

九泰久元量化股票型证券投资基金 清算报告

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二二年 三 月十一日

报告公告日期：二〇二二年 三 月十六日

目录

1、重要提示	1
1.1 重要提示.....	1
2、基金概况	2
2.1 基金基本情况	2
2.2 基金产品说明.....	2
3、基金运作情况说明	3
4、财务报告（经审计）	3
4.1 清算资产负债表.....	3
4.2 清算损益表.....	4
4.3 报表附注	5
5、清算情况	8
5.1 清算费用.....	9
5.2 资产处置情况.....	9
5.3 负债清偿情况.....	9
5.4 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排.....	9
6、备查文件目录	10
6.1 备查文件目录.....	10
6.2 存放地点.....	10
6.3 查阅方式.....	11

1、重要提示

1.1 重要提示

九泰久元量化股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)是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[2020] 3306 号文《关于准予九泰久元量化股票型证券投资基金注册的批复》准予募集注册。由九泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关规定和《九泰久元量化股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“本基金合同”)发起,于2020年12月23日起至2021年1月22日止向社会公开募集。本基金的基金管理人为九泰基金管理有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司,注册登记机构为九泰基金管理有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条规定,“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成,行使下列职权:(二)决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”;第八十条规定,“有下列情形之一的,基金合同终止:(二)基金份额持有人大会决定终止”。根据基金合同“第八部分基金份额持有人大会”第一条规定:“当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会,但法律法规、中国证监会另有规定及基金合同另有约定的除外:(1)终止基金合同”;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”第二条规定:“有下列情形之一的,经履行相关程序后,基金合同应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定,“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

本公司于2022年1月6日发布了《九泰基金管理有限公司关于以通讯方式召开九泰久元量化股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,并于2022年1月7日、2022年1月8日陆续发布了提示性公告。基金份额持有人大会于2022年2月8日表决通过了《关于终止九泰久元量化股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本公司于2022年2月9日发布了《九泰基金管理有限公司关于九泰久元量化股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》(以下简称“决议生效公告”)。根据决议生效公告,本基金最后运作日为2022年2月14日,自2022年2月15日起,本基金进入基金财产清算程序。

本基金管理人九泰基金管理有限公司、基金托管人宁波银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)、上海源泰律师事务所共同成立基金财产清算小组,履行基金财产清算程序,由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海源泰律师事务所对本基金清算报告出具法律意见。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	九泰久元量化股票型证券投资基金	
基金简称	九泰久元量化	
基金主代码	011025	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年1月26日	
基金管理人	九泰基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
最后运作日（2022年2月14日）基金份额总额	279,827.04份	
基金各份额类别简称	九泰久元量化A	九泰久元量化C
基金各份额类别代码	011025	011026
最后运作日（2022年2月14日）各份额类别的份额总额	103,941.11份	175,885.93份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用量化多策略模型，寻找具备长期投资价值的优秀企业，同时有效控制组合风险，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金通过对宏观经济环境、财政及货币政策、资金供需情况等因素的综合分析以及对资本市场趋势的判断，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的长期回报。</p> <p>本基金采用量化多策略进行股票投资。量化多策略体系的理念主要有两个：一方面可以寻找长期具备投资价值的优质企业，获取超越指数的收益；另一方面使用多个策略并依照当时市场情况进行轮动，以期在一定程度上分散风险。</p> <p>本基金投资策略还包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。</p>
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。
--------	---

3、基金运作情况说明

九泰久元量化股票型证券投资基金系经中国证监会证监许可[2020]第3306号文准予募集注册并公开发售，由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关规定和《九泰久元量化股票型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）发起，于2020年12月23日起至2021年1月22日止向社会公开募集，并于2021年1月26日正式成立。募集期间净认购资金总额为人民币207,365,790.05元，在募集期间产生的利息为人民币80,971.26元，以上实收基金(本息)合计为人民币207,446,761.31元，折合207,446,761.31份基金份额。自2021年1月26日至2022年2月14日期间，本基金按基金合同运作。

