

泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：泉果基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告出具日：2025 年 7 月 11 日

报告送出日：2025 年 7 月 12 日

一、重要提示

泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可[2024]25 号《关于准予泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，自 2024 年 6 月 14 日起正式成立运作。基金管理人为泉果基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。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》的有关规定和《泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关约定，本基金已触发基金合同终止情形，本基金依据法律法规的规定及基金合同的约定履行基金财产清算程序并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为 2025 年 7 月 3 日，并自 2025 年 7 月 4 日起进入清算程序。本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见基金管理人于 2025 年 7 月 4 日发布的《关于泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。基金管理人泉果基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、容诚会计师事务所（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，由容诚会计师事务所（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。

二、基金情况

（一）基本信息

1. 基本信息

基金名称	泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	泉果泰岩 3 个月定期开放债券
基金主代码	021453
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2024 年 06 月 14 日
最后运作日基金份额总额	241,089.69 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
主要投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 （一）封闭期投资策略 本基金在债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政

	策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，结合宏观环境分析和微观市场定价实施债券组合管理，债券投资策略包括：久期策略、类属资产配置策略、收益率曲线策略、息差策略等。 此外，本基金在封闭期内还会运用信用债投资策略（含资产支持证券）、国债期货投资策略、信用衍生品投资策略等。 （二）开放期投资策略 在开放期内，本基金将重点关注基金资产的流动性和变现能力，分散投资，做好流动性管理，以应对当时市场条件下的赎回要求。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。	
基金管理人	泉果基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	泉果泰岩 3 个月定期开放债券 A	泉果泰岩 3 个月定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码	021453	021454
报告期末下属分级基金的份额总额	228,756.55 份	12,333.14 份

2. 基金运作情况

泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2024]25 号《关于准予泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，由泉果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《泉果泰岩 3 个月定期开放债券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，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 1,630,406,428.33 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(2024)第 0233 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2024 年 6 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,630,438,601.90 份基金份额，其中认购资金利息折合 32,173.57 份基金份额。本基金的基金管理人为泉果基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作，即以封闭期和开放期相结合的方式运作。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日（含该日）起至基金合同生效日所对应的 3 个月月度对日的前一日。后续每个封闭期为自开放期结束之日次日（含该日）起至该开放期结束之日次日所对应的 3 个月月度对日的前一日，以此类推。本基金在封闭期内不办理申购与赎回等业务（红利再投资除外），也不上市交易。月度对日指某一个特定日期在后续月度中的对应日期，若该月无此对应日期或若该对应日期为非工作日，则顺延至下一个工作日。

根据《泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额是在投资者认购、申购时收取认购费、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，而不从该类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额；C 类基金份额是在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费，但从该类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金收费方式的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：
$$T \text{ 日某类基金份额净值} = T \text{ 日该类基金份额的基金资产净值} / T \text{ 日该类基金份额余额总数}。$$

根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定和《泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、政府支持债、政府支持机构债、短期融资券、超短期融资券、次级债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、信用衍生品、国债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的相关规定）。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

根据《泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》以及泉果基金管理有限公司于 2025 年 7 月 4 日发布的《关于泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2025 年 7 月 4 日进入财产清算期。

（二）清算原因

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”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 50 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在履行清算程序后终止基金合同，且无需召开基金份额持有人大会。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的规定执行。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2025 年 7 月 3 日，本基金出现连续 50 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形，已触发《基金合同》中约定的基金终止条款。根据《基金合同》有关约定，本公司应依据基金财产清算程序对本基金进行财产清算并终止基金合同，且无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人、基金托管人、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力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，并由容诚会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

（三）最后运作日及清算期间

本基金最后运作日为 2025 年 7 月 3 日，清算期为 2025 年 7 月 4 日至 2025 年 7 月 11 日（清算期结束日）。

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。自本基金最后运作日起，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。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。

四、财务报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 7 月 3 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2025 年 7 月 3 日（基金最后运作日）
货币资金	89,136.25
结算备付金	0.00
存出保证金	0.00
交易性金融资产	203,601.97
其中：股票投资	0.00
基金投资	0.00
债券投资	203,601.97
资产支持证券投资	0.00
贵金属投资	0.00

