

泰康中证港股通非银行金融主题指数型 发起式证券投资基金清算报告

2022年1月17日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

公告日期：2022年1月26日

一、重要提示及目录

1、重要提示

泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2018 年 10 月 17 日获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】1644 号文准予募集注册，自 2018 年 12 月 21 日起《泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）生效，本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中的约定：“基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且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 2018 年 12 月 21 日，《基金合同》生效之日起三年后的对应日为 2021 年 12 月 21 日。截至 2021 年 12 月 21 日，本基金出现上述触发《基金合同》终止的情形（即基金资产净值低于 2 亿元）。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，应终止基金合同并进行基金财产清算，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人于 2021 年 12 月 22 日发布了《泰康资产管理有限责任公司关于泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金自 2021 年 12 月 22 日起进入清算期。由基金管理人泰康资产管理有限责任公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于 2021 年 12 月 22 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。

| | |
|------------------------|----------|
| 2、目录 | |
| 一、重要提示及目录 | 2 |
| 1、重要提示 | 2 |
| 2、目录 | 3 |
| 二、基金概况 | 4 |
| 三、清盘事项说明 | 5 |
| 1、基本情况 | 5 |
| 2、清算原因 | 5 |
| 3、清算起始日 | 5 |
| 4、清算报表编制基础 | 5 |
| 四、财务会计报告 | 6 |
| 五、清算情况 | 7 |
| 1、清算费用 | 7 |
| 2、资产处置情况 | 7 |
| 3、负债清偿情况 | 7 |
| 4、清算期间的清算损益情况 | 8 |
| 5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况 | 8 |
| 6、基金财产清算报告的告知安排 | 9 |
| 六、备查文件目录 | 9 |
| 1、备查文件目录 | 9 |
| 2、存放地点 | 9 |
| 3、查阅方式 | 9 |

二、基金概况

| | | |
|--------------------------|--|---------------|
| 基金名称 | 泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 泰康中证港股通非银指数 A | 泰康中证港股通非银指数 C |
| 基金代码 | 006578 | 006579 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018年12月21日 | |
| 基金管理人名称 | 泰康资产管理有限责任公司 | |
| 基金托管人名称 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 2021年12月21日(最后运作日)基金份额总额 | 54,851,369.30 份 其中,泰康中证港股通非银指数 A 为 30,485,521.75 份;泰康中证港股通非银指数 C 为 24,365,847.55 份 | |
| 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。 | |
| 业绩比较基准 | 中证港股通非银行金融主题指数收益率(使用估值汇率折算)*95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5% | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金,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。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p> <p>本基金主要投资香港证券市场,需承担汇率风险以及境外市场的风险。</p> | |

三、清盘事项说明

1、基本情况

本基金于 2018 年 10 月 17 日获中国证监会证监许可【2018】1644 号文准予募集注册，由基金管理人泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和本基金《基金合同》于 2018 年 11 月 26 日至 2018 年 12 月 19 日向社会公开募集，本基金《基金合同》于 2018 年 12 月 21 日正式生效，《基金合同》生效日的基金份额（含利息结转的份额）的总数为 25,765,173.34 份，有效认购户数为 531 户。自 2018 年 12 月 21 日至 2021 年 12 月 21 日期间，本基金按照《基金合同》约定正常运作。

2、清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”中的约定：“基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且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 2018 年 12 月 21 日，《基金合同》生效之日起三年后的对应日为 2021 年 12 月 21 日。截至 2021 年 12 月 21 日，本基金出现上述触发《基金合同》终止的情形（即基金资产净值低于 2 亿元）。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，应终止基金合同并进行基金财产清算，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人于 2021 年 12 月 22 日发布了《泰康资产管理有限责任公司关于泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

3、清算起始日

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，本基金于 2021 年 12 月 21 日日终触发了《基金合同》规定的终止情形，本基金自 2021 年 12 月 22 日起进入清算期。

4、清算报表编制基础

本基金的清算报告是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。本基金自最后运作日起，资产负债按实际清算价格计价。

