

泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金

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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年12月13日

清算报告公告日：2019年12月27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

泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金（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【2017】299号予以注册，于2017年5月17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《泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）等有关规定，“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。”至2019年11月28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2019年11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	泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金
基金简称	泰达宏利港股通股票
基金主代码	A类基金份额：004482，C类基金份额 004483
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年5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	2019年11月28日
最后运作日基金份额总额	8,821,320.30
投资目标	在严格控制风险的前提下，把握港股通及后续资本市场开放政策带来的机会，挖掘港股及A股市场的优质公司，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。

投资策略	本基金将通过全球宏观经济发展态势、区域经济发展情况、微观经济运行环境等可能影响内地及香港证券市场的重要因素的研究和预测，利用数量模型工具，分析和比较股票、货币市场工具等不同金融工具的风险收益特征，并以此为依据，对基金整体资产配置比例进行确定。同时，本基金将定期，或由于宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例调整，以保持基金资产配置的有效性。
业绩比较基准	恒生指数收益率（经人民币汇率调整）×95%+人民币活期存款利率×5%。
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的产品。</p> <p>本基金将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。</p>

二、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2017】299号《关于准予泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金注册的批复》准予注册募集，由泰达宏利基金管理有限公司于2017年4月10日起至2017年5月12日向社会公开发行募集，基金合同于2017年5月17日生效，募集规模为263,803,179.74份基金份额（含募集期间利息结转的份额）。自2017年5月17日至2019年11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《泰达宏利港股通优选股票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，连续60个工作日，基金资产净值低于5000万元，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。”至2019年11月28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《泰达宏利港股通优选股票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2019年11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：泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金

报告截止日：2019年11月28日

单位：人民币元

	最后运作日 2019年11月28日
资产：	
银行存款	1,373,993.45
结算备付金	3,965,406.17
存出保证金	1,267,037.68
交易性金融资产	3,991,818.95
其中：股票投资	3,991,818.95
应收证券清算款	6,677,520.82
应收利息	3,237.50
应收股利	12,249.60
应收申购款	3,116.15
资产总计	17,294,380.32
负债：	
应付赎回款	6,797,882.87
应付管理人报酬	24,418.25
应付托管费	4,069.70
应付销售服务费	1,253.57
应付交易费用	19,791.00
其他负债	100,597.12
负债合计	6,948,012.51
所有者权益：	
实收基金	8,821,320.30
未分配利润	1,525,047.51
所有者权益合计	10,346,367.81
负债和所有者权益总计	17,294,380.32

四、清算情况

自 2019 年 11 月 29 日至 2019 年 12 月 13 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，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（2019 年 12 月 13 日），部分资产尚未收回。根据基金管理人 2019 年 11 月 29 日发布的《关于泰达宏利港股通优选股票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该部分资产进行垫付。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 3,965,406.17 元，已于 2019 年 12 月 4 日划入托管账户。
- 2、 本基金最后运作日存出保证金为人民币 1,267,037.68 元，已于 2019 年 12 月 4 日划入托管账户。
- 3、 本基金最后运作日持有非停牌股票资产为人民币 3,991,818.95 元，该资产已于清算期间全部卖出，变现所得金额共计人民币 3,893,188.73 元；
- 4、 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 6,677,520.82 元，已于 2019 年 12 月 3 日划入托管账户。
- 5、 本基金最后运作日应收利息为人民币 3,237.50 元。其中应收活期银行存款利息为人民币 2,403.89 元，应收备付金利息为人民币 833.61 元。如本次清算款划出前未到账，基金管理人将以自有资金垫付至托管账户。

6、 本基金最后运作日应收股利为人民币 12,249.60 元。其中 7,152.00 元已于 2019 年 12 月 4 日划入托管账户。剩余部分如本次清算款划出前未到账，基金管理人将以自有资金垫付至托管账户。

7、 本基金最后运作日应收申购款为人民币 3,116.15 元。已于 2019 年 12 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赎回款为人民币 6,797,882.87 元，该款项已于 2019 年 12 月 4 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 24,418.25 元，该款项已于 2019 年 12 月 4 日支付。

3、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 4,069.70 元，该款项已于 2019 年 12 月 4 日支付。

4、 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,253.57 元，该款项已于 2019 年 12 月 4 日支付。

5、 本基金最后运作日交易费用为人民币 19,791.00 元，该款项已于 2019 年 12 月 10 日支付。

6、 本基金最后运作日其他负债为人民币 100,597.12 元，包括预提信息披露费、预提审计费和应付赎回费。本基金最后运作日预提信息披露费为人民币 45,357.40 元，该款项已于 2019 年 12 月 12 日支付；本基金最后运作日预提审计费为人民币 54,574.16 元，该款项已于 2019 年 12 月 12 日支付；本基金最后运作日应付赎回费为人民币 665.56 元，该款项已于 2019 年 12 月 4 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 2019 年 11 月 29 日至 2019 年 12 月 13 日止清 算期间
一、清算期间收益	
1、利息收入（注 1）	3,023.54
2、变现损益（注 2）	-94,297.30

3、其他收入（注3）	514.84
清算期间收入小计	-90,758.92
二、清算期间费用	
清算期间费用小计（注4）	7,684.40
三、清算期间净收益	-98,443.32

表中相关项目具体说明如下：

1、利息收入系自 2019 年 11 月 29 日至 2019 年 12 月 13 日止清算期间的银行存款、备付金利息收入。

2、变现损益为本次清算期间股票资产变现成交金额与最后运作日估值金额相减的差额。

3、其他收入为赎回费收入。

4、清算期间费用为银行汇划费、交易费用。

（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 2019 年 11 月 28 日基金净资产	10,346,367.81
加：清算期间净收益	-98,443.32
减：基金净赎回金额	743,553.06
二、2019 年 12 月 13 日基金净资产	9,504,371.43

截至本次清算期结束日 2019 年 12 月 13 日，本基金剩余财产为人民币 9,504,371.43 元。自本次清算期结束日次日 2019 年 12 月 14 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、《泰达宏利港股通优选股票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〈泰达宏利港股通优选股票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。

泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金财产清算小组

2019年12月13日