

泰康泉林量化价值精选混合型证券投资 基金清算报告

2024年10月12日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

公告日期：2024年10月12日

一、重要提示及目录

1、重要提示

泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2017 年 7 月 5 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【2017】1129 号文准予募集注册，自 2017 年 9 月 29 日起《泰康泉林量化价值精选混合型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基金管理有限公司，基金托管人为招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》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，本基金将根据基金合同的约定进入清算程序并终止，无须召开基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”截至 2024 年 9 月 3 日日终，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元并触发以上《基金合同》终止的情形。因此，本基金根据基金合同的约定进入清算程序并在清算完成后终止，无须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人于本基金触发《基金合同》终止后的第一个工作日即 2024 年 9 月 4 日发布了《关于泰康泉林量化价值精选混合型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 2024 年 9 月 4 日起进入清算期，并成立了由基金管理人泰康基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所组成的基金财产清算小组，履行基金财产清算程序。其中，毕马威华振会计师事务所（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	4
1、基本情况	4
2、清算原因	5
3、清算起始日	5
4、清算报表编制基础	6
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	8
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	泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金	
基金简称	泰康泉林量化价值精选混合 A	泰康泉林量化价值精选混合 C
基金代码	005000	005111
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 29 日	
基金管理人名称	泰康基金管理有限公司	
基金托管人名称	招商银行股份有限公司	
2024 年 9 月 3 日（最后运作日）基金份额总额	11,493,884.65 份 其中，泰康泉林量化价值精选混合 A 为 10,127,307.06 份；泰康泉林量化价值精选混合 C 为 1,366,577.59 份	
投资目标	本基金坚守价值投资，以量化红利回报策略为核心策略，辅以多种卫星策略，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*15%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。	

三、清盘事项说明

1、基本情况

本基金于 2017 年 7 月 5 日获中国证监会证监许可【2017】1129 号文准予募集注册，原基金管理人为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）。泰康资产依照《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 2017 年 9 月 1 日至 2017 年 9 月 26 日向社会公开募集，本基金《基金合同》于 2017 年 9 月 29 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 728,454,526.78 份，有效认购户数为 3,244 户。

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”或“基金管理人”）于 2022 年 11 月 18 日发布《泰康基金管理有限公司关于变更基金管理人并修订基金合同及托管协议的公告》，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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，按照《泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金合同》约定，经与基金托管人协商一致，本基金的基金管理人自 2022 年 11 月 18 日起由泰康资产变更为泰康基金。泰康基金已对《泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金合同》及《泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金托管协议》等法律文件中涉及基金管理人的相关条款完成修改，修改后的法律文件自 2022 年 11 月 18 日起生效。

自 2017 年 9 月 29 日至 2024 年 9 月 3 日期间，本基金按照《基金合同》约定正常运作。

2、清算原因

根据本基金《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》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，本基金将根据基金合同的约定进入清算程序并终止，无须召开基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”截至 2024 年 9 月 3 日日终，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元并触发以上《基金合同》终止的情形。因此，本基金根据基金合同的约定进入清算程序并在清算完成后终止，无须召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人已于本基金触发《基金合同》终止后的第一个工作日即 2024 年 9 月 4 日发布了《关于泰康泉林量化价值精选混合型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 2024 年 9 月 3 日终触发了《基金合同》规定的终止情形，本基金自 2024 年 9 月 4 日起进入清算期。

4、清算报表编制基础

本清算财务报表只列示本基金于 2024 年 9 月 3 日(最后运作日)和 2024 年 9 月 23 日(清算结束日)的清算资产负债表、自 2024 年 9 月 4 日(清算起始日)至 2024 年 9 月 23 日(清算结束日)止期间的清算损益表以及部分清算财务报表附注，未列示相关期间的比较数字，本清算财务报表未披露净资产变动表、金融工具的风险分析及敏感性分析、公允价值相关内容等。因此，本清算财务报表不是一份完整的财务报表，也不包含一份完整财务报表所应披露的所有会计政策及附注。

