

人保量化基本面混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：中国人保资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告公告日：2023年10月24日

一、重要提示及目录

1、重要提示

人保量化基本面混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人中国人保资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《人保量化基本面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”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]1089号文批准公开募集。本基金合同于2018年09月27日正式生效。本基金的基金管理人为中国人保资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定,基金管理人于2023年08月17日发布《关于以通讯方式召开人保量化基本面混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,审议《关于人保量化基本面混合型证券投资基金终止基金合同的议案》。本次基金份额持有人大会于2023年09月18日计票表决通过了《关于人保量化基本面混合型证券投资基金终止基金合同的议案》,决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定,组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日定为2023年09月20日,并于2023年09月21日进入清算程序。

本基金由基金管理人中国人保资产管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)、上海市锦天城律师事务所于2023年09月21日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市锦天城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	5
四、 清算事项说明	6
1、 基金基本情况.....	6
2、 清算原因.....	7
3、 清算起始日.....	7
4、 清算报表编制基础.....	7
五、 清算情况	8
1、 资产清算情况.....	8
2、 负债清偿情况.....	9
3、 所有者权益情况.....	9
4、 清算期间的清算损益情况.....	9
5、 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况.....	10
6、 基金财产清算报告的告知安排.....	11
六、 备查文件目录	11
1、 备查文件目录.....	11
2、 存放地点.....	11
3、 查阅方式.....	11

二、基金概况

基金名称	人保量化基本面混合型证券投资基金	
基金简称	人保量化混合	
基金主代码	006225	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年09月27日	
基金管理人	中国人保资产管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
基金最后运作日基金份额总额	3,617,223.13份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	人保量化混合A	人保量化混合C
下属分级基金的交易代码	006225	006226
基金最后运作日下属分级基金的份额总额	1,034,340.22份	2,582,882.91份
投资目标	<p>本基金通过数量化方法，以人保量化基本面选股策略为主要投资策略，并通过多种辅助策略的配合，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。</p>	
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括GDP增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。 2、股票投资策略 本基金以价值投资理念及基本面分析方法为指导，利用数量化方法及计算机技术建立投资模型，将投资逻辑转化为明确的策略规则，以人保量化基本面选股策略为基础，并通过多种辅助策略的配合，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。 3、债券投资策略 本基金基于投资策略及流动性管理的需要，将以有效利用基金资产、保持基金资产流动性、为基金资产提供稳定收益为主要目的，适时对债券等固定收益类金融工具进行投资。</p>	

业绩比较基准	中证800指数收益率×75%+中债综合全价指数收益率×20%+商业银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益率和预期风险低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：人保量化基本面混合型证券投资基金

2023年09月22日(清算结束日)及2023年09月20日(最后运作日)

单位：人民币元

项目	2023年09月22日 (清算结束日)	2023年09月20日 (最后运作日)
资产：		
银行存款	2,787,753.97	227,667.41
结算备付金	10,590.82	10,703.75
存出保证金	4,570.44	4,593.47
交易性金融资产	-	2,570,572.38
其中：股票投资	-	2,570,572.38
应收申购款	-	10,631.43
应收清算款	-	26,316.93
资产总计	2,802,915.23	2,850,485.37
负债和净资产		
负债：		
应付清算款	381.19	44,758.71
应付赎回款	179,523.92	14,262.85
应付管理人报酬	-	1,874.39
应付托管费	-	327.60
应付销售服务费	-	879.44
其他负债	5,111.18	12,662.74
负债合计	185,016.29	74,765.73
净资产：		
实收基金	3,413,079.07	3,617,223.13
未分配利润	-795,180.13	-841,503.49
净资产合计	2,617,898.94	2,775,719.64
负债和净资产总计	2,802,915.23	2,850,485.37

注：本基金最后运作日 2023 年 09 月 20 日，人保量化混合 A 份额净值人民币 0.7887 元，基金份额总额 1,034,340.22 份；人保量化混合 C 份额净值人民币 0.7588 元，基金份额总额 2,582,882.91 份；总份额合计 3,617,223.13 份。

