

平安量化精选混合型发起式证券投资基金 第二次清算报告

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：二〇二二年九月二十日

清算报告公告日：二〇二二年九月二十一日

目 录

一、基金概况	4
二、基金运作情况	4
三、财务会计报告	5
四、清算情况	5
五、备查文件	7

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。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《平安基金管理有限公司关于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。

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。

本基金第一次清算期间为2022年4月27日至2022年5月13日。本基金的基金管理人于2022年5月18日对《平安量化精选混合型发起式证券投资基金清算报告》进行了公告,并于2022年5月19日支付了首笔清算款。

本基金于2022年5月14日进入第二次清算期间,本次清算期间为2022年5月14日至2022年8月31日。

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	
基金第二次清算结束日（2022年8月31日）基金份额总额	164,102.64 份	
投资目标	在严格控制风险的基础上，本基金通过量化模型进行资产配置、精选股票，力求在有效分散风险的同时实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金在投资过程中主要运用量化投资策略进行投资管理，减少人为主观情绪及个人判断的失误概率，使投资过程富有纪律性和规范性，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。本基金的投资策略主要包括两部分：一是，采取数量化方法，运用行业轮动投资时钟的资产配置策略，确定资产配置的具体比例；二是，在股票投资过程中，本基金将保持通过模型选股构建股票投资组合的投资策略，强调投资纪律、降低随意性投资带来的风险，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。	
下属分级基金的基金简称	平安量化精选混合 A	平安量化精选混合 C
下属分级基金的交易代码	005486	005487
基金第二次清算结束日（2022年8月31日）下属分级基金的份额总额	34,772.28 份	129,330.36 份

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》、平安基金管理有限公司于 2022 年 4 月 26 日发布的《平安基金管理有限公司关于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》以及平安基金管理有限公司于 2022 年 5 月 18 日发布的《平安量化精选混合型发起式证券投资基金清算报告》，本基金的最后运作日为 2022 年 4 月 26 日，于 2022 年 4 月 27 日起进入清算期。第一次清算期间为自 2022 年 4 月 27 日至 2022 年 5 月 13 日止期间。因本基金第一次清算结束日所持交易性金融资产为流通受限股票，本基金于 2022 年 5 月 14 日起进入第二次清算期间，截至 2022 年 8 月 31 日（基金第二次清算结束日）止，本基金持有的交易性金融资产已全部出售变现。

三、财务会计报告

基金第二次清算结束日资产负债表（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 8 月 31 日（第二次清算结束日）

单位：人民币元

	第二次清算结束日 2022 年 8 月 31 日
资 产：	
银行存款	412,227.99
资产合计	412,227.99
负 债：	
其他负债	20,000.00
负债合计	20,000.00
所有者权益：	
实收基金	164,102.64
未分配利润	228,125.35
所有者权益合计	392,227.99
负债与持有人权益总计：	412,227.99

四、清算情况

本基金的本次清算期间为自 2022 年 5 月 14 日至 2022 年 8 月 31 日止。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）资产处置情况

本基金第二次清算结束日银行存款 412,227.99 元（含应计活期银行存款利息 258.44 元），该款项由基金托管人负责保管。应计活期银行存款利息于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月 21 日（节假日顺延）结算入账，或在账户注销时一次性结清。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尚未收讫的利息。

（三）负债清偿情况

本基金第二次清算结束日其他负债 20,000.00 元，为清算审计费，已于 2022 年 9 月 8 日支付。

（四）第二次清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项 目	2022 年 5 月 14 日至 2022 年 8 月 31 日 清算期间
一、营业总收入	24,096.12
利息收入	1,107.74
其中：存款利息收入	1,107.74
投资收益(损失以“-”填列)	-55,395.19
其中：股票投资收益	-56,899.06
股利收益	1,503.87
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	78,383.57
其他收入(损失以“-”号填列)	
减：二、营业总支出	281.00
其他费用	281.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	23,815.12
减：所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	23,815.12

(五) 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、首次清算结束日(2022年5月13日)基金净资产	13,137,892.69
加：清算报告期间净收益(2022年5月14日至2022年8月31日)	23,815.12
减：首次清算实际划付款(2022年5月19日)	12,769,479.82
二、第二次清算结束日(2022年8月31日)基金净资产	392,227.99

截至第二次清算期结束日 2022 年 8 月 31 日，本基金剩余财产为人民币 392,227.99 元。根据本基金的基金合同约定，依据基金资产清算的分配方案，将基金资产清算后的全部剩余资产扣除基金资产清算费用、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。

自本次清算期结束日次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，后续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（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。

(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。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。

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 2022 年 4 月 27 日(基金最后运作日次日)至 2022 年 8 月 31 日(基金第二次清算结束日)止期间的财务报表及审计报告

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第二次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

二〇二二年九月二十日