

国都量化精选混合型证券投资基金

清算报告

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：二〇二二年十二月八日

清算报告公告日：二〇二三年一月十二日

§ 1 重要提示及目录

§ 1.1 重要提示

国都量化精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由国都证券股份有限公司（以下简称“基金管理人”）担任基金管理人，由兴业银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）担任基金托管人。本基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国都量化精选混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]930 号文）准予注册募集，自 2017 年 12 月 27 日成立并正式运作。

鉴于市场环境的变化，为保护基金份额持有人利益，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》的有关规定和《国都量化精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”）的约定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，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，审议并表决通过了《关于终止国都量化精选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告详见 2022 年 11 月 24 日刊登在《中国证券报》、基金管理人网站(www.guodu.com)、中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)上的《国都证券股份有限公司关于国都量化精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》。本基金管理人按照《基金合同》的约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的基金最后运作日定为 2022 年 11 月 24 日，并于 2022 年 11 月 25 日进入清算期。

本基金管理人国都证券股份有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）、上海市通力律师事务所于 2022 年 11 月 25 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，由上海市通力律师事务所对本基金清算事宜出具法律意见书。

§ 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
§1.1 重要提示.....	2
§1.2 目录.....	3
§2 基金产品概况.....	4
§3 基金运作情况.....	6
§4 财务会计报告.....	7
§4.1 资产负债表.....	7
§5 基金财产分配.....	9
§5.1 资产处置情况	9
§5.2 负债清偿情况	9
§5.3 清算期间的清算损益情况.....	10
§5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况	10
§5.5 基金财产清算报告的告知安排.....	11
§6 备查文件目录.....	12
§6.1 备查文件目录.....	12
§6.2 存放地点.....	12
§6.3 查阅方式.....	12

§ 2 基金产品概况

基金名称	国都量化精选混合型证券投资基金
基金简称	国都量化精选
基金主代码	005247
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 27 日
最后运作日（2022 年 11 月 24 日）基金份额总额	350,490.54 份
投资目标	利用量化投资策略和量化工具，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值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过量化策略和工具，对宏观政策、微观行业、市场情绪等方面进行全面研究，再辅以量化系统风险判定模型来确定中短期市场系统风险。通过风险判定模型来调整仓位，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整投资比例，以达到控制下行风险的目标。 本基金的择时主要依据风险判定模型的结果，综合研究机构的市场判断和本公司研究团队的研究结果，同时对量化指标持续跟踪和更新，并应用前沿的量化技术和分析方法，以辅助基金管理人市场的评判。 2、股票投资策略 本基金股票投资组合的构建以国际通行的多因子模型为基础框架，并根据风险约束、交易成本、投资限制等情况进行优化。本基金构建股票组合的基础策略模型包括多因子模型、事件驱动模型和投资组合优化模型。 （1）多因子模型 多因子模型是一套通用的数量化分析框架。在这一框架下，股票收益可分解为一系列因子收益及权重的组合。多因子模型致力于寻找持续稳健的超额收益因子，并进而根据因子收益的预测，形成股票超额收益的预测结果。本基金根据国内证券市场的实际情况，在实证检验的基础上，寻找适合国内市场的因子组合。 本基金所采用的多因子模型主要运用包括价值、质量、动量、市场预期、技术等类型的基本因子，并将根据市场状态的变化和因子研究的更新结论，对多因子模型及其所采用的具体因子进行适度调整。在此基础上，基金管理人将根据市场环境的变化，综合因子的实际表现及影响因子收益的众多信息进行前瞻性研判，适时调整各因子类别的具体组合及权重。 （2）事件驱动模型 事件驱动策略作为多因子策略的补充，是广泛存在于市场中的一类规律性事件。通过研究发现，存在较多事件驱动策略在中国 A 股市场阶段性有效。如研究员一致预期变动策略、上市

	公司业绩超市市场预期策略、股东增持策略、大股东减持策略、指数成份股调整策略等。本基金管理人将在适当的时机选用合适的策略，用于捕捉阶段性的超额收益或绝对收益。 (3) 投资组合优化模型 在形成股票投资组合的构建过程中，本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。投资组合构建完成后，本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况，对投资组合进行相应调整，并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。 3、债券投资策略 债券投资主要用于提高非股票资产的收益率，基金管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。本基金将通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。本基金管理人密切关注通胀、利率、期限、流动性、税收等因素，实时确定各债券品种的公允价值。通过配置不同类别和期限的债券品种，达到债券组合的收益率目标。 4、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本公司在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。 5、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。 6、权证投资策略 本基金的权证投资以控制风险、平滑收益、锁定利润为主要目的。本基金通过对权证标的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑其的流动性，谨慎投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。
基金管理人	国都证券股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况概述

