

# 中邮中证价值回报量化策略指数型发起式 证券投资基金清算报告

基金管理人：中邮创业基金管理股份有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二一年十二月十六日

清算报告公告日：二〇二一年十二月二十一日

## 目录

重要提示.....	3
一、基金概况.....	4
二、基金运作情况 .....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清算事项说明.....	6
五、清算情况.....	7
六、备查文件.....	11

## 重要提示

中邮中证价值回报量化策略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[2018]1135号《关于准予中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金注册的批复》核准募集，自2018年11月29日起成立并正式运作，本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”或“中邮创业基金”），基金托管人为华夏银行股份有限公司。

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》等法律法规规定，又根据《中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）“第五部分 基金备案”中“四、基金的自动终止”及“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”《基金合同》生效之日起三年后的对应日，即2021年11月29日日终，本基金资产净值约为0.33亿元，基金资产规模低于2亿元，已触发《基金合同》自动终止条款，根据《基金合同》约定，《基金合同》自动终止。

本基金管理人已就该事项于2021年11月30日发布了《关于中邮中证价值回报量化策略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》（以下简称“《清算公告》”）。根据《清算公告》，

自2021年11月30日起，本基金进入基金财产清算程序。

由基金管理人、基金托管人、致同会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市海华永泰律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由致同会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金清算报告进行审计，上海市海华永泰律师事务所对本基金清算报告出具法律意见。

## 一、 基金概况

基金名称	中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金
基金简称	中邮中证价值回报量化策略指数
基金代码	006255
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月29日
基金管理人名称	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人名称	华夏银行股份有限公司
登记机构	中邮创业基金管理股份有限公司

## 二、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2018]1135号《关于准予中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金注册的批复》核准募集，由中邮创业基金依照《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》《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规规定和《基金合同》约定进行募集，并于 2018 年 11 月 29 日成立并正式运作。本基金为契约型开放式，存续期限不定期，募集金额（包括认购资金在募集期间产生的利息）共计 57,961,495.35 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字（2018）第 110ZC0287 号验资报告予以验证。

自 2018 年 11 月 29 日至 2021 年 11 月 29 日期间，本基金按照《基金合同》约定正常运作。

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》等法律法规规定，又根据《中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）“第五部分 基金备案”中“四、基金的自动终止”及“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”《基金合同》生效之日起三年后的对应日，即 2021 年 11 月 29 日日终，本基金资产净值约为 0.33 亿元，基金资产规模低于 2 亿元，已触发《基金合同》自动终止条款，根据《基金合同》约定，《基金合同》自动终止。本基金管理人分别已于 2021 年 11 月 11 日发布《关于中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告》，2021 年 11 月 18 日发布《关于中邮中证价

值回报量化策略指数型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第二次提示性公告》，2021年11月30日发布《清算公告》，本基金从2021年11月30日起进入清算程序。

### 三、财务会计报告

#### (一) 基金清算资产负债表（已经审计）

单位：人民币元

资 产：	清算期结束日	最后运作日
	2021年12月09日	2021年11月29日
银行存款	26,959,446.21	3,958,577.08
结算备付金	238,621.97	16,909.89
存出保证金	28,997.89	22,460.26
交易性金融资产		29,426,199.83
应收证券清算款		5,445,683.61
应收利息	5,333.16	3,056.44
应收申购款		15,049.32
资产总计	27,232,399.23	38,887,936.43
负 债：		
应付赎回款		6,010,088.06
应付管理人报酬		17,522.17
应付托管费		3,504.44
应付销售服务费		1,193.94

应付交易费用		67,704.17
其他负债		110,984.27
负债合计		6,210,997.05
实收基金	21,227,021.42	25,513,012.93
未分配利润	6,005,377.81	7,163,926.45
所有者权益合计	27,232,399.23	32,676,939.38
负债和所有者权益	27,232,399.23	38,887,936.43
总计		

注：①本基金最后运作日2021年11月29日，A类基金份额净值1.2819元，基金份额23,627,118.46份；C类基金份额净值1.2664元，基金份额1,885,894.47份。本基金份额总额合计为25,513,012.93份。

#### 四、清算事项说明

##### （一）清算原因

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“四、基金的自动终止”及“第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于2亿元，本基金应当按照本基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。”本基金《基金合同》生效之日起三年后的对应日，即2021年11月29日日终，本基金资产净值约为0.33亿元，基金资产规模低于2亿元，已触发《基金合同》自动终止条款，根据《基金合同》约定，《基金合同》自动终止。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》等法律法规规定和《基金合同》约定，不需召开基金份额持有人大会，基金管理人终止本基金《基金合同》并依法履行基金财产清算程序。

## （二）清算期间

根据《清算公告》，本基金从2021年11月30日（清算起始日）起进入清算程序。

## （三）清算报表编制基础

本基金的清算报表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。所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