除上述事项外，本清算财务报表是根据中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则编制。同时，本清算财务报表遵循了财政部于 2022 年 5 月 25 日颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》的规定。

四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 9 月 3 日

单位：人民币元

项目	基金最后运作日 2024 年 9 月 3 日
资产：	
银行存款	5,736,233.85
结算备付金	132,602.64
存出保证金	9,566.90
交易性金融资产	10,737,219.59
应收清算款	
应收利息	
应收股利	
应收申购款	55.02
其他资产	
资产总计	16,615,678.00
负债：	
应付清算款	6,229.32
应付赎回款	4,029,413.19
应付管理人报酬	1,557.48
应付托管费	259.58
应付销售服务费	66.69
应交税费	

应付利润	
其他负债	72,675.17
负债合计	4,110,201.43
净资产：	
实收资金	11,493,884.65
未分配利润	1,011,591.92
净资产合计	12,505,476.57
负债和净资产总计	16,615,678.00

注：报告截止日 2024 年 9 月 3 日(最后运作日)，泰康泉林量化价值精选混合 A 基金份额净值人民币 1.0917 元，基金份额总额 10,127,307.06 份；泰康泉林量化价值精选混合 C 基金份额净值人民币 1.0607 元，基金份额总额 1,366,577.59 份。基金份额总额合计为 11,493,884.65 份。

五、清算情况

自 2024 年 9 月 4 日至 2024 年 9 月 23 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。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日期货备付金（含利息）人民币 4,521.19 元，最后运作日应计活期存款利息人民币 1,637.06 元，该款项已于 2024 年 9 月 23 日（清算结束日）前划入托管账户；最后运作日最低结算备付金（含利息）人民币 128,081.45 元，存出保证金（含利息）人民币 9,566.90 元，该款项预计 2024 年 10 月 30 日前调回托管账户。未调回部分将由基金管理人泰康基金管理有限公司在基金财产分配划付日前以自有资金垫付至托管账户。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。

(2) 本基金最后运作日持有的股票资产为人民币 9,307,838.77 元，持有的债券资产为人民币 1,429,380.82 元，截至 2024 年 9 月 23 日（清算结束日）前已全部处置并划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日应收申购款人民币 55.02 元，该款项已于 2024 年 9 月 23 日（清算结束日）前划入托管账户。

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 4,029,413.19 元，应付清算款为人民币 6,229.32 元，应付管理人报酬为人民币 1,557.48 元，应付托管费为人民币 259.58 元，应付销售服务费为人民币 66.69 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 72,675.17 元，其中：应付交易费用为人民币 18,467.64 元，应付赎回费人民币 81.66 元，预提信息披露费 33,879.28 元，上述款项已于清算期内支付；预提审计费人民币 20,246.59 元并已于 2024 年 9 月 4 日冲回 5,246.59 元，上述款项截至 2024 年 9 月 23 日（清算结束日）尚未支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2024年9月4日至2024年9月23日（清算期间）
一、清算期间收入	
1、存款利息收入（注1）	2,257.11
2、公允价值变动损益（清算损失以“-”表示）	368,930.72
3、投资收益（清算损失以“-”表示）	-405,762.93
4、其他收入	2.51
清算期间收入小计	-34,572.59
二、清算期间费用	
1、银行手续费	285.00
2、其他费用（注2）	4,753.41
清算期间费用小计	5,038.41
三、清算净收益（清算净损失以“-”表示）	-39,611.00

注1：存款利息收入为活期存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

注2：其他费用为审计费和律师费。

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2024年9月3日基金净资产	12,505,476.57
加：清算期间（2024年9月4日至2024年9月23日）净收益	-39,611.00
2024年9月4日确认的申购款（含费用）	0.02
减：2024年9月4日确认的赎回款（含费用）	655,366.46
二、清算结束日2024年9月23日基金净资产	11,810,499.13

本基金《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。”

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。

清算结束日 2024 年 9 月 23 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，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) 《泰康泉林量化价值精选混合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《泰康泉林量化价值精选混合型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。

泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024 年 10 月 12 日