

泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

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12月27日

清算报告公告日：2019年3月5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.....	6
五、备查文件.....	9

重要提示

泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)由泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金转型而来,泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资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[2014]1416号予以注册,于2015年11月17日成立并正式运作。

根据《泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或基金合同)第五部分“基金的存续”、第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中约定:“基金合同生效满3年当日,基金资产净值低于两亿元的,本基金合同应当终止。基金合同生效之日起3年后,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,并按照本基金合同约定的程序进行清算,而无需召开基金份额持有人大会。”

本基金基金合同生效日为2015年11月17日,基金合同生效满三年之日为2018年11月17日,由于该日为非交易日不进行基金估值,为保证估值公允以准确计算基金规模,故顺延至2018年11月19日。截至2018年11月19日日终,本基金的基金资产净值低于2亿元,触发基金合同终止条款,本基金最后运作日为2018年11月30日。

本基金于2018年12月1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	泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金
基金简称	泰达宏利绝对混合

基金主代码	001896
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月17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11月30日
最后运作日基金份额总额	22,361,805.70份
投资目标	灵活运用多种绝对收益策略，对冲各类系统性风险，力争为投资者实现稳定的投资收益
投资策略	本基金采用以市场中性投资策略为主以其他多种 Alpha 策略为辅构建多策略组合的多种绝对收益策略，通过利用股指期货和其他多种衍生品工具剥离系统性风险，力争实现稳定的绝对回报
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率+2%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益

二、基金运作情况

泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金经中国证监会证监许可[2014]1416号《关于准予泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》予以注册，由泰达宏利基金管理有限公司自2015年10月19日起至2015年11月13日止向社会公开发行募集，基金合同于2015年11月17日正式生效，募集规模为619,825,426.51份基金份额。截至2018年10月23日，在《泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》生效满3年当日的前60天内连续20个工作日基金资产净值低于2亿元，触发《泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》约定的转型条款，泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金转换为开放式基金，基金名称更名为泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金。自2015年11月17日至2018年11月30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

《泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金合同》第五部分“基金的存续”、第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中约定：“基金合同生效满 3 年当日，基金资产净值低于两亿元的，本基金合同应当终止。基金合同生效之日起 3 年后，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，并按照本基金合同约定的程序进行清算，而无需召开基金份额持有人大会。”。本基金于 2018 年 11 月 19 日日终资产净值为 36,339,961.71 元，基金资产净值低于 2 亿元，从而触发基金合同终止条款。

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《泰达宏利绝对收益策略混合型发起式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 12 月 1 日起进入清算期。

三、财务会计报告

（一）基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金
报告截止日：2018 年 11 月 30 日

单位：人民币元

	最后运作日 2018 年 11 月 30 日
资 产：	
银行存款	23,249,894.39
结算备付金	344,444.44
存出保证金	24,174.48
交易性金融资产	261,201.60
其中：股票投资	261,201.60
应收利息	64,267.10
资产合计：	23,943,982.01
负 债：	
应付证券清算款	612.71
应付赎回款	2,230,304.42
应付管理人报酬	29,739.94
应付托管费	7,434.98
应付交易费用	12,987.40

其他负债	93,339.64
负债合计	2,374,419.09
所有者权益：	
实收基金	22,361,805.70
未分配利润	-792,242.78
所有者权益合计	21,569,562.92
负债与持有人权益总计：	23,943,982.01

四、清算情况

自 2018 年 12 月 1 日至 2018 年 12 月 27 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（2018 年 12 月 27 日），部分资产尚未收回。根据基金管理人 2018 年 12 月 1 日发布的《关于泰达宏利绝对收益策略混合型发起式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，基金管理人可以使用自有资金对最低结算备付金、交易席位保证金、清算期间产生的应收利息进行垫付。各项资产清算情况如下：

- 1、 本基金最后运作日结算备付金为人民币 344,444.44 元，该款项已于 2018 年 12 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 24,174.48 元，该款项已于 2018 年 12 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 64,267.10 元。其中应收活期银行存款利息为人民币 35,499.79 元，应收备付金利息为人民币 28,701.33 元，应收保证金利息

为人民币 65.98 元, 应收期货保证金利息 27,736.27 元, 该款项已于 2018 年 12 月 21 日划入托管账户。

4、 本基金最后运作日持有的股票资产为人民币 261,201.60 元, 该金额为已复牌但交易不活跃股票 300324 旋极信息最后运作日估值金额。具体情况如下:

1) 本基金最后运昨日 (2018 年 11 月 30 日) 持有的股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	股票数量 (股)	期末估值单价 (人民币元)	最后运作日估 值金额 (人民币元)	备注
1	300324	旋极信息	36,278	7.20	261,201.60	指数收益法估值
合计					261,201.60	

2) 本次清算期间 (2018 年 12 月 1 日至 2018 年 12 月 27 日) 股票处置情况:

本基金持有的 300324 旋极信息于 2018 年 12 月 3 日卖出, 变现所得金额为人民币 250,770.45 元

(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 29,739.94 元, 该款项已于 2018 年 12 月 5 日支付。
- 2、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 7,434.98 元, 该款项已于 2018 年 12 月 5 日支付。
- 3、 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,230,304.42 元, 该款项分别于 2018 年 12 月 3 日和 2018 年 12 月 4 日支付。
- 4、 本基金最后运作日应付清算款为人民币 612.71 元, 该款项已于 2018 年 12 月 3 日支付。
- 5、 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 12,987.40 元, 全部为应付席位佣金费用, 该款项已于 2018 年 12 月 5 日支付。
- 6、 本基金最后运作日其他负债为人民币 93,339.64 元, 包括应付信息披露费、预提审计费。本基金最后运作日应付信息披露费为人民币 27,454.80 元, 该款项已于 2018 年 12 月 25 日支付; 本基金最后运作日预提审计费为预提的审计费, 金额为人民币 65,884.84 元, 该款项已于 2018 年 12 月 24 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 12 月 1 日至 2018 年 12 月 27 日止清算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	11,260.50
2、股票变现损益（注 2）	-10,328.32
清算期间收入小计	932.18
二、清算期间费用	
清算期间费用小计（注 3）	641.15
三、清算期间净收益	291.03

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 12 月 1 日至 2018 年 12 月 27 日清算期间的银行存款、备付金及保证金利息。
- 2、股票变现损益为本次清算期间卖出股票金额与其最后运作日估值金额的差额。
- 3、本次清算期间费用为银行汇划费、交易费用等。

(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 11 月 30 日基金净资产	21,569,562.92
加：清算期间净收益	291.03
减：基金净赎回金额（于 2018 年 12 月 3 日确认的投资者赎回申请）	1,221,249.35
二、2018 年 12 月 27 日基金净资产	20,348,604.60

截至本次清算期结束日 2018 年 12 月 27 日，本基金剩余财产为人民币 20,348,604.60 元。自本次清算期结束日次日 2018 年 12 月 28 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析。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、 《泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、 《通力律师事务所关于〈泰达宏利绝对收益策略混合型发起式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。

泰达宏利绝对收益策略混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2018年12月27日