国泰量化成长优选混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

公告日期：2023 年 4 月 17 日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

国泰量化成长优选混合型证券投资基金(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]1458 号文《关于准予国泰量化成长优选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由国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》和《国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 217,500,531.32 元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 330 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 217,556,899.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 56,367.90 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为更好地维护基金份额持有人利益，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《国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金管理人国泰基金管理有限公司经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，提议终止《基金合同》。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于终止国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。大会投票表决起止时间为2023年2月8日起至2023年3月14日17：00止。本次会议议案于2023年3月15日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。

基金管理人于2023年3月16日在《中国证券报》和基金管理人网站刊登了《国泰量化成长优选混合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》。依据生效的基金份额持有人大会决议，本基金从2023年3月16日起进入清算期。

本基金清算期为 2023 年 3 月 16 日到 2023 年 4 月 6 日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、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于 2023 年 3 月 16 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。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
2 基金概况.....4
2.1 基金基本情况.....4
2.2 基金产品说明.....4
2.3 基金管理人和基金托管人.....4
3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）.....5
3.1 资产负债表.....5
3.2 利润表.....6
3.3 所有者权益（基金净值）变动表.....8
4 清盘事项说明.....9
4.1 基金基本情况.....9
4.2 清算原因.....10
4.3 清算起始日.....11
4.4 清算报表编制基础.....11
5 清算情况.....11
5.1 清算费用.....11
5.2 资产处置情况.....11
5.3 负债清偿情况.....12
5.4 清算期间的清算损益情况.....12
5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况.....12
5.6 基金财产清算报告的告知安排.....13
6 备查文件目录.....13
6.1 备查文件目录.....13
6.2 存放地点.....13
6.3 查阅方式.....13

2 基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰量化成长优选混合型证券投资基金	
基金简称	国泰量化成长优选混合	
基金主代码	005095	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 9 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
2023 年 3 月 15 日（最后运作日）基金份额总额	19,077,044.36 份	
下属分级基金的基金简称	国泰量化成长优选混合 A	国泰量化成长优选混合 C
下属分级基金的交易代码	005095	005096
报告期末下属分级基金的份额总额	17,990,106.87 份	1,086,937.49 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型优选个股，在严格控制投资风险的前提下，力求长期稳定地获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、中小企业私募债投资策略； 6、资产支持证券投资策略；7、非公开发行股票投资策略； 8、股指期货投资策略； 9、国债期货投资策略； 10、权证投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×75%+银行活期存款利率（税后）×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘国华	张燕
	联系电话	021-31081600转	0755-83199084

	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		（021）31089000，400-888-8688	95555
传真		021-31081800	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200082	518040
法定代表人		邱军	缪建民

3 基金最后运作日财务会计报告（经审计）

3.1 资产负债表

会计主体：国泰量化成长优选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 3 月 15 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2023 年 3 月 15 日 （基金最后运作日）	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	1,918,404.20	2,724,619.78
结算备付金	9,334.87	127,444.57
存出保证金	5,204.97	4,013.33
交易性金融资产	19,710,537.86	18,812,421.50
其中：股票投资	19,306,110.79	18,812,421.50
基金投资	-	-
债券投资	404,427.07	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收清算款	-	-

应收股利	-	-
应收申购款	-	381.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	21,643,481.90	21,668,880.36
负债和净资产	**本期末 2023 年 3 月 15 日 （基金最后运作日）**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付清算款	-	-
应付赎回款	67,791.00	191.73
应付管理人报酬	9,568.17	18,508.86
应付托管费	1,913.62	3,701.76
应付销售服务费	441.08	1,398.10
应付投资顾问费	-	-
应交税费	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	66,726.47	83,044.20
负债合计	146,440.34	106,844.65
净资产：	-	-
实收基金	19,077,044.36	20,567,532.38
其他综合收益	-	-
未分配利润	2,419,997.20	994,503.33
净资产合计	21,497,041.56	21,562,035.71
负债和净资产总计	21,643,481.90	21,668,880.36

