

# 泰达宏利年年添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：中国光大银行股份有限公司

清算报告出具日：2020年4月23日

清算报告公告日：2020年5月8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

泰达宏利年年添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【2018】1866号予以注册，于2019年1月31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《泰达宏利年年添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”）等有关规定“本基金自基金合同生效之日起，在任一开放期最后一日日终，如发生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，则本基金根据《基金合同》的约定将于该日的次日进入基金财产的清算程序并终止，无须召开基金份额持有人大会审议”。至2020年2月28日日终，本基金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。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2月29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、基金托管人中国光大银行股份有限公司、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	泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金
基金简称	泰达宏利添利债券
基金主代码	006690/0066901
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年1月31日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
最后运作日	2020年2月28日

最后运作日基金份额总额	373,929.58 份	
投资目标	在严格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>封闭期内，本基金以债券投资为主，最低投资比例为 80%，股票等权益类资产投资比例最高为 20%。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，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；本组合在股票投资方面，采取以较低仓位的股票战略性投资和应对系统性风险的小幅仓位战术调整相结合的策略。在选股策略上，基于二级债基相对保守的风险属性，该基金重点配置盈利能力较稳定的蓝筹公司，并采用相对透明的策略指数形式来执行。</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-综合财富（1-3 年）指数收益率×90%+中证全指指数收益率×10%	
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。	
下属分级基金的基金简称：	泰达宏利添利债券 A	泰达宏利添利债券 C
下属分级基金的交易代码：	006690	006691
最后运作日下属分级基金的份额总额	125,836.27 份	248,093.31 份

## 二、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2018】1866号《关于准予泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金募集的批复》注册，由泰达宏利基金管理有限公司于自2019年1月2日至2019年1月29日向社会公开发行募集，基金合同于2019年1月31日生效，募集规模为200,833,286.22份基金份额。自2019年1月31日至2020年2月28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《泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基

金基金合同》等有关规定“本基金自基金合同生效之日起，在任一开放期最后一日日终，如发生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，则本基金根据《基金合同》的约定将于该日的次日进入基金财产的清算程序并终止，无须召开基金份额持有人大会审议”。至 2020 年 2 月 28 日日终，本基金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。

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《泰达宏利年年添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，无需召开基金份额持有人大会。本基金自 2020 年 2 月 29 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：泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 2 月 28 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2020 年 2 月 28 日
<b>资产：</b>	
银行存款	2,206,576.30
结算备付金	1,171,346.67
存出保证金	14,976.40
交易性金融资产	
其中：股票投资	
债券投资	
应收利息	17,415.71
应收申购款	21,509.99
资产总计	3,431,825.07
<b>负债：</b>	
应付赎回款	316,483.07
应付管理人报酬	58,087.62

应付托管费	9,681.29
应付销售服务费	2,029.11
应付税费	2,272.92
其他负债	2,654,098.20
负债合计	3,042,652.21
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	373,929.58
未分配利润	15,243.28
所有者权益合计	389,172.86
负债和所有者权益总计	3,431,825.07

#### 四、清算情况

自2020年2月29日至2020年4月23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4月23日），部分资产尚未收回。根据基金管理人2020年2月29日发布的《关于泰达宏利年年添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未到账的银行存款利息和最低备份金利息进行垫付。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1,171,346.67元，该款项已于2020年3月3日和2020年4月2日分次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14,976.40元，该款项已于2020年3月3日划入托管账户。

3、 本基金最后运作日应收利息为人民币 17,415.71 元，其中应收活期存款利息为人民币 9,563.12 元、应收结算备付金利息为人民币 7,818.13 元、应收保证金利息为人民币 34.46 元。以上应收款项已于 2020 年 3 月 21 日并划入托管账户。

4、 本基金最后运作日应收申购款为人民币 21,509.99 元，该款项已于 2020 年 3 月 2 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管理人报酬为人民币 58,087.62 元，该款项已于 2020 年 3 月 4 日支付。

2、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 9,681.29 元，该款项已于 2020 年 3 月 4 日支付。

3、 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 316,483.07 元，该款项分别于 2020 年 3 月 2 日支付。

4、 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 2,029.11 元，该款项已于 2020 年 3 月 4 日支付。

5、 本基金最后运作日应付税费为人民币 2,272.92 元，该款项为应付增值税及其附加，该款项已于 2020 年 3 月 6 日支付。

6、 本基金最后运作日其他负债为人民币 2,654,098.20 元，其中应付审计费为人民币 68,032.57 元（2019 年应付审计费 60,000.00 元，2020 年应付审计费 8,032.57 元），该款项已于 2020 年 3 月 25 日支付；其中应付上海证券报信息披露费 86,065.63 元

（2019 年应付信息披露费 70,000 元，该款项已于 2020 年 3 月 20 日支付；2020 年应付信息披露费 16,065.63 元，该款项已于 2020 年 3 月 25 日支付）；另外 2,500,000.00 元为基金管理人以自有资金对最低结算备付金、交易席位保证金以及应收利息等垫付款

项，该款项已于 2020 年 4 月 2 日本基金各款项收回后归还管理人。

(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 2 月 29 日至 2020 年 4 月 23 日止清算 期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	4,468.58
2、变现损益	
3、其他收入	

清算期间收入小计	4,468.58
二、清算期间费用	0.00
清算期间费用小计	0.00
三、清算期间净收益	4,468.58

注：

(1) 利息收入系自 2020 年 2 月 29 日至 2020 年 4 月 23 日止清算期间的银行存款、备付金、保证金利息收入。

(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 2 月 28 日基金净资产	389,172.86
加：清算期间净收益	4,468.58
加：基金净申购金额	9,559.21
二、2020 年 4 月 23 日基金净资产	403,200.65

截至本次清算期结束日 2020 年 4 月 23 日，本基金剩余财产为人民币 403,200.65 元。自本次清算期结束日次日 2020 年 4 月 24 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、《泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《通力律师事务所关于<泰达宏利年年添利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

泰达宏利年年添利定期开放债券型证券投资基金财产清算小组

2020年4月23日