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》等有关规定及基金合同的相关约定，经基金份额持有人大会2022年2月8日表决通过，决定终止基金合同，并根据法律法规规定和基金合同约定履行基金财产清算程序。本基金管理人于2022年2月9日发布了《九泰基金管理有限公司关于九泰久元量化股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金最后运作日为2022年2月14日，自2022年2月15日起进入基金财产清算程序，停止办理本基金基金份额的申购、赎回、定期定额投资、转换等业务。

4、财务报告（经审计）

4.1 清算资产负债表

会计主体：九泰久元量化股票型证券投资基金

报告截止日：2022年2月14日(最后运作日) 及 2022年2月17日(清算结束日)

单位：人民币元

项目	附注五	2022年2月17日 (清算结束日)	2022年2月14日 (最后运作日)
资产：			
银行存款		291,916.58	88,517.78
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	4.3.5.1	-	245,341.00
资产总计		291,916.58	333,858.78
负债：			
应付赎回款	4.3.5.2(1)	-	35,740.19
应付管理人报酬	4.3.5.2(1)	-	204.63
应付托管费	4.3.5.2(1)	-	20.44
应付销售服务费	4.3.5.2(1)	-	52.46
其他负债	4.3.5.2(2)	20,000.00	20,059.41
负债合计		20,000.00	56,077.13
所有者权益：			
实收基金		274,002.04	279,827.04
未分配利润		-2,085.46	-2,045.39
所有者权益合计	4.3.5.3	271,916.58	277,781.65
负债和所有者权益总计		291,916.58	333,858.78

4.2 清算损益表

会计主体：九泰久元量化股票型证券投资基金

本报告期：2022年2月15日(清算开始日)至2022年2月17日(清算结束日)止
期间

单位：人民币元

项目	附注五	2022年2月15日(清算开始日) 至2022年2月17日 (清算结束日)止期间
一、 营业总收入		-95.28
利息收入		3.96
投资收益（损失以“-”填列）		-19,436.63
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
公允价值变动收益（损失以“-”填列）		19,337.39
汇兑收益（损失以“-”填列）		-
其他业务收入		-
二、 营业总支出		-
管理人报酬		-
托管费		-
销售服务费		-
投资顾问费		-
利息支出		-
其中：卖出回购金融资产利息支出		-
信用减值损失		-
税金及附加		-
其他费用		-
三、 利润总额		-95.28
减：所得税费用		-
四、 净利润（净亏损以“-”号填列）		-95.28
五、 其他综合收益的税后净额		-
六、 综合收益总额		-95.28

清算财务报表附注为清算财务报表的组成部分。

4.3 报表附注

4.3.1 概况

4.3.1.1 基本情况

九泰久元量化股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系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[2020]第 3306 号文准予募集注册并公开发行,由基金管理人九泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关规定和《九泰久元量化股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起,于 2020 年 12 月 23 日起至 2021 年 1 月 22 日止向社会公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限为不定期。募集期间净认购资金总额为人民币 207,365,790.05 元(其中,A 类基金份额净认购资金金额为人民币 26,708,217.77 元,折合 26,708,217.77 份基金份额;C 类基金份额净认购资金金额为人民币 180,657,572.28 元,折合 180,657,572.28 份基金份额),在募集期间产生的利息为人民币 80,971.26 元(其中,A 类基金份额产生的利息为人民币 25,214.98 元,C 类基金份额产生的利息为人民币 55,756.28 元),以上实收基金(本息)合计为人民币 207,446,761.31 元,折合 207,446,761.31 份基金份额。上述募集资金已经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为[2021]京会兴验字第 69000003 号验资报告。经向中国证监会备案,基金合同于 2021 年 1 月 26 日正式生效。本基金的基金管理人为九泰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为宁波银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”),注册登记机构为九泰基金管理有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《九泰久元量化股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市交易的股票(包含主板、中小板、创业板股票及其他中国证监会核准或注册发行的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准是:中证 500 指数收益率 \times 95%+商业银行活期存款利率(税后) \times 5%。

4.3.1.2 清算原因

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》等法律法规的规定和基金合同的有关约定,经与基金托管人协商一致,基金管理人以