四、清算事项说明

1、基金基本情况

人保量化基本面混合型证券投资基金系由基金管理人中国人保资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《人保量化基本面混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会以证监许可[2018]1089 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 239,917,928.20 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00364 号的验资报告。基金合同于 2018 年 09 月 27 日正式生效。本基金的基金管理人为中国人保资产管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为 A 类基金份额(以下简称“人保量化混合 A”)和 C 类基金份额(以下简称“人保量化混合 C”)两类份额。其中，人保量化混合 A 是指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；人保量化混合 C 是指在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但赎回时收取赎回费，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、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）、权证、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单，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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比

例为 60%~95%；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以及股票期权需缴纳的现金保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×75%+中债综合全价指数收益率×20% + 商业银行活期存款利率×5%。

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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，基金管理人于 2023 年 08 月 17 日发布《关于以通讯方式召开人保量化基本面混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，审议《关于人保量化基本面混合型证券投资基金终止基金合同的议案》。本次基金份额持有人大会于 2023 年 09 月 18 日计票表决通过了《关于人保量化基本面混合型证券投资基金终止基金合同的议案》，决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日定为 2023 年 09 月 20 日，并于 2023 年 09 月 21 日进入清算程序。

3、清算起始日

本基金的清算期间为 2023 年 09 月 21 日(清算开始日)起至 2023 年 09 月 22 日(清算结束日)止期间。

4、清算报表编制基础

本清算报表仅为本基金基金管理人用以本基金清算相关监管报送或公告之目的而编制，本清算报表以非持续经营为基础编制。因此，本清算报表列示资产和负债时不再区分流动资产和非流动资产、流动负债和非流动负债，期末资产项目以预计可收回金额列报，负债项目按照需要偿付的金额列报；实收基金和未分配利润以净资产项目进行列报。本清算报表仅列示了 2023 年 09 月 20 日(最后运作日)及 2023 年 09 月 22 日(清算结束日)的清算资产负债表和 2023 年 09 月 21 日(清算开始日)至 2023 年 09 月 22 日(清算结束日)止清算期间的清算损益表及重要报表项目说明。除上述内容外，本基金遵循《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、《证券投资基金会计核算业务指引》及其相关规定。

五、清算情况

自 2023 年 09 月 21 日起至 2023 年 09 月 22 日止为本基金清算期间，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：

1、资产清算情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币 227,667.41 元，其中活期存款为人民币 227,009.25 元，应计活期存款利息为人民币 658.16 元；清算结束日银行存款为人民币 2,787,753.97 元，其中活期存款为人民币 2,787,724.78 元，应计活期存款利息为人民币 29.19 元。活期存款均存放于基金托管人中国工商银行，结息金额以最终到账为准。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 10,703.75 元，分别为上海证券交易所结算备付金人民币 6,508.47 元及其应计利息人民币 46.36 元、深圳证券交易所结算备付金人民币 4,081.41 元及其应计利息人民币 67.51 元；清算结束日结算备付金为人民币 10,590.82 元，分别为上海证券交易所结算备付金人民币 6,508.47 元及其应计利息人民币 0.58 元、深圳证券交易所结算备付金人民币 4,081.41 元及其应计利息人民币 0.36 元。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 4,593.47 元，分别为上海证券交易所存出保证金人民币 1,874.62 元及其应计利息人民币 10.61 元、深圳证券交易所存出保证金人民币 2,695.42 元及其应计利息人民币 12.82 元；清算结束日存出保证金为人民币 4,570.44 元，分别为上海证券交易所存出保证金人民币 1,874.62 元及其应计利息人民币 0.16 元、深圳证券交易所存出保证金人民币 2,695.42 元及其应计利息人民币 0.24 元。

(4) 本基金最后运作日持有交易性金融资产为人民币 2,570,572.38 元，均为股票投资，已于清算期间全部变现，到账金额为人民币 2,570,209.06 元。

(5) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 10,631.43 元，已于清算期间划至托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 26,316.93 元，已于清算期间划至托管账户。

2、 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付清算款为人民币 44,758.71 元, 该款项已于清算期间支付; 清算结束日应付清算款为人民币 381.19 元, 为股票补缴红利税, 该款项于 2023 年 09 月 25 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 14,262.85 元, 该款项已于清算期间支付; 清算结束日应付赎回款为人民币 179,523.92 元, 为 2023 年 09 月 20 日申请的赎回交易, 该款项于 2023 年 09 月 25 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,874.39 元, 该款项已于清算期间支付。