注：（1）报告截止日2023年3月15日（基金最后运作日），国泰量化成长优选混合型证券投资基金A类基金份额的份额净值1.1295元，国泰量化成长优选混合型证券投资基金C类基金份额的份额净值1.0823元。国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金份额总额19,077,044.36份，其中国泰量化成长优选混合型证券投资基金A类基金份额的份额总额17,990,106.87份，国泰量化成长优选混合型证券投资基金C类基金份额的份额总额1,086,937.49份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 15 日（基金最后运作日）止期间。

3.2 利润表

会计主体：国泰量化成长优选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 15 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 15 日（基金最后运作日）止期间	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日止期间
一、营业总收入	**1,690,870.02**	**-4,174,307.30**
1.利息收入	1,707.24	36,484.88
其中：存款利息收入	1,707.24	36,484.88
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-38,796.83	-2,146,421.34
其中：股票投资收益	-38,682.95	-2,479,682.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	597.48	34,404.39
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-711.36	298,856.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,726,641.35	-2,081,893.28
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,318.26	17,522.44
减：二、营业总支出	**103,624.92**	**382,774.99**
1．管理人报酬	45,998.72	234,423.39
2．托管费	9,199.75	46,884.71
3．销售服务费	3,076.45	19,890.06
4．投资顾问费	-	-
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 信用减值损失	-	-
7．税金及附加	-	-
8．其他费用	45,350.00	81,576.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	**1,587,245.10**	**-4,557,082.29**
减：所得税费用	**-**	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	**1,587,245.10**	**-4,557,082.29**
五、其他综合收益的税后净额	**-**	-
六、综合收益总额	**1,587,245.10**	**-4,557,082.29**

3.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰量化成长优选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 15 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 15 日（基金最后运作日）止期间		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	20,567,532.38	994,503.33	21,562,035.71
二、本期期初净资产（基金净值）	20,567,532.38	994,503.33	21,562,035.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,490,488.02	1,425,493.87	-64,994.15
（一）、综合收益总额	-	1,587,245.10	1,587,245.10
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,490,488.02	-161,751.23	-1,652,239.25
其中：1.基金申购款	25,923.08	1,989.12	27,912.20
2.基金赎回款	-1,516,411.10	-163,740.35	-1,680,151.45
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	19,077,044.36	2,419,997.20	21,497,041.56
项目	**上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产（基金净值）	21,167,859.25	6,096,874.48	27,264,733.73
二、本期期初净资产（基金净值）	21,167,859.25	6,096,874.48	27,264,733.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-600,326.87	-5,102,371.15	-5,702,698.02

（一）、综合收益总额	-	-4,557,082.29	-4,557,082.29
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-600,326.87	-545,288.86	-1,145,615.73
其中：1.基金申购款	6,788,957.70	914,768.49	7,703,726.19
2.基金赎回款	-7,389,284.57	-1,460,057.35	-8,849,341.92
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	20,567,532.38	994,503.33	21,562,035.71

4 清盘事项说明

4.1 基金基本情况

国泰量化成长优选混合型证券投资基金(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]1458 号文《关于准予国泰量化成长优选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由国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》和《国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 217,500,531.32 元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 330 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 217,556,899.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 56,367.90 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同》和《国泰量化成长优选混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购费/申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收

取赎回费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证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）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 50%-95%，权证占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终，在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×75%+银行活期存款利率(税后)×25%。

根据市场环境变化，为更好地维护基金份额持有人利益，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《基金合同》的有关规定，基金管理人国泰基金管理有限公司经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，提议终止《基金合同》。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于终止国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。大会投票表决起止时间为2023年2月8日起至2023年3月14日17：00止。本次会议议案于2023年3月15日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。

基金管理人于2023年3月16日在《中国证券报》和基金管理人网站刊登了《国泰量化成长优选混合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》。依据生效的基金份额持有人大会决议，本基金从2023年3月16日起进入清算期。

本基金清算期为 2023 年 3 月 16 日到 2023 年 4 月 6 日。由基金管理人国泰基金管理有限公司、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于 2023 年 3 月 16 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。

