计（注 3）	20,242.01
三、清算期间净收益	-17,883.67

注：

- (1) 利息收入为自 2020 年 8 月 18 日至 2020 年 9 月 9 日止清算期间的银行存款、备付金、保证金、直销申购款利息收入。
- (2) 其他收入为赎回费收入。
- (3) 清算期间费用为银行汇划费、律师费。

(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 2020 年 8 月 17 日基金净资产	7,256,508.13

加：清算期间净收益	-17,883.67
加：基金申购金额（于 2020 年 8 月 18 日确认的投资者申购申请）	1,300.79
减：基金赎回金额（于 2020 年 8 月 18 日确认的投资者赎回申请）	435,550.72
二、2020 年 9 月 9 日基金净资产	6,804,374.53

截至本次清算期结束日 2020 年 9 月 9 日，本基金剩余财产为人民币 6,804,374.53 元。自本次清算期结束日次日 2020 年 9 月 10 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析。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海市通力律师事务所关于<泰达宏利睿选稳健灵活配置混合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

泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2020 年 9 月 9 日