# 五、清算情况

自2021年11月30日至2021年12月09日止为本基金清算期，基金财产清算小组按照法律法规规定及《基金合同》的约定履行基金财产清算程序，全部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

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”的约定，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。本基金清算期间的费用（其中审计费为人民币8,000.00元，律师费为人民币30,000.00元）由基金财产承担。

## （二）资产清算情况



- 1、本基金最后运作日结算备付金为人民币16,909.89元；截至清算期结束日2021年12月09日结算备付金余额为人民币238,621.97元。
- 2、本基金最后运作日存出保证金为人民币22,460.26元；截至清算期结束日2021年12月09日存出保证金余额为人民币28,997.89元。
- 3、本基金最后运作日交易性金融资产-股票投资为人民币29,426,199.83元；截至清算期结束日2021年12月09日交易性金融资产-股票投资余额为人民币0.00元。
- 4、本基金最后运作日应收证券清算款为人民币5,445,683.61元；截至清算期结束日2021年12月09日应收证券清算款余额为人民币0.00元。
- 5、本基金最后运作日应收利息为人民币3,056.44元；截至清算期结束日2021年12月09日应收利息余额为人民币5,333.16元。
- 6、本基金最后运作日应收申购款为人民币15,049.32元，已于2021年11月30日划至托管账户。

截至清算期结束日2021年12月09日，本基金结算备付金、存出保证金、应收利息尚未收回，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以上结算备付金、存出保证金、应收利息进行垫付（垫付金额可能与实际结息金额存在略微差异）。基金管理人垫付资金需在相关机构实际退款后方能收回，由基金托管人扣除银行手续费等费用后偿付基金管理人垫付的资金。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归本基金管理人所有，与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

### （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 6,010,088.06 元，该款项已于 2021 年 11 月 30 日从托管账户中支付。

2、本基金最后运作日应付管理费为人民币 17,522.17 元，该款项已于 2021 年 12 月 02 日支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为人民币 3,504.44 元，该款项已于 2021 年 12 月 02 日支付。

4、本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,193.94 元，该款项已于 2021 年 12 月 02 日支付。

5、本基金最后运作日应付交易费用为人民币 67,704.17 元，该款项已于 2021 年 12 月 08 日支付。

6、本基金最后运作日其他负债为人民币 110,984.27 元，包括应付标的指数许可使用费为人民币 1,503.86 元，应付正常运作期间的审计费为人民币 36,493.47 元，应付 2021 年上海证券报信息披露费为人民币 72,986.94 元，该款项截至 2021 年 12 月 09 日已全部支付完毕。

### （四）清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2021年11月30日至 2021年12月09日止清算 期间
一、清算收益	
利息收入	2,284.14

投资收益（损失以“-”列示）	-89,462.41
公允价值变动收益（损失以“-”列示）	229,363.54
其他收入（注1）	587.30
清算收益（小计）	142,772.57
二、清算费用	
交易费用	59,752.78
汇划手续费（注2）	4.00
清算律师费	30,000.00
清算审计费	8,000.00
清算费用（小计）	97,756.78
三、清算净收益	45,015.79

注：表中相关项目具体说明如下：

- 1、其他收入为最后运作日的赎回申请所确认的应归属于基金资产的赎回费；
- 2、汇划手续费是指清算期间划付本基金费用以及支付基金份额持有人款项的手续费。

#### （五）截至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2021年11月29日 基金净资产	32,676,939.38
加：清算期间净收益	45,015.79
减：基金净赎回金额	5,489,555.94
二、2021年12月09日基金净资产	27,232,399.23

截至清算期结束日 2021 年 12 月 09 日，本基金剩余财产为人民币 27,232,399.23 元。根据《基金合同》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在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。清算分配结束后，基金管理人垫付资金需在相关机构实际退款后方能收回，由基金托管人扣除银行手续费等费用后偿付垫付的资金，与实际结算金额的尾差由基金管理人承担。

#### （六）基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

清算结束日至清算款划出前一日银行存款（包括活期存款、结算备付金、交易保证金）产生的利息亦属基金份额持有人所有，期间的应收利息以当前适用的利率按日计算，由基金管理人以自有资金垫付（垫付金额可能与实际结息金额存在略微差异）并将于清算款划出前划入托管账户，基金管理人将于基金剩余财产分配结束后自他方收回。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。

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规定以及《基金合同》约定及时对基金财产清算剩余资产进行分配。

## 六、备查文件

### （一）备查文件目录

1、《中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金清算审计报告》

2、《上海市海华永泰律师事务所关于〈中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金清算报告〉之法律意见》

(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。投资者欲了解本基金的详细情况，请认真阅读本基金《基金合同》及本基金招募说明书，投资者可通过以下途径咨询：

基金管理人网站：<http://www.postfund.com.cn>

客服电话：400-880-1618

中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二一年十二月十六日