

# 泰达宏利鑫利半年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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

清算报告出具日：2022年8月5日

清算报告公告日：2022年8月16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

泰达宏利鑫利半年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【2019】1081号予以注册，于2019年8月16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《泰达宏利鑫利半年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”）等有关规定：

“在任一开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据基金合同第二十部分的约定进行基金财产清算并终止：

（1）基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元；

（2）基金份额持有人人数少于 200 人。”

截止本开放期最后一日（即 2022 年 7 月 8 日）日终，本基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元，触发基金合同约定的前述终止条件，因此本基金根据基金合同约定进入基金财产清算程序，而不需召开基金份额持有人大会。

本基金于 2022 年 7 月 9 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、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、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	泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	泰达宏利鑫利债券 A/泰达宏利鑫利债券 C
基金代码	007641/007642
基金运作方式	本基金为契约型开放式，以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。

基金合同生效日	2019年8月16日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
最后运作日	2022年7月8日
最后运作日基金份额总额	4,110,024.80份
投资目标	在有效控制风险及保持流动性基础上，力求实现基金财产稳定的当期收益和长期增值的综合目标。
投资策略	<p>封闭期投资策略</p> <p>本基金不做积极主动的大类资产配置。对于债券投资组合构建，本基金管理人将充分发挥在研究能力方面的优势，进行积极主动式的管理，采用“自上而下”的方式结合基金管理人成功运用的MVPS模型辅助市场利率预期分析、信用分析、流动性分析和敏感性分析并获得债券类属价值判断和类属配置比例，同时，结合类属价值判断运用“自下而上”的定量及定性的方法对个券进行信用分析、久期及凸性分析、收益率分析、相对价值分析和税收因素分析，根据分析结果挑选出优质个券，最后根据类属配置比例构建债券投资组合。通过综合运用久期调整、凸度挖掘、信用分析、波动性交易、品质互换、回购套利等策略提高债券组合回报水平。</p> <p>开放期投资策略</p> <p>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，减少基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债新综合财富(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，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【2019】1081号《关于准予泰达宏利鑫利半年定期开放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2019年7月24日起至2019年8月14日期间向社会公开发行募集，基金合同于2019年8月16日生效，募集规模为447,669,612.04份基金份额。自2019年8月16日至2022年7月8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《泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金基金合同》等有关规定：

“在任一开放期的最后一日日终，如发生以下情形之一的，则无须召开基金份额持有人大会，本基金将根据基金合同第二十部分的约定进行基金财产清算并终止：

(1) 基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元；

(2) 基金份额持有人人数少于 200 人。”

截止本开放期最后一日（即 2022 年 7 月 8 日）日终，本基金资产净值加上当日有效申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除有效赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于 5000 万元，触发基金合同约定的前述终止条件。

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《泰达宏利鑫利半年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，无需召开基金份额持有人大会。本基金自 2022 年 7 月 9 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：泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 7 月 8 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日
	2022 年 7 月 8 日
<b>资产：</b>	
银行存款	9,626,917.38
结算备付金	306,972.97
存出保证金	8,575.77
应收申购款	11,791.21
<b>资产总计</b>	<b>9,954,257.33</b>
负债和所有者权益	最后运作日
	2022 年 7 月 8 日
<b>负债：</b>	
应付赎回款	5,403,443.71
应付管理人报酬	3,436.95

应付托管费	1,145.64
应付销售服务费	2,175.00
应交税费	25.46
其他负债	90,947.06
<b>负债合计</b>	<b>5,501,173.82</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	4,110,024.80
未分配利润	343,058.71
<b>所有者权益合计</b>	<b>4,453,083.51</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>9,954,257.33</b>

#### 四、清算情况

自 2022 年 7 月 9 日至 2022 年 8 月 5 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（2022 年 8 月 5 日），部分资产尚未收回。根据基金管理人 2022 年 7 月 9 日发布的《关于泰达宏利鑫利半年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未到账的结算备付金、应收利息进行垫付。各项资产清算情况如下：

- 1、 本基金最后运作日银行存款为人民币 9,626,917.38 元，其中应计利息为人民币 2,438.44 元。
- 2、 本基金最后运作日结算备付金为人民币 306,972.97 元，其中上海结算备付金为人民币 306,738.76 元，应计利息为人民币 234.21 元，部分上海结算备付金 282,651.87 元已于 2022 年 8 月 2 日划入托管账户。

3、 本基金最后运作日存出保证金为人民币 8,575.77 元，其中上海存出保证金为人民币 8,570.57 元，应计利息为人民币 5.20 元，上海存出保证金已于 2022 年 8 月 2 日划入托管账户。

4、 本基金最后运作日应收申购款为人民币 11,791.21 元，其中应收申购款利息为人民币 800.00 元，申购款已于 2022 年 7 月 11 日划入托管账户。

(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 5,403,443.71 元，该款项已于 2022 年 7 月 12 日支付完毕。

2、 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 3,436.95 元，该款项已于 2022 年 8 月 3 日支付。

3、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,145.64 元，该款项已于 2022 年 8 月 3 日支付。

4、 本基金最后运作日应付 C 类基金份额销售服务费为人民币 2,175.00 元，该款项已于 2022 年 8 月 3 日支付。

5、 本基金最后运作日其他负债为人民币 90,947.06 元，包括预提信息披露费、预提审计费、预提账户服务费、应付赎回费和应付交易费用。本基金最后运作日预提信息披露费为人民币 62,137.53 元，该款项已于 2022 年 7 月 21 日支付；本基金最后运作日预提审计费为人民币 15,533.91 元，该款项已于 2022 年 7 月 21 日支付；本基金最后运作日预提账户服务费为人民币 12,000.00 元，该款项已于 2022 年 7 月 14 日支付；本基金最后运作日应付赎回费为人民币 0.62 元，该款项已于 2022 年 7 月 12 日支付；本基金最后运作日应付交易费用为人民币 1,275.00 元，该款项已于 2022 年 7 月 14 日、2022 年 7 月 18 日支付完毕。

(四) 本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2022 年 7 月 8 至 2022 年 8 月 5 日止清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	3,012.83
3、其他收入（注 2）	0.11
清算期间收入小计	3,012.94

二、清算期间费用	
1、律师费	-20,000.00
2、其他费用（注3）	-400.00
清算期间费用小计	<b>-20,400.00</b>
三、清算期间净收益	<b>-17,387.06</b>

注：

- (1) 利息收入为自 2022 年 7 月 9 日至 2022 年 8 月 5 日止清算期间的银行存款、结算备付金、保证金利息收入。
- (2) 其他收入为赎回费收入。
- (3) 其他费用为上交所账户查询费。

(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 2022 年 7 月 8 日基金净资产	4,453,083.51
加：清算期间净收益	<b>-17,387.06</b>
减：基金赎回金额（于 2022 年 7 月 11 日确认的投资者赎回申请）	42,836.04
二、2022 年 8 月 5 日基金净资产	<b>4,392,860.41</b>

截至本次清算期结束日 2022 年 8 月 5 日，本基金剩余财产为人民币 4,392,860.41 元。自本次清算期结束日次日 2022 年 8 月 6 日至本次清算款划出前一日的银行存款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、《泰达宏利鑫利半年定期开放债券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<泰达宏利鑫利半年定期开放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

泰达宏利鑫利半年定期开放债券型证券投资基金

基金财产清算小组

2022年8月5日