

中融量化智选混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

公告日期：2022年12月24日

一、重要提示及目录

1、重要提示

中融量化智选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”或“中融量化智选”)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] 71号文《关于准予中融量化智选混合型证券投资基金注册的批复》注册,于2017年3月22日成立并正式运作,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“运作办法”)、《中融量化智选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”或“基金合同”)的有关规定,中融基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)经与本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,由基金管理人召集,以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会,审议终止本基金基金合同相关事项的议案。本基金份额持有人大会已于2022年11月8日表决通过了《关于终止中融量化智选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,决定终止本基金基金合同。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效的公告详见2022年11月9日刊登在《上海证券报》和基金管理人网站(www.zrfunds.com.cn)上的《中融基金管理有限公司关于中融量化智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公告》。

本基金自2022年11月9日起进入清算程序。由基金管理人中融基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、上会会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市海华永泰律师事务所于2022年11月9日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由上会会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市海华永泰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、财务会计报告	4
四、清算事项说明	5
1、基本情况.....	5
2、清算原因.....	6
3、清算起始日.....	6
4、清算报表编制基础.....	7
五、清算情况	7
1、资产处置情况.....	7
2、负债清偿情况.....	8
3、所有者权益情况.....	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.....	9
6、基金财产清算报告的告知安排.....	10
六、备查文件目录	10
1、备查文件目录.....	10
2、存放地点.....	10
3、查阅方式.....	10

二、基金概况

- 1、基金名称：中融量化智选混合型证券投资基金
- 2、基金简称：中融量化智选混合（基金代码：004212），中融量化智选混合A（基金代码：004212）、中融量化智选混合C（基金代码：004783）
- 3、基金运作方式：契约型开放式
- 4、基金合同生效日：2017年03月22日
- 5、2022年11月8日（基金最后运作日）基金份额总额：3,565,744.90份，其中：中融量化智选混合A：3,079,049.85份
中融量化智选混合C：486,695.05份
- 6、投资目标：本基金通过多因子量化选股模型，精选具有超额收益的股票组合进行投资，在充分控制风险的前提下，力争长期稳定的获取超越业绩比较基准的投资回报。
- 7、投资策略：（1）资产配置策略；（2）股票投资策略1）多因子选股模型2）投资组合优化模型；（3）债券投资策略；（4）中小企业私募债券投资策略；（5）资产支持证券投资策略；（6）股指期货投资策略；（7）现金管理策略；（8）权证投资策略。
- 8、业绩比较基准：中证500指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
- 9、风险收益特征：本基金为混合型基金，理论上长期来看，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
- 10、基金管理人：中融基金管理有限公司
- 11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：中融量化智选混合型证券投资基金

报告截止日：2022年11月8日

单位：人民币元

项目	基金最后运作日 2022年11月8日
资产：	
银行存款	94,641.48

结算备付金	21,902.64
存出保证金	4,201.29
交易性金融资产	3,761,360.05
其中：股票投资	3,557,768.00
债券投资	203,592.05
应收证券清算款	50,398.58
应收申购款	1,300.55
资产合计	3,933,804.59
负债：	
应付证券清算款	54,624.86
应付赎回款	3,400.10
应付管理人报酬	1,429.09
应付托管费	238.18
应付销售服务费	100.87
其他负债	21,800.92
负债合计	81,594.02
所有者权益：	
实收基金	3,565,744.90
未分配利润	286,465.67
所有者权益合计	3,852,210.57
负债及所有者权益合计	3,933,804.59

四、清算事项说明

1、基本情况

中融量化智选混合型证券投资基金（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]71号文《关于准予中融量化智选混合型证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融量化智选混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于2017年3月22日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为2017年2月14日至2017年3月17日止，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币311,086,894.97元，折合基金份额

311,086,894.97份，有效认购户数为3,677户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币147,297.20元，折合基金份额147,297.20份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

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》和基金合同等有关规定，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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、可交换公司债券、中小企业私募债、次级债）、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、资产支持证券、股指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（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金业绩比较基准：中证500指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

2、清算原因

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《中融量化智选混合型证券投资基金基金合同》有关规定，基金管理人经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，提议终止《中融量化智选混合型证券投资基金基金合同》。本基金管理人组织召开基金份额持有人大会，审议并通过了《关于终止中融量化智选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，并依法履行基金财产清算程序。

3、清算起始日

根据《基金合同》及《中融基金管理有限公司关于中融量化智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公告》，2022年11月8日为基金最后运作日，本基金于2022年11月9日进入清算期，故本基金清算起始日为2022年11月9日。

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》的有关规定编制的。本基金自最后运作日起，资产负债按实际清算价格计价。

