

# 平安量化精选混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二二年五月十七日

清算报告公告日：二〇二二年五月十八日

## 目 录

一、基金概况.....	4
二、基金运作情况.....	4
三、财务会计报告.....	4
四、清算情况.....	5
五、备查文件.....	8

## 重要提示

平安量化精选混合型发起式证券投资基金(原名为平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金,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]1066号《关于准予平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。基金合同于2018年2月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为239,043,619.41份基金份额,其中认购资金利息折合161,529.05份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金于2018年11月30日起更名为平安量化精选混合型发起式证券投资基金。

根据《平安量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》以及基金管理人平安基金管理有限公司于2022年4月26日发布的《平安量化精选混合型发起式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》,本基金自2022年4月27日起进入基金财产清算程序。根据以上公告内容,本基金于决议生效并公告后的下一个工作日(即2022年4月27日起)进入清算程序,基金管理人自进入清算程序之日起不再接受投资人提出的赎回、转换出等业务的申请。本基金进入清算程序后,停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰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,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计,上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## 一、基金概况

基金名称	平安量化精选混合型发起式证券投资基金
基金简称	平安量化精选混合
基金主代码	005486
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月1日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

## 二、基金运作情况

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]1066号《关于准予平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。基金基金合同于2018年2月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总数为239,043,619.41份(含募集期间利息结转的份额)。

自2018年2月1日至2022年4月26日期间,本基金按《基金合同》正常运作。

根据《平安量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》以及基金管理人平安基金管理有限公司于2022年4月26日发布的《平安量化精选混合型发起式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》,本基金自2022年4月27日起进入基金财产清算程序。

## 三、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表(经审计)

会计主体:平安量化精选混合型发起式证券投资基金

报告截止日:2022年4月26日

	最后运作日 2022年4月26日
<b>资 产：</b>	
银行存款	7,249,603.33
结算备付金	40,819.36
存出保证金	47,179.94
交易类金融资产	5,936,287.24
其中：股票投资	5,936,287.24
应收清算款	-
应收利息	-
应收股利	-
资产合计	<b>13,273,889.87</b>
<b>负 债：</b>	
应付清算款	57.90
应付赎回款	62,230.46
应付管理人报酬	5,937.49
应付托管费	1,484.39
应付销售服务费	6,133.36
其他负债	100,894.69
负债合计	<b>176,738.29</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	8,343,774.74
未分配利润	4,753,376.84
所有者权益合计	<b>13,097,151.58</b>
负债与持有人权益总计：	<b>13,273,889.87</b>

注：1、报告截止日 2022 年 4 月 26 日(基金最后运作日)，基金份额总额 8,343,774.74 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.6148 元，A 类基金份额 1,787,739.86 份；下属 C 类基金份额净值 1.5574 元，C 类基金份额 6,556,034.88 份。

2、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。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。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

#### 四、清算情况

本基金的本次清算期间为 2022 年 4 月 27 日至 2022 年 5 月 13 日止。由于本基金持有流通受限股票，本基金将在其锁定解除完成变现后按照基金份额持有人的基金份额比例进行二次分配，二次分配的时间安排根据变现时间确定。

自 2022 年 4 月 27 日至 2022 年 5 月 13 日清算期间，基金财产清算小组按照法律法规及《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

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。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金资产清算组优先从基金财产中支付。

#### （二）最后运作日资产处置情况

- 1、本基金最后运作日银行存款 7,249,603.33 元（含应计活期银行存款利息 2,061.64 元），该款项由基金托管人负责保管。
- 2、本基金最后运作日结算备付金为 40,819.36 元（含应计备付金利息为 39.16 元），该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。
- 3、本基金最后运作日保证金为 47,179.94 元（含应计结算保证金利息为 77.44 元），该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。
- 4、本基金最后运作日交易性金融资产全部为股票，股票市值为 5,936,287.24 元，其中上市流通股票为 5,597,062.09 元，处于锁定期内而无法卖出的股票为 339,225.15 元（最后运作日估值市值）。截至报告日剩余的交易性金融资产全部为处于锁定期内而无法卖出的股票投资，金额为 308,930.79 元（2022 年 5 月 13 日估值市值），将在其锁定解除后及时变现，并二次向基金份额持有人分配。

#### （三）最后运作日负债清偿情况

- 1、本基金最后运作日应付清算款 57.90 元，为应付交易佣金。截止报告日该款项暂未支付。
- 2、本基金最后运作日应付赎回款 62,230.46 元。该款项已于 2022 年 4 月 27 日、2022 年 4 月 28 日支付。
- 2、本基金最后运作日应付管理人报酬 5,937.49 元。该款项已于 2022 年 5 月 10 日支付。

3、本基金最后运作日应付托管费 1,484.39 元。该款项已于 2022 年 5 月 10 日支付。

4、本基金最后运作日应付销售服务费 6,133.36 元。该款项已于 2022 年 5 月 10 日支付。

6、本基金最后运作日其他负债 100,894.69 元，该款项包括应付赎回费 44.93 元，预提信息披露费 15,849.76 元，预提审计费 35,000.00 元，预提持有人大会律师费 40,000.00 元，预提持有人大会公证费 10,000.00 元。其中，应付赎回费已于 2022 年 4 月 27 日、2022 年 4 月 28 日支付，预提持有人大会公证费已于 2022 年 4 月 28 日支付，剩余款项截至报告日暂未支付。

#### （四）本次清算报告期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	清算报告期间：2022-4-27 至 2022-5-13
一、收入	
1、利息收入	1,514.37
其中：存款利息收入	1,457.30
备付金利息收入	35.87
保证金利息收入	21.20
2、投资收益（损失以“-”填列）	-955,862.03
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	1,085,180.96
4、其他收入（损失以“-”填列）	146.22
二、费用	
1、管理人报酬	-
2、托管费	-
4、销售服务费	-
5、税金及附加	-
6、其他费用	20,065.00
其中：清算审计费	20,000.00
银行汇划费	65.00
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	110,914.52
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	110,914.52

## (五) 截至本次清算报告期结束日的剩余财产情况

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 4 月 26 日基金净资产	13,097,151.58
加：清算报告期间净收益	110,914.52
加：清算期间收到申购款	-
减：清算期间支付赎回、转出款（含费用）	70,173.41
二、2022 年 5 月 13 日基金净资产	13,137,892.69

本基金于 2022 年 5 月 13 日剩余财产为 13,137,892.69 元，扣除清算结束日未变现资产，2022 年 5 月 13 日首次可供分配净资产为 12,769,479.82 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，按运作终止日基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。由于本基金截至清算结束日（2022 年 5 月 13 日）仍持有未变现资产，故需进行二次清算。本基金将于上述未变现资产全部变现后进入二次清算程序，并将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行二次分配。

## (六) 基金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、律师事务所出具的法律意见书后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

## 五、备查文件

## (一) 备查文件目录

- 1、《平安量化精选混合型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海源泰律师事务所关于平安量化精选混合型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见》

## (二) 存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人住所。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

平安量化精选混合型发起式证券投资基金财产清算小组

二〇二二年五月十八日