

# 泰达宏利业绩驱动量化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：招商银行股份有限公司

清算报告出具日：2022年7月5日

清算报告公告日：2022年7月20日

## 目录

|               |   |
|---------------|---|
| 重要提示.....     | 2 |
| 一、基金概况.....   | 2 |
| 二、基金运作情况..... | 3 |
| 三、财务会计报告..... | 4 |
| 四、清算情况.....   | 5 |
| 五、备查文件.....   | 8 |

## 重要提示

泰达宏利业绩驱动量化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】326号予以注册，于2017年9月6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《泰达宏利业绩驱动量化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“自基金合同生效日起，出现如下情形之一的，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：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。法律法规或基金合同另有规定时，从其规定。”本基金基金资产净值自2021年12月9日起低于5000万元，截至2022年3月10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，而无需召开基金份额持有人大会。

本基金于2022年3月11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、基金托管人招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）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        | 泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金         |
| 基金简称        | 泰达宏利业绩股票                    |
| 基金代码        | A类基金份额 004484，C类基金份额 004485 |
| 基金运作方式      | 契约型开放式                      |
| 基金合同生效日     | 2017年9月6日                   |
| 基金管理人       | 泰达宏利基金管理有限公司                |
| 基金托管人       | 招商银行股份有限公司                  |
| 最后运作日       | 2022年3月10日                  |
| 最后运作日基金份额总额 | 4,612,119.55份               |

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金为普通股票型基金，运用量化投资技术，在严格控制风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的收益。                                 |
| 投资策略   | 本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×90%+中证综合债券指数收益率×10%  |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。                          |

## 二、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2017】326号《关于准予泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金注册的批复》注册，由泰达宏利基金管理有限公司于2017年8月3日起至2017年9月1日期间向社会公开发行募集，基金合同于2017年9月6日生效，募集规模为350,779,994.20份基金份额。自2017年9月6日至2022年3月10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《泰达宏利业绩驱动量化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，出现如下情形之一的，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：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。法律法规或基金合同另有规定时，从其规定。”本基金基金资产净值自2021年12月9日起低于5000万元，截至2022年3月10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《泰达宏利业绩驱动量化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2022年3月11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：泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金

报告截止日：2022年3月10日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| 资产                | 最后运作日               |
|-------------------|---------------------|
|                   | 2022年3月10日          |
| <b>资产：</b>        |                     |
| 银行存款              | 3,164,224.42        |
| 结算备付金             | 16,710.42           |
| 存出保证金             | 30,340.76           |
| 交易性金融资产           | 636,057.42          |
| 其中：股票投资           | 636,057.42          |
| 应收证券清算款           | 3,476,178.54        |
| 应收申购款             | 7,338.36            |
| <b>资产总计</b>       | <b>7,330,849.92</b> |
| 负债和所有者权益          | 最后运作日               |
|                   | 2022年3月10日          |
| <b>负债：</b>        |                     |
| 应付赎回款             | 245,834.32          |
| 应付管理人报酬           | 2,833.83            |
| 应付托管费             | 590.40              |
| 应付销售服务费           | 255.74              |
| 应付交易费用            | 19,907.14           |
| 其他负债              | 142,790.13          |
| <b>负债合计</b>       | <b>412,211.56</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     |                     |
| 实收基金              | 4,612,119.55        |
| 未分配利润             | 2,306,518.81        |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>6,918,638.36</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>7,330,849.92</b> |

## 四、清算情况

自 2022 年 3 月 11 日至 2022 年 7 月 5 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，包括支付给会计师事务所、律师事务所的费用，分配基金剩余财产的手续费等，根据基金合同的规定，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（2022 年 7 月 5 日），部分资产尚未收回。根据基金管理人 2022 年 3 月 11 日发布的《关于泰达宏利业绩驱动量化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未到账的存出保证金、应收利息进行垫付。各项资产清算情况如下：

1、 本基金最后运作日银行存款为人民币 3,164,224.42 元，其中应计利息为人民币 894.41 元，已于 2022 年 3 月 21 日划入托管账户。

2、 本基金最后运作日结算备付金为人民币 16,710.42 元，其中上海结算备付金为人民币 9,003.58 元，已于 2022 年 4 月 6 日划入托管账户；深圳结算备付金为人民币 7,412.76 元，已于 2022 年 4 月 6 日划入托管账户；应计利息共计人民币 294.08 元，已于 2022 年 3 月 21 日划入托管账户。

