

# 中融量化精选混合型基金中基金（FOF） 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：2023年3月14日

## 一、重要提示及目录

### 1、重要提示

中融量化精选混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”或“中融量化精选FOF”）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[2018] 380号文《关于准予中融量化精选混合型基金中基金（FOF）注册的批复》批准，于2018年5月4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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《中融量化精选混合型基金中基金（FOF）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2023年1月5日表决通过了《关于终止中融量化精选混合型基金中基金（FOF）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2023年1月6日刊登在《中国证券报》和基金管理人网站（[www.zrfunds.com.cn](http://www.zrfunds.com.cn)）上的《中融基金管理有限公司关于中融量化精选混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》。

本基金自2023年1月6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、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于2023年1月6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。

## 2、目录

<b>一、重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1、重要提示.....	2
2、目录.....	3
<b>二、基金概况</b> .....	<b>4</b>
<b>三、财务会计报告</b> .....	<b>4</b>
<b>四、清算事项说明</b> .....	<b>5</b>
1、基本情况.....	5
2、清算原因.....	6
3、清算起始日.....	7
4、清算报表编制基础.....	7
<b>五、清算情况</b> .....	<b>7</b>
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、.....	9
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
<b>六、备查文件目录</b> .....	<b>10</b>
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：中融量化精选混合型基金中基金 (FOF)
- 2、基金简称：中融量化精选 FOF (基金代码：005758)，中融量化精选 FOF (A) (基金代码：005758)、中融量化精选 FOF (C) (基金代码：005759)
- 3、基金运作方式：契约型开放式
- 4、基金合同生效日：2018 年 5 月 4 日
- 5、2023 年 1 月 5 日 (基金最后运作日) 基金份额总额：2,182,784.04 份，其中：中融量化精选 FOF (A)：571,859.40 份  
中融量化精选 FOF (C)：1,610,924.64 份
- 6、投资目标：本基金以数量化投资技术为基础，并与基本面研究紧密结合，努力把握市场投资机会，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的持续稳健增长。
- 7、投资策略：1. 大类资产配置策略 (1) 战略资产配置 (2) 战术资产配置  
2. 基金投资策略 3. 股票投资策略 4. 债券投资策略 5. 资产支持证券投资策略 6. 权证投资策略
- 8、业绩比较基准：中证800指数收益率×20%+中债综合财富指数收益率×75%+同期银行活期存款利率 (税后) ×5%
- 9、风险收益特征：本基金为混合型基金中基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金为风险收益特征相对稳健的基金中基金。
- 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：中融量化精选混合型基金中基金 (FOF)

报告截止日：2023 年 1 月 5 日

单位：人民币元

项目	基金最后运作日 2023 年 1 月 5 日
<b>资产：</b>	
银行存款	7,739,202.17

结算备付金	40.27
存出保证金	118.27
交易性金融资产	1,482,824.51
其中：债券投资	606,713.97
基金投资	876,110.54
买入返售金融资产	0.00
应收证券清算款	0.00
应收利息	0.00
应收申购款	1,897.35
其他资产	19.80
资产总计	9,224,102.37
<b>负债：</b>	
应付赎回款	6,984,237.97
应付管理人报酬	230.61
应付托管费	68.99
应付销售服务费	160.04
其他负债	19,174.32
负债合计	7,003,871.93
<b>净资产：</b>	
实收基金	2,182,784.04
未分配利润	37,446.40
净资产合计	2,220,230.44
负债和净资产总计	9,224,102.37

## 四、清算事项说明

### 1、基本情况

中融量化精选混合型基金中基金（FOF）经中国证监会证监许可[2018] 380 号文《关于准予中融量化精选混合型基金中基金（FOF）注册的批复》批准，由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《中融量化精选混合型基金中基金（FOF）基金合同》公开募集，于 2018 年 5 月 4 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和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，包括国内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金份额(含 QDII 基金)、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)、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、中小企业私募债券、次级债等)、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)。本基金不投资于分级基金份额、香港互认基金份额、股指期货、国债期货和股票期权。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合的比例为：本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于权益类资产(包括股票、股票型基金、混合型基金)占基金资产的比例为 0-30%；持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%；本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；本基金持有单只基金的市值，不得高于本基金资产净值的 20%，且不得持有其他基金中基金；本基金管理人管理的全部基金中基金(ETF 联接基金除外)持有单只基金不得超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 X20%+中债综合财富指数收益率 X75%+同期银行活期存款利率(税后)X5%。