其他投资	0.00
衍生金融资产	0.00
买入返售金融资产	0.00
债权投资	0.00
其中：债券投资	0.00
资产支持证券投资	0.00
其他投资	0.00
应收清算款	0.00
应收股利	0.00
应收申购款	0.00
递延所得税资产	0.00
其他资产	0.00
资产总计	292,738.22
负债和净资产	本期末 2025 年 7 月 3 日（基金最后运作日）
短期借款	0.00
交易性金融负债	0.00
衍生金融负债	0.00
卖出回购金融资产款	0.00
应付清算款	0.00
应付赎回款	0.00
应付管理人报酬	8.08
应付托管费	2.68
应付销售服务费	0.28
应付投资顾问费	0.00
应交税费	0.00
应付利润	0.00
递延所得税负债	0.00
其他负债	46,493.47
负债合计	46,504.51
实收基金	241,089.69
其他综合收益	0.00
未分配利润	5,144.02
净资产合计	246,233.71
负债和净资产总计	292,738.22

注：1. 报告截止日 2025 年 7 月 3 日（基金最后运作日），基金份额总额 241,089.69 份，其中泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金 A 类基金份额总额为 228,756.55 份，基金份额净值 1.0214 元；泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金 C 类基金份额总额为 12,333.14 份，基金份额净值 1.0193 元。

五、清算情况

自 2025 年 7 月 4 日至 2025 年 7 月 11 日止为本基金清算报告期，基金财产清算小组按照法律法规及《泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规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剩余财产中支付。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，本基金清算期间的律师费由基金管理人承担。

（二）最后运作日资产处置情况

1、本基金最后运作日活期存款人民币 1,453.45 元，应计活期存款利息人民币 0.13 元，存放于基金托管人兴业银行股份有限公司，应计活期存款利息由基金管理人先行垫付，待结息后返还给基金管理人。

2、券商普通资金账户人民币 87,650.55 元，应计券商普通资金账户利息人民币 32.12 元，存放于开源证券股份有限公司券商资金账户；上述券商普通资金在清算期间已完成结息并划转至银行托管户，于清算期结束日券商普通资金账户余额为人民币 0.00 元。

3、本基金最后运作日交易性金融资产为债券投资，市值为人民币 203,601.97 元，该部分基金投资已于 2025 年 7 月 4 日全部卖出，卖出款项已于 2025 年 7 月 4 日划入券商资金账户。

（三）最后运作日负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付管理费为 8.08 元，应付托管费为 2.68 元，应付销售服务费为 0.28 元，截至清算期结束日，该款项已支付。

2、本基金最后运作日应付信息披露费为 36,493.47 元，截至清算期结束日，该款项已支付。

3、本基金最后运作日应付审计费为 10,000.00 元，截至清算期结束日，该款项已支付。

（四）停止运作后的清算损益情况说明

单位：人民币元

项目	清算报告期间：2025/7/4 至 2025/7/11
一、营业总收入	-67.26
1.利息收入	42.65
其中：存款利息收入	42.65
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）	286.09
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	286.09
衍生工具收益	-
股利收益	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-
其他投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-396.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、营业总支出	-
1.管理人报酬	-
2.托管费	-
3.销售服务费	-
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	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-67.26
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-67.26
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	-67.26

（五）剩余资产分配情况说明

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2025 年 7 月 3 日基金净资产	246,233.71
加：清算报告期间净收益	-67.26
减：赎回金额（含费用）	-
二、2025 年 7 月 11 日基金净资产	246,166.45

注：资产处置及负债清偿后，截止本基金清算期结束日 2025 年 7 月 11 日，本基金剩余财产为 246,166.45 元。自本次清算期结束日次日 2025 年 7 月 12 日至清算款项支付日前一日的银行存款利息归基金份额持有人所有，产生的各类划付手续费由基金份额持有人承担，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项，供清盘分配使用，待实际资金到账后再返还基金管理人，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归基金管理人所有，预估金额与实际结算金额的差额由基金管理人承担。

（六）基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

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。

六、备查文件目录

（一）备查文件目录

- （1）泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金清算审计报告；
- （2）关于《泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律意见。

（二）存放地点

基金管理人的办公场所。

（三）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。

泉果泰岩 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金财产清算小组

2025 年 7 月 11 日