(4) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 327.60 元, 该款项已于清算期间支付。

(5) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 879.44 元, 该款项已于清算期间支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 12,662.74 元, 分别为: 应付赎回费人民币 0.17 元, 应付交易费用人民币 7,662.57 元, 清算审计费人民币 5,000.00 元。其中, 应付赎回费及应付交易费用已于清算期间支付; 本基金清算结束日其他负债为人民币 5,111.18 元, 分别为: 应付赎回费人民币 111.18 元, 清算审计费人民币 5,000.00 元。其中, 应付赎回费于 2023 年 09 月 25 日支付, 清算审计费于审计结束后支付。

3、 所有者权益情况

本基金最后运作日 2023 年 09 月 20 日, 人保量化混合 A 份额净值人民币 0.7887 元, 基金份额总额 1,034,340.22 份; 人保量化混合 C 份额净值人民币 0.7588 元, 基金份额总额 2,582,882.91 份; 总份额合计 3,617,223.13 份。

4、 清算期间的清算损益情况

单位: 人民币元

项目	2023 年 09 月 21 日 (清算开始日)至 2023 年 09 月 22 日 (清算结束日)止期间
一、 收入	-2,140.60
1、 利息收入	30.35
其中: 存款利息收入	30.35

2、投资收益(损失以“-”填列)	-129,105.42
其中：股票投资收益	-129,044.23
股利收益	-61.19
3、公允价值变动收益(损失以“-”填列)	126,762.74
4、其他收入(损失以“-”号填列)	171.73
二、费用	23.00
1、其他费用	23.00
三、利润总额	-2,163.60
减：所得税费用	-
四、净收益	-2,163.60

(1) 本基金清算期间利息收入人民币 30.35 元，包括以当前适用的利率计提的清算开始日至清算结束日止期间的银行存款利息人民币 29.21 元，上海证券交易所结算备付金利息收入人民币 0.71 元，深圳证券交易所结算备付金利息收入人民币 0.30 元，上海证券交易所存出保证金利息收入人民币-0.04 元，深圳证券交易所存出保证金利息收入人民币 0.17 元。

(2) 本基金清算期间投资收益为人民币-129,105.42 元，包括清算期间卖出股票产生的投资收益人民币-129,044.23 元，清算期间股利收益人民币-61.19 元，其中，红利收入为人民币 320.00 元，补缴红利税为人民币-381.19 元。

(3) 本基金清算期间公允价值变动收益为人民币 126,762.74 元，系清算期间卖出股票时转出的公允价值变动累计金额。

(4) 本基金清算期间其他收入为人民币 171.73 元，系清算期间产生的赎回费收入。

(5) 本基金清算期间其他费用为人民币 23.00 元，系清算期间产生的银行汇划费。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2023 年 09 月 20 日基金净资产	2,775,719.64
加：清算期间净收益	-2,163.60
减：基金申购赎回轧差金额（于清算期间确认的最后运作日申购赎回申请）	155,657.10

二、清算结束日 2023 年 09 月 22 日基金净资产	2,617,898.94
-------------------------------	--------------

(1) 2023 年 09 月 21 日(清算开始日)至 2023 年 09 月 22 日(清算结束日)期间净收益为人民币-2,163.60 元。

(2) 于清算结束日 2023 年 09 月 22 日, 本基金净资产为人民币 2,617,898.94 元。根据本基金的基金合同约定, 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。

(3) 2023 年 09 月 22 日后至清算款划出日前的银行存款应计利息、结算备付金应计利息及存出保证金应计利息归基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益, 加快清盘速度, 基金管理人可以自有资金先行垫付该笔款项(该金额可能与实际结息金额存在略微差异), 供清盘分配使用。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。

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。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《人保量化基本面混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告》;
- (2) 《上海市锦天城律师事务所关于〈人保量化基本面混合型证券投资基金清算报告〉的法律意见书》。

2、存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

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。

人保量化基本面混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023 年 10 月 24 日