四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年12月21日

单位：人民币元

| 项目 | 基金最后运作日 2021年12月21日 |
|---------------|---------------------|
| 资产： | |
| 银行存款 | 4,305,916.30 |
| 结算备付金 | 1,506,741.29 |
| 存出保证金 | 130,791.88 |
| 交易性金融资产 | 48,431,733.37 |
| ——股票投资 | 48,431,733.37 |
| 应收证券清算款 | 14,164,477.86 |
| 应收利息 | 109.66 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | 145,519.64 |
| 资产总计 | 68,685,290.00 |
| 负债： | |
| 应付赎回款 | 11,865,124.13 |
| 应付管理人报酬 | 21,384.09 |
| 应付托管费 | 4,276.83 |
| 应付销售服务费 | 7,788.11 |
| 应付交易费用 | 14,120.10 |
| 应付利润 | - |
| 其他负债 | 149,832.62 |
| 负债合计 | 12,062,525.88 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 54,851,369.30 |
| 未分配利润 | 1,771,394.82 |
| 所有者权益合计 | 56,622,764.12 |
| 负债和所有者权益总计 | 68,685,290.00 |

注：报告截止日 2021 年 12 月 21 日（基金最后运作日），泰康港股通非银指数 A 基金份额净值 1.0372 元，基金份额总额 30,485,521.75 份；泰康港股通非银指数 C 基金份额净值 1.0261 元，基金份额总额 24,365,847.55 份。基金份额总额合计为 54,851,369.30 份。

五、清算情况

自 2021 年 12 月 22 日至 2022 年 1 月 17 日止为清算期间，本基金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算按清算原则和清算手续进行，具体情况如下：

1、清算费用

根据《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、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金人民币 1,506,741.29 元，存出保证金人民币 130,791.88 元，该款项已于 2022 年 1 月 17 日（清算结束日）前转入托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收活期存款利息人民币 41.86 元、应收清算备付金利息人民币 67.80 元，共计 109.66 元。未结息部分将由基金管理人泰康资产管理有限责任公司在基金财产分配划付日前以自有资金垫付至托管户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 14,164,477.86 元，该款项已于 2022 年 1 月 17 日（清算结束日）前划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收申购款人民币 145,519.64 元，该款项已于 2022 年 1 月 17 日（清算结束日）前划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日持有的股票资产为人民币 48,431,733.37 元，均为股票投资，截至 2022 年 1 月 17 日（清算结束日）已全部处置并划入托管户。

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 11,865,124.13 元，应付管理人报酬为人民币 21,384.09 元，应付托管费为人民币 4,276.83 元，应付销售服务费为人民币 7,788.11 元，应付交易费用为人民币 14,120.10 元，上述款项已于清算期内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币 149,832.62 元，其中：应付赎回费人民币 1,994.78 元，预提信息披露费人民币 80,000.00 元，上述款项已于清算期内支付；应付指数使用费 13,837.84 元，其中 10,000.00 元已于清算期内支付，剩余款项截至 2022 年 1 月 17 日（清算结束日）尚未支付；预提审计费人民币 29,000.00 元，应付律师费人民币 25,000.00 元并已于 2022 年 1 月 11 日冲回 5,000 元，上述款项截至 2022 年 1 月 17 日（清算结束日）尚未支

付。

4、清算期间的清算损益情况

| 项目 | 2021年12月22日至2022年1月17日（清算期间） |
|-----------------------------|------------------------------|
| 一、清算期间收入 | |
| 1、存款利息收入（注1） | 13,336.12 |
| 2、公允价值变动（清算损失以“-”表示） | 9,092,515.56 |
| 3、投资收益（清算损失以“-”表示） | -9,060,956.33 |
| 4、其他收入 | 296.28 |
| 清算期间收入小计 | 45,191.63 |
| 二、清算期间费用 | |
| 1、银行手续费 | 375.35 |
| 2、交易费用 | 95,521.59 |
| 3、其他费用（注2） | -5,000.00 |
| 清算期间费用小计 | 90,896.94 |
| 三、清算净收益（清算净损失以“-”表示） | -45,705.31 |

注1：存款利息收入为活期存款利息、清算备付金利息和存出保证金利息。

注2：其他费用为律师费用实际应支付金额与账面已计提金额回冲差额部分。

5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况

单位：人民币元

| 项目 | 金额 |
|-----------------------------------|---------------|
| 一、最后运作日2021年12月21日基金净资产 | 56,622,764.12 |
| 加：清算期间（2021年12月22日至2022年1月17日）净收益 | -45,705.31 |
| 减：2021年12月22日确认的赎回转出款（含费用） | 1,210,034.02 |
| 二、清算终止日2022年1月17日基金净资产 | 55,367,024.79 |

根据本基金《基金合同》相关约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配；基金合同终止日是指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期。

清算终止日2022年1月17日次日至清算款划出日前一日的银行存款及存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快基金清算速度，基金管理人将在清算款划出日前垫付应收利息（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人，基金财产清

偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

6、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，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式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《泰康中证港股通非银行金融主题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。

泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2022年1月26日