国都量化精选混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会《关于准予国都量化精选混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]930号文）准予注册募集，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于2017年12月6日至2017年12月21日期间向社会公开募集，基金合同于2017年12月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总数为271,620,689.30份（含募集期间利息结转的份额）。

自2017年12月27日至2022年11月24日期间，本基金按基金合同正常运作。

鉴于市场环境的变化，为保护基金份额持有人利益，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》的有关规定和《基金合同》的约定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，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，审议并表决通过了《关于终止国都量化精选混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金的基金最后运作日定为2022年11月24日，并于2022年11月25日进入清算期。

§ 4 财务报表

§ 4.1 资产负债表

基金最后运作日资产负债表

会计主体：国都量化精选混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 11 月 24 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2022 年 11 月 24 日
资产：	
银行存款	112,643.79
结算备付金	302.61
存出保证金	2,369.61
交易性金融资产	141,362.00
其中：股票投资	141,362.00
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	
其他资产	
资产合计	256,678.01
负债和所有者权益	
负债：	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	
应付赎回款	
应付管理人报酬	264.79
应付托管费	26.49
应付销售服务费	-
应付交易费用	51.43
应付税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	4,493.60
负债合计	4,836.31
所有者权益：	
实收基金	350,490.54
未分配利润	-98,648.84

所有者权益合计	251,841.70
---------	------------

注：本报告期的基金财务会计报告经信永中和会计师事务所审计，注册会计师颜凡清/齐晓瑞签字出具了 XYZH/2022BJAB2B0011 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

本基金于 2022 年 11 月 25 日进入清算期。

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，资产负债按清算价格计价。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。

自 2022 年 11 月 25 日至 2022 年 12 月 8 日止的清算期间，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：

§ 5.1 资产处置情况

5.1.1. 本基金最后运作日银行存款余额为人民币 112,643.79 元，清算期间银行存款净流入人民币 140,625.49 元，于清算期结束日银行存款余额为人民币 253,269.28 元。

5.1.2 本基金最后运作日交易型金融资产为 141,362.00 元，清算期内交易型金融资产均已变现，期结束日余额为人民币零元。

5.1.3 本基金最后运作日 2022 年 11 月 24 日应收利息余额为人民币 232.6 元；清算期间计提应收银行存款利息人民币 19.15 元、应收结算备付金利息人民币 0.14 元、应收存出保证金利息人民币 1.47 元；清算期结束日应收利息余额为人民币 253.36 元；该款项以及至清算划款日前一日产生的后续利息，归基金持有人所有。清算划款日当日基金管理人以自有资金垫付未结息部分金额，划入托管账户。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。

§ 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 0 元，均于清算期间支付，于清算结束日应付赎回款余额为零。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 264.79 元，均于清算期间支付，于清算结束日应付管理人报酬余额为零。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 26.49 元，均于清算期间支付，于清算结束日应付托管费余额为零。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0 元，均于清算期间支付，于清算结束日

应付交易费用余额为零。

5.2.5 本基金最后运作日应付佣金为人民币 51.43 元，清算期内产生交易佣金 78.46 元，均于清算期间支付，于清算结束日应付佣金余额为零。

5.2.6 本基金最后运作日应付审计费用为人民币 4,493.60 元，基金管理人考虑到本基金剩余资产较少，决定由管理人自行承担本基金审计相关费用，不再由基金资产承担，于清算结束期内预提费用反冲，清算结束日应付审计费用余额为零。

§ 5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2022 年 11 月 24 日至 2022 年 12 月 8 日止（清算期间）
一、清算期间收益	-574.28
存款利息收入	19.15
债券利息收入	-
结算备付金、存出保证金利息收入	1.61
买入返售金融资产利息收入	-
投资收益	-23,190.29
公允价值变动收益	22,595.25
其他业务收入	-
二、清算期间费用	-4,483.60
管理人报酬	-
托管费	-
销售服务费	-
利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
税金及附加	-
其他费用	-4,483.60
三、清算期间净收益	3,909.32

注：此处的其他收入为赎回费收入。

§ 5.4 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 2022 年 11 月 24 日基金净资产	251,841.70
加：清算期间净收益	3,909.32
二、清算期结束日 2022 年 12 月 8 日基金净资产	255,751.02

资产处置及负债清偿后，本基金清算期结束日 2022 年 12 月 8 日的剩余财产为人民币为 255,751.02 元。自清算期结束日次日 2022 年 12 月 9 日起至清算款划出日前一日的产生的利息属份额持有人所有，由基金管理人以自有资金垫付并划入托管账户。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。

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。后续由于清算支付过程中所产生的划款手续费由剩余资产承担。

§ 5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金管理人审核、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，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

§ 6.1 备查文件目录

- 1、国都量化精选混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、关于《国都量化精选混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

§ 6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

§ 6.3 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，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人客服热线 400-818-8118。

国都量化精选混合型证券投资基金基金财产清算小组

2022 年 12 月 8 日