4.2 清算原因

本基金基金份额持有人大会审议通过《关于终止国泰量化成长优选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。

4.3 清算起始日

根据生效的本基金基金份额持有人大会决议，本基金于2023年3月16日起进入清算期，清算期为2023年3月16日到2023年4月6日。

4.4 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。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5 清算情况

自 2023 年 3 月 16 日至 2023 年 4 月 6 日清算期间，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。具体清算情况如下：

5.1 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。

5.2 资产处置情况

截至本次清算期结束日（2023 年 4 月 6 日），各项资产清算情况如下：

（1）本基金最后运作日活期存款余额人民币 1,918,404.20 元，其中本金人民币 1,916,723.83 元，应计活期存款利息人民币 1,680.37 元，截止清算结束日活期存款余额人民币 21,221,978.72 元，其中本金人民币 21,218,512.36元，包含基金管理人于 2023 年 3 月 27 日划入的垫付资金 50,000.00 元，应计活期存款利息人民币 3,466.36 元。

（2）本基金最后运作日结算备付金余额人民币 9,334.87 元，其中期货备付金账户余额人民币 6,978.32 元，截止 2023 年 3 月 29 日已调回托管户。最低备付金账户余额为人民币 2,356.55 元，截止清算结束日账户余额为人民币 2,022.08 元。

（2）本基金最后运作日存出保证金人民币 5,204.97 元，其中本金于 2023 年 4 月 4 日划回托管户，截止清算结束日账户余额为人民币 3.22 元。

（3）本基金于基金最后运作日持有的交易性金融资产公允价值为人民币19,710,537.86元，其中股票投资19,306,110.79元，债券投资404,427.07元，均为非流通受限的证券投资。截止清算结束日已全部变现，扣除交易费用后的变现金额为人民币19,386,252.53元。

5.3 负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付赎回款人民币67,791.00元，截止清算结束日已支付完毕。

（2）本基金最后运作日应付管理费为人民币 9,568.17 元，该款项已于 2023 年 3 月 27 日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,913.62 元，该款项已于 2023 年 3 月 27 日支付。

（4）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 441.08 元，该款项已于 2023 年 3 月 27 日支付。

（5）本基金最后运作日其他负债人民币 66,726.47 元，包括应付券商佣金人民币 6,666.18 元，应付赎回转出费人民币 0.29 元，预提审计费人民币 10,000.00 元，预提信息披露费人民币 50,000.00 元，预提银行汇划费人民币 60.00 元。其中预提审计费、应付赎回转出费、预提信息披露费已于 2023 年 3 月 16 日支付，应付券商佣金连同清算期间产生的佣金总计人民币 8,591.32 元于 2023 年 3 月 27 日支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 16 日（基金清算起始日）至 2023 年 4 月 6 日（基金清算结束日）止期间
一、资产处置损益	**-322,645.77**
1.利息收入	3,564.70
其中：存款利息收入	3,564.70
债券利息收入	
2.投资收益（损失以“-”填列）	-439,924.02
其中：股票投资收益	-439,992.03
债券投资收益	68.01
基金投资收益	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	113,713.55
4.其他收入（损失以“-”号填列）	
二、清算费用	**60.00**
1．其他费用	60.00
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	**-322,705.77**

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

资产处置及负债清偿后，于 2023 年 4 月 6 日本基金剩余财产为人民币 21,173,944.02 元，根据《基金合同》约定，基金财产清算小组将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，按各类基金份额在《基金合同》

终止事由发生时各自基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各份额类别内基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日 2023 年 3 月 16 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算。由基金管理人以自有资金垫付并已于 2023 年 3 月 27 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账起孳生的利息归基金管理人所有。

截至 2023 年 4 月 6 日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 21,221,978.72 元，其中人民币 50,000.00 元系基金管理人垫付资金。基金管理人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。

5.6 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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1、《国泰量化成长优选混合型证券投资基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 15 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》

2、上海市通力律师事务所关于《国泰量化成长优选混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16-19 层。

6.3 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。

国泰量化成长优选混合型证券投资基金财产清算小组

二〇二三年四月六日