## 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《中融量化精选混合型基金中基金（FOF）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《中融量化精选混合型基金中基金（FOF）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《关于终止中融量化精选混合型基金中基金（FOF）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精选混合型基金中基金（FOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，2023年1月5日为基金最后运作日，本基金于2023年1月6日进入清算期，故本基金清算起始日为2023年1月6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2023年1月6日至2023年1月13日止为本基金清算报告期，中融量化精选混合型基金中基金（FOF）自清算起始日起，中融量化精选混合型基金中基金（FOF）基金财产清算小组成立，并对中融量化精选混合型基金中基金（FOF）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 7,739,202.17 元，清算期间收到变现资产划入银行存款 1,481,756.28 元，调入清算备付金 1,334.55 元，收到申购款 1,897.35 元，支付赎回款 6,984,348.54 元，支付汇划费 165.56 元，支付佣金 221.60 元，计提银行存款利息 114.44 元，清算结束日银行存款 2,236,899.99 元，其中活期存款 2,236,554.10 元，应计银行存款利息 345.89 元。未结息部分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。

（2）本基金最后运作日结算备付金 40.27 元，清算期间调入 1,334.55 元，计提结算备付金利息 0.24 元，清算结束日结算备付金 1,375.06 元，其中结算备付金 1,374.82 元预计将于 2023 年 2 月转入托管账户，应计结算备付金利息 0.24 元预计将于一季度结息时转入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金 118.27 元，清算期间无转入转出，清算结束日存出保证金 118.27 元，其中存出保证金 118.13 元预计将于 2023 年 2 月转入托管账户，应计存出保证金利息 0.14 元预计将于一季度结息时转入托管账户。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产 1,482,824.51 元(最后运作日估值金额)，系本基金持有的债券投资和基金投资，其中：以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资 606,713.97 元，以公允价值计量且其变动计入当期损益的基金投资 876,110.54 元，已于清算期间全部变现。

(5) 本基金最后运作日其他应收款 19.80 元，为投资于管理人自己管理的开放式基金产生的销售服务费返还，预计将于 2023 年 2 月转入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收申购款 1,897.35 元，已于清算期内划入银行存款。清算结束日应收申购款 0.00 元。

## 2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为 6,984,237.97 元，该款项已于清算期间从托管账户划出。

(2) 本基金最后运作日应付赎回费为 49.02 元，该款项已于清算期间从托管账户划出。

(3) 本基金最后运作日、清算结束日应付管理人报酬均为 230.61 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、清算结束日应付托管费均为 68.99 元，该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(5) 本基金最后运作日、清算结束日应付销售服务费均为 160.04 元，该款项将于清算完成后从托管账户划出。

(6) 本基金最后运作日应付交易费用 221.60 元，该款项已于清算期间从托管账户划出。

(7) 本基金最后运作日、清算结束日审计费用均为 18,903.70 元，该款项将于清算审计完成后从托管账户划出。

## 3、所有者权益情况

最后运作日基金净资产为 2,220,230.44 元，基金份额共 2,182,784.04 份，其中中融量化精选 FOF（A）份额 571,859.40 份、中融量化精选 FOF（C）份额 1,610,924.64 份；



清算结束日本基金剩余财产为2,219,049.78元，基金份额共2,182,724.52份，其中中融量化精选FOF（A）份额571,810.01份、中融量化精选FOF（C）份额1,610,914.51份。

#### 4、清算期间的清算损益情况

项目	清算期发生额
一、清算期间收入	
1、利息收入（注1）	114.68
2、投资收益（清算损失以“-”表示）	-4,595.88
3、公允价值变动损益	3,527.65
清算期间收入小计	-953.55
二、清算期间费用	
1、其他费用（注2）	165.56
清算期间费用小计	165.56
三、清算净收益（清算净损失以“-”表示）	-1,119.11

注1：利息收入包括本基金自清算起始日2023年1月6日至清算结束日2023年1月13日产生的银行存款利息收入114.44元、结算备付金利息收入0.24元，共计114.68元。

注2：其他费用为汇划费165.56元。

#### 5、清算结束日的资产负债及剩余财产的分配情况

项目	单位：人民币元 金额
一、最后运作日2023年1月5日基金净资产	2,220,230.44
加：清算期间净收益	-1,119.11
加：清算期间因申购影响的金额	0
减：清算期间因赎回影响的金额	61.55
二、清算结束日2022年1月13日基金净资产	2,219,049.78

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。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2023年1月6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。

## 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进行分析。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- （1）《中融量化精选混合型基金中基金（FOF）审计报告》；
- （2）《上海市通力律师事务所关于〈中融量化精选混合型基金中基金（FOF）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。

中融量化精选混合型基金中基金（FOF）基金财产清算小组

2023年3月6日