3、 本基金最后运作日存出保证金为人民币 30,340.76 元，其中上海存出保证金为人民币 9,095.38 元，已于清算期内陆续划入托管账户；深圳存出保证金为人民币 21,150.34 元，已于清算期内陆续划入托管账户；应计利息共计人民币 95.04 元，已于 2022 年 3 月 21 日划入托管账户。

4、 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 3,476,178.54 元，该款项已于 2022 年 3 月 11 日划入托管账户。

5、 本基金最后运作日应收申购款为人民币 7,338.36 元，该款项已于 2022 年 3 月 11 日划入托管账户。

6、 本基金最后运作日持有的股票资产为人民币 636,057.42 元。具体情况如下：

单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 股票数量<br>(股) | 期末估值<br>单价(人<br>民币元) | 最后运作日估值<br>金额<br>(人民币元) | 备注      |
|----|--------|------|-------------|----------------------|-------------------------|---------|
| 1  | 688075 | 安旭生物 | 1,254       | 221.16               | 277,334.64              | 科创板流通受限 |
| 2  | 688107 | 安路科技 | 1,702       | 54.95                | 93,524.90               | 科创板流通受限 |
| 3  | 688255 | 凯尔达  | 929         | 32.08                | 29,802.32               | 科创板流通受限 |
| 4  | 300854 | 中兰环保 | 203         | 26.88                | 5,456.64                | 创业板流通受限 |
| 5  | 301059 | 金三江  | 259         | 20.28                | 5,252.52                | 创业板流通受限 |
| 6  | 301060 | 兰卫医学 | 587         | 31.44                | 18,455.28               | 创业板流通受限 |
| 7  | 301062 | 上海艾录 | 523         | 13.85                | 7,243.55                | 创业板流通受限 |
| 8  | 301063 | 海锅股份 | 153         | 38.67                | 5,916.51                | 创业板流通受限 |
| 9  | 301066 | 万事利  | 344         | 21.02                | 7,230.88                | 创业板流通受限 |
| 10 | 301068 | 大地海洋 | 144         | 33.25                | 4,788.00                | 创业板流通受限 |
| 11 | 301069 | 凯盛新材 | 539         | 37.48                | 20,201.72               | 创业板流通受限 |
| 12 | 301072 | 中捷精工 | 181         | 38.41                | 6,952.21                | 创业板流通受限 |
| 13 | 301073 | 君亭酒店 | 144         | 46.16                | 6,647.04                | 创业板流通受限 |
| 14 | 301078 | 孩子王  | 690         | 22.46                | 15,497.40               | 创业板流通受限 |
| 15 | 301079 | 邵阳液压 | 140         | 27.91                | 3,907.40                | 创业板流通受限 |
| 16 | 301081 | 严牌股份 | 403         | 17.49                | 7,048.47                | 创业板流通受限 |
| 17 | 301088 | 戎美股份 | 118         | 19.66                | 2,319.88                | 创业板流通受限 |
| 18 | 301089 | 拓新药业 | 154         | 172.17               | 26,514.18               | 创业板流通受限 |
| 19 | 301090 | 华润材料 | 687         | 11.07                | 7,605.09                | 创业板流通受限 |
| 20 | 301091 | 深城交  | 140         | 32.32                | 4,524.80                | 创业板流通受限 |
| 21 | 301092 | 争光股份 | 97          | 31.1                 | 3,016.70                | 创业板流通受限 |
| 22 | 301093 | 华兰股份 | 99          | 43.14                | 4,270.86                | 创业板流通受限 |
| 23 | 301098 | 金埔园林 | 307         | 23.36                | 7,171.52                | 创业板流通受限 |
| 24 | 301100 | 风光股份 | 94          | 24.33                | 2,287.02                | 创业板流通受限 |
| 25 | 301101 | 明月镜片 | 111         | 37.53                | 4,165.83                | 创业板流通受限 |
| 26 | 301108 | 洁雅股份 | 73          | 49.69                | 3,627.37                | 创业板流通受限 |
| 27 | 301111 | 粤万年青 | 379         | 32.94                | 12,484.26               | 创业板流通受限 |
| 28 | 301133 | 金钟股份 | 286         | 27.26                | 7,796.36                | 创业板流通受限 |
| 29 | 301138 | 华研精机 | 114         | 34.25                | 3,904.50                | 创业板流通受限 |
| 30 | 301155 | 海力风电 | 158         | 105.02               | 16,593.16               | 创业板流通受限 |
| 31 | 301179 | 泽宇智能 | 72          | 46.98                | 3,382.56                | 创业板流通受限 |
| 32 | 301198 | 喜悦智行 | 232         | 27.29                | 6,331.28                | 创业板流通受限 |
| 33 | 301199 | 迈赫股份 | 179         | 26.83                | 4,802.57                | 创业板流通受限 |
| 合计 |        |      |             |                      | 636,057.42              |         |