通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，基金份额持有人大会审议并于 2022 年 2 月 8 日通过了《关于终止九泰久元量化股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，决议自该日起生效。

4.3.1.3 清算期间

根据《关于九泰久元量化股票型证券投资基金的清算说明函》，本基金的清算期间为 2022 年 2 月 15 日(清算开始日)至 2022 年 2 月 17 日(清算结束日)止。

4.3.2 清算财务报表的编制基础

本清算财务报表仅为本基金管理人用于本基金清算相关监管报送或公告之目的而编制，本清算报表以非持续经营为基础编制。因此，本清算报表列示资产和负债时不再区分流动资产和非流动资产、流动负债和非流动负债，期末资产项目以预计可收回金额列报，负债项目按照需要偿付的金额列报；实收基金和未分配利润作为所有者权益项目进行列报。本清算报表仅列示了 2022 年 2 月 14 日(最后运作日)及 2022 年 2 月 17 日(清算结束日)的清算资产负债表和 2022 年 2 月 15 日(清算开始日)至 2022 年 2 月 17 日(清算结束日)止清算期间的清算损益表及重要报表项目说明。除上述内容外，本基金遵循《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其相关规定。

4.3.3 重要会计政策和会计估计

4.3.3.1 记账本位币

本清算财务报表以人民币为记账本位币。

4.3.3.2 金融资产和金融负债的分类

本基金在清算期间将所持有的金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产列示于交易性金融资产。

本基金将清算期间持有的金融负债全部划分为其他金融负债。其他金融负债包括各类应付款项。

4.3.3.3 金融资产和金融负债的计量和终止确认

交易性金融资产在清算期间按照公允价值进行计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的利息收入计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产以预计可收回金额计量。其他金融负债按照未来应支付的款项金额计量。

应收利息按照存款的本金与适用利率逐日计提并按照未来预计可收回金额进行计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的

合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制。

4.3.3.4 应计利息的确认和计量

应计利息按照存款的本金与适用利率逐日计提并按照未来预计可收回金额进行计量。

4.3.3.5 应付款项的确认和计量

应付款项按照预计未来结算金额进行计量。

4.3.3.6 清算收益的确认和计量

清算收益按照实际发生的收益金额或未来应收取的款项金额计量。

4.3.3.7 清算费用的确认和计量

清算费用按照实际发生的费用金额或未来应支付的款项金额计量。

4.3.4 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。
- (2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

4.3.5 重要报表项目说明

4.3.5.1 资产处置情况

本基金2022年2月14日(最后运作日)交易性金融资产为人民币245,341.00元,

均为股票投资，以上投资均于清算期处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 245,241.76 元，已于清算期间划入托管账户。

4.3.5.2 负债清偿情况

(1) 本基金 2022 年 2 月 14 日(最后运作日)的应付赎回款为人民币 2,190.78 元，应付转出款为人民币 33,549.41 元，应付管理人报酬为人民币 204.63 元，应付托管费为人民币 20.44 元，应付销售费为人民币 52.46 元。以上其他款项均已于清算期间支付。2022 年 2 月 15 日确认的应付赎回款为人民币 5,769.79 元，于清算结束日 2022 年 2 月 17 日支付。

(2) 本基金 2022 年 2 月 14 日(最后运作日)的其他负债为人民币 20,059.41 元，其中预提审计费用为人民币 20,000.00 元，应付赎回费为人民币 59.41 元。按照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。截至 2022 年 2 月 17 日(清算结束日)的其他负债为人民币 20,000.00 元，为应付清算审计费。

4.3.5.3 资产处置及负债清偿后剩余资产分配情况

单位：人民币元	
项目	金额
一、2022 年 2 月 14 日(最后运作日)所有者权益	277,781.65
加：清算期间净收益	-95.28
减：基金净赎回金额（于 2022 年 2 月 15 日确认的投资者赎回申请）	5,769.79
二、2022 年 2 月 17 日(清算结束日)所有者权益	271,916.58