五、清算情况

自 2022 年 11 月 9 日至 2022 年 11 月 21 日止为本基金清算期，中融量化智选混合型证券投资基金自清算起始日起，中融量化智选混合型证券投资基金基金财产清算小组成立，并对中融量化智选混合型证券投资基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行，具体情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款余额为 94,641.48 元，其中托管户银行存款为 94,427.77 元，应计利息余额为 213.71 元，未结利息预计于 2022 年 12 月银行结息日划入托管账户中。

(2) 本基金最后运作日结算备付金余额为 21,902.64 元，其中结算备付金为 21,800.42 元，预计将于 2022 年 12 月及 2023 年 1 月陆续转入托管账户，备付金应计利息 102.22 元，预计于 2022 年 12 月银行结息日划入托管账户中。未结备付金将由基金管理人中融基金管理有限公司在基金财产分配划出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。

(3) 本基金最后运作日存出保证金余额为 4,201.29 元，其中存出保证金 4,191.36 元，预计将于 2022 年 12 月转入托管账户，保证金应计利息为 9.93 元，预计于 2022 年 12 月银行结息日划入托管账户中。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产 3,761,360.05 元(最后运作日估值金额)，其中股票投资 3,557,768.00 元，变现产生的证券清算款为人民币 3,538,357.15 元，债券投资 203,592.05 元，变现产生的证券清算款为人民币 203,585.56 元，以上变现产生的证券清算款为人民币 3,741,942.71 元，已于清算期间划入托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款 50,398.58 元，已于 2022 年 11 月 9 日划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收申购款 1,300.55 元,已于 2022 年 11 月 9 日划入托管账户。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付证券清算款 54,624.86 元,已于 2022 年 11 月 9 日从托管账户划出。

(2) 本基金最后运作日应付赎回款为 3,400.10 元,已分别于 2022 年 11 月 9 日、11 月 10 日从托管账户划出。

(3) 本基金最后运作日、清算结束日应付管理人报酬均为 1,429.09 元,应付托管费均为 238.18 元,应付销售服务费均为 100.87 元,该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(4) 本基金最后运作日其他负债为 21,800.92 元,其中应付赎回费 0.02 元,已于 2022 年 11 月 9 日从托管账户划出。应付交易费用 4,706.42 元、应付审计费 17,094.48 元,将于后续完成服务并收到支付协议及各类发票后支付。

3、所有者权益情况

最后运作日基金净资产为 3,852,210.57 元,基金份额共 3,565,744.90 份,其中中融量化智选 A 份额 3,079,049.85 份、中融量化智选 C 份额 486,695.05 份;清算结束日本基金剩余财产为 3,831,032.62 元,基金份额共 3,566,101.87 份,其中中融量化智选 A 份额 3,079,196.99 份、中融量化智选 C 份额 486,904.88 份。

4、清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	清算期间发生额
一、清算期间收入	
1、利息收入(注 1)	460.66
2、投资收益	-119,466.63
3、公允价值变动损益	103,870.55
清算期间收入小计	-15,135.42
二、清算期间费用(注 2)	
1、交易费用	6,411.70
2、其他费用(注 3)	10.00

清算期间费用小计	6,421.70
三、清算期间净收益（清算期间净损失以“-”表示）	-21,557.12

注 1：利息收入包括本基金自清算起始日 2022 年 11 月 9 日至清算结束日 2022 年 11 月 21 日产生的银行存款利息收入 445.45 元、结算备付金利息收入 12.74 元、保证金利息收入 2.47 元，共计 460.66 元。

注 2：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，本基金清算期间的清算律师费由基金管理人承担。

注 3：其他费用为汇划费 10.00 元。

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 2022 年 11 月 8 日基金净资产	3,852,210.57
加：清算期间净收益	-21,557.12
加：清算期间因申购影响的金额	399.77
减：清算期间因赎回影响的金额	20.60
二、清算结束日 2022 年 11 月 21 日基金净资产	3,831,032.62

根据《基金合同》中关于基金财产清算的相关约定，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（基金管理人代为支付的部分除外）、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。同时，《基金合同》“第七部分 基金合同当事人及权利义务”中“三、基金份额持有人”项下约定：“同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。”基金财产将按照上述分配原则进行分配。

本基金清算起始日 2022 年 11 月 9 日至基金财产清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金及其产生的利息亦属基金份额持有人所有。如前述利息在本基金财产分配划出日前尚未结清，则未结息部分将由基金管理人中融基金管理有限公司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，基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于利息结清后返还给基金管理人，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，将报中国证监会备案并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

1、备查文件目录

- (1) 《中融量化智选混合型证券投资基金审计报告》；
- (2) 《上海市海华永泰律师事务所关于〈中融量化智选混合型证券投资基金清算报告〉之法律意见》。

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。

中融量化智选混合型证券投资基金基金财产清算小组

2022年11月21日