

天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

清算报告出具日：二〇一八年七月二十六日

清算报告公告日：二〇一八年九月二十一日

一、重要提示

天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金(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[2015]1331 号《关于准予天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")负责公开募集。经向中国证监会备案,本基金《基金合同》于 2015 年 7 月 16 日正式生效。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为广发证券股份有限公司。

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》、《基金合同》,基金合同生效满三年之日(指自然日),若基金规模低于 2 亿元的,基金合同应当终止,无需召开基金份额持有人大会审议决定即可按照基金合同约定的程序进行清算,并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。本基金基金合同生效日为 2015 年 7 月 16 日,基金合同生效满三年之日为 2018 年 7 月 16 日。截至 2018 年 7 月 16 日日终,本基金的基金规模低于 2 亿元,已触发上述《基金合同》约定的自动终止情形。本基金触发基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的安排详见 2018 年 7 月 17 日刊登在指定媒介的《关于天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》。

本基金从 2018 年 7 月 17 日起进入清算期,由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人广发证券股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市通力律师事务所于 2018 年 7 月 17 日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。

二、基金概况

- 1、基金名称：天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金
(基金简称：天弘中证 100, A 类基金份额：001586, C 类基金份额：001587)
- 2、基金运作方式：契约型开放式、发起式
- 3、基金合同生效日：2015 年 7 月 16 日
- 4、最后运作日 2018 年 7 月 16 日, 基金份额总额：26,074,578.70 份。
- 5、投资目标：紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化, 实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
- 6、投资策略：本基金采用完全复制标的指数的方法, 进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数, 并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整, 以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下, 力争获取与标的指数相似的投资收益。

7、业绩比较基准：中证 100 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

8、风险收益特征：本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

9、基金管理人：天弘基金管理有限公司

10、基金托管人：广发证券股份有限公司

三、基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2015]1331号《关于准予天弘中证100指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金，存续期限不定，首次募集期间为自2015年7月15日至2015年7月15日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第958号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金《基金合同》于2015年7月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

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》、《基金合同》的有关规定，基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于2亿元的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定即可按照基金合同约定的程序进行清算，并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。本基金基金合同生效日为2015年7月16日，基金合同生效满三年之日为2018年7月16日。截至2018年7月16日日终，本基金的基金规模低于2亿元，已触发上述《基金合同》约定的自动终止情形。本基金从2018年7月17日起进入清算期，由基金管理人天弘基金管理有限公司、基金托管人广发证券股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于2018年7月17日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。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

会计主体：天弘中证100指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年7月16日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2018 年 7 月 16 日
资产：	
银行存款	4,219,193.33
结算备付金	30,973.41
存出保证金	58,765.28
交易性金融资产	24,124,306.25
其中：股票投资	24,124,306.25
基金投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	904,242.56
应收利息	1,928.48
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	29,339,409.31
负债和所有者权益	最后运作日2018年7月16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	3,605,955.07
应付管理人报酬	6,878.41
应付托管费	1,375.68
应付销售服务费	2,066.81
应付交易费用	2,491.99

应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	87,264.80
负债合计	3,706,032.76
所有者权益：	
实收基金	26,074,578.70
未分配利润	-441,202.15
所有者权益合计	25,633,376.55
负债和所有者权益总计	29,339,409.31

注： 1、报告截止日 2018 年 7 月 16 日(基金最后运作日)，基金份额净值 0.9831 元，基金份额总额 26,074,578.70 份。

2、本财务报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师薛竞、周祎签字出具了普华永道中天特审字（2018）第 2354 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

1、清算费用

按照《天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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。

2、本基金的最后运作日为 2018 年 7 月 16 日，基金份额持有人可在此日将持有到期的基金份额进行赎回，基金管理人在 2018 年 7 月 17 日对其所申请的赎回份额进行确认并在 2018 年 7 月 18 日和 19 日支付，具体支付金额如下：

单位：人民币元

项目	金额	时间备注
一、最后运作日2018年7月16日基金净资产	25,633,376.55	
减：基金净赎回金额	4,923,880.00	2018年7月18、19日支付
二、2018年7月17日基金净资产	20,558,896.65	其中当日计提银行存款利息56.99元，计提备付金利息1.40元，计提保证金

		利息2.65元；当日卖出股票投资收益-772,952.83元，股利收入28,342.01元，未变现股票的公允价值变动损益601,167.00元；当日卖出股票计提交易费用7217.12元。
--	--	---

3、停止运作后的清算损益情况说明

截至最后运作日（2018年7月16日）止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币4,219,193.33元，备付金30,973.41元，保证金58,765.28元，交易性金融资产24,124,306.25元，应收利息1,928.48元，证券清算款904,242.56元，应付赎回款、管理费、托管费、销售服务费、交易费用、指数使用费、预提费用（信息披露费用、审计费用）等负债3,706,032.76元，基金净资产25,633,376.55元。其中应收利息将于9月末结息变现，此后新产生的利息将在销户结息时变现；交易性金融资产24,124,306.25元，该金额为股票资产的最后运作日估值金额之和，其中，流通股股票资产估值金额为23,391,571.88元，停牌股票资产估值金额为732,734.37元，具体如下：

单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	10.64	-	-	4,530	74,402.45	48,199.20	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项	37.96			1,100	77,361.61	41,756	
002252	上海莱士	2018-02-23	重大资产重组	19.52			7,144	144,380.60	139,450.88	
601390	中国中铁	2018-05-07	重大资产重组	7.47			40,207	336,629.92	300,346.29	
002450	康德新	2018-06-04	重大事项	17.08			4,300	83,804.00	73,444.00	
601727	上海电气	2018-06-06	重大事项	5.42	-	-	23,900	146,326.89	129,538.00	-

对于尚未变现的股票资产，待基金管理人将上述股票资产卖出变现后，以卖出股票资产的变现金额划付给基金份额持有人，届时请关注基金管理人相关公告。

截至清算报告公告前日（2018年9月20日），本基金持有的股票“中国中铁”、“上海电气”已卖出变现。

考虑到本基金清算的实际情况，在清算期间产生的律师事务所律师费等其他清算费用，均由基金管理人承担，具体金额以缴费通知为准。

本基金的银行存款应收利息均为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中各项利息及费用与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

4、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金 2018 年 7 月 16 日资产负债表及审计报告

(2) 通力律师事务所关于《天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金财产清算小组
二〇一八年七月二十六日