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，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。自 2022 年 2 月 17 日(清算结束日)次日(含)至清算款划出日(含)的银行存款和存出保证金产生的利息属于基金份额持有人所有，按实际适用的利率计算。本基金管理人将于清算款划出托管账户前以自有资金垫付上述利息至托管账户，垫付资金到账日起孳生的利息归本基金管理人所有。

4.3.5.4 根据《九泰基金管理有限公司关于九泰久元量化股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金进入清算程序后(含进入清算程序当日)，停止计提基金管理费、基金托管费、销售服务费。

5、清算情况

2022 年 2 月 15 日(清算开始日)至 2022 年 2 月 17 日(清算结束日)止期间，本基

金基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。基金资产处置、负债清偿及基金净资产具体清算情况如下：

5.1 清算费用

根据基金合同中“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。考虑到本基金清算的实际情况，从保护基金份额持有人利益的角度出发，除银行直接扣付的划款手续费、交易佣金及税费和与本基金相关的清算审计费用外，自清算起始日起，与本基金相关的律师费用将由基金管理人承担。清算审计费已在基金清算财产中预提，待取得收费发票后，由基金剩余财产优先清偿。

5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 245,341.00 元，已于 2022 年 2 月 15 日处置变现，变现产生的证券清算款为人民币 245,241.76 元，已于 2022 年 2 月 16 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日托管银行存款应计利息为人民币 35.18 元，中信建投证券资金账户应计利息为人民币 13.99 元，以上款项将由本基金管理人在清算款划出托管账户前以自有资金垫付其中未收回部分至托管账户，垫付资金到账起产生的利息归基金管理人所有。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 2,190.78 元，应付转出款为人民币 33,549.41 元。应付赎回款按照基金合同约定的申赎原则分别于 2022 年 2 月 15 日支付 2,096.88 元，于 2022 年 2 月 16 日支付 93.90 元。应付转出款按照基金合同约定的转换原则于 2022 年 2 月 15 日支付 33,549.41 元。

(2) 本基金最后运作日应付管理费为人民币 204.63 元，该款项已于 2022 年 2 月 16 日支付完毕。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 20.44 元，该款项已于 2022 年 2 月 16 日支付完毕。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 52.46 元，该款项已于 2022 年 2 月 16 日支付完毕。

5.4 截至本次清算期结束日的剩余财产情况及剩余财产分配安排

项目	金额/份额
一、最后运作日 2022 年 2 月 14 日基金净资产（单位：元）	277,781.65

加：清算期间净收益	-95.28
减：基金净赎回金额	5,769.79
二、清算期结束日 2022 年 2 月 17 日基金净资产	271,916.58
其中：归属于 A 类基金份额的基金净资产	103,369.70
其中：归属于 C 类基金份额的基金净资产	168,546.88
三、清算期结束日 2022 年 2 月 17 日基金总份额（单位：份）	274,002.04
其中：A 类基金份额数量	103,743.02
其中：C 类基金份额数量	170,259.02

截至本次清算期结束日 2022 年 2 月 17 日，本基金剩余财产（已扣除相关费用）为人民币 271,916.58 元。根据本基金的基金合同约定，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。自本次清算期结束日次日 2022 年 2 月 18 日（含）至本次清算款划出前一日（含）的银行存款、中信建投证券资金账户产生的利息亦归全体基金份额持有人所有。

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。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。

为充分保护基金份额持有人利益，便于及时向基金份额持有人分配剩余全部资产，基金管理人九泰基金管理有限公司将于基金剩余财产分配日以自有资金划入托管账户，用以垫付截至基金剩余财产分配日未变现的应计利息（不含清算款划款日当日的应计利息）。基金管理人所垫付的资金以及自基金剩余财产分配日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。本基金的各项应计利息为预计金额，可能与实际发生或支付金额存在差异，资产支付时以银行实际结算金额为准。清算过程中基金管理人垫付资金与实际返还金额的差额由基金管理人承担。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 《九泰久元量化股票型证券投资基金清算财务报表及审计报告》

6.1.2 《上海源泰律师事务所关于九泰久元量化股票型证券投资基金清算事宜之法律意见》

6.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

九泰久元量化股票型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二二年三月十一日