以上股票资产已于清算期间内处置变现，变现所得金额为人民币 542,782.63

元。

(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 245,834.32 元，该款项已于 2022 年 3 月 11 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 2,833.83 元，该款项已于 2022 年 4 月 7 日支付。

3、 本基金最后运作日应付托管费为人民币 590.4 元，该款项已于 2022 年 4 月 7 日支付。

4、 本基金最后运作日应付 C 类基金份额销售服务费为人民币 255.74 元，该款项已于 2022 年 4 月 7 日支付。

5、 本基金最后运作日应付交易费用为应付佣金人民币 19,907.14 元，该款项已于 2022 年 4 月 20 日支付。

6、 本基金最后运作日其他负债为人民币 142,790.13 元，其中应付审计费为人民币 47,561.71 元，该款项中人民币 40,000.00 元为 2021 年预提审计费，已于 2022 年 6 月 15 日支付，该款项中人民币 7,561.71 元为 2022 年预提审计费，已于 2022 年 6 月 29 日支付；应付信息披露费为人民币 95,123.42 元，该款项中人民币 80,000.00 元为 2021 年预提信息披露费，已于 2022 年 6 月 10 日支付，该款项中人民币 15,123.42 元为 2022 年预提信息披露费，已于 2022 年 6 月 29 日支付；应付银行手续费 105.00 元，已于 2022 年 4 月 11 日支付。

(四) 本次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目              | 自 2022 年 3 月 11 日至 2022 年 7 月 5 日止<br>清算期间 |
|-----------------|--|
| 一、清算期间收益        |  |
| 1、利息收入（注 1）     | 7,507.68                                   |
| 2、变现损益（注 2）     | -92,686.91                                 |
| 3、其他收入（注 3）     | 22.74                                      |
| 4、股利收入（注 4）     | 272.91                                     |
| 清算期间收入小计        | <b>-84,883.58</b>                          |
| 二、清算期间费用        |  |
| 1、律师费           | -20,000.00                                 |
| 2、其他清算期间费用（注 5） | -1,263.94                                  |
| 清算期间费用小计        | <b>-21,263.94</b>                          |
| 三、清算期间净收益       | <b>-106,147.52</b>                         |

注：



- (1) 利息收入为自 2022 年 3 月 11 日至 2022 年 7 月 5 日止清算期间的银行存款、结算备付金、保证金利息收入。
- (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) 股利收入为自 2022 年 3 月 11 日至 2022 年 7 月 5 日止清算期间的股票分红派息与股息红利税款的合计。
- (5) 其他清算期间费用为银行汇划费、交易费用、席位佣金。

(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 2022 年 3 月 10 日基金净资产          | <b>6,918,638.36</b> |
| 加：清算期间净收益                             | -106,147.52         |
| 加：基金申购金额（于 2022 年 3 月 11 日确认的投资者申购申请） | 12,906.94           |
| 减：基金赎回金额（于 2022 年 3 月 11 日确认的投资者赎回申请） | 190,722.75          |
| 二、2022 年 7 月 5 日基金净资产                 | <b>6,634,675.03</b> |

截至本次清算期结束日 2022 年 7 月 5 日，本基金剩余财产为人民币 **6,634,675.03** 元。自本次清算期结束日次日 2022 年 7 月 6 日至本次清算款划出前一日的银行存款产生的利息（包括基金管理人垫付资金本金产生的利息）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分配。

## 五、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、《泰达宏利业绩驱动量化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<泰达宏利业绩驱动量化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

泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金

基金财产清算小组

2022年7月5日