

银河量化配置混合型证券投资基金清算 报告

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2018年9月28日

§1 重要提示

银河量化配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河量化配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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[2017]1002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203,187,219.08份。基金合同于2018年2月11日正式生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《银河量化配置混合型证券投资基金招募说明书》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,包括国内依法发行上市的股票(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、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单)、权证、股指期货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:本基金股票资产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需缴纳的交易保证金后,现金或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;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×80%+中证综合债券指数

收益率×20%。

清算原因：根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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》和基金合同的有关规定，终止基金合同。根据基金合同第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；”根据基金管理人2018年8月11日发布的《银河基金管理有限公司关于银河量化配置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的公告》，本基金基金份额持有人大会于2018年8月9日表决通过了《关于终止银河量化配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，大会决议自该日起生效。根据《关于终止银河量化配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》及《关于终止银河量化配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》，本基金最后运作日为2018年8月12日，自2018年8月13日进入清算程序。

基金管理人银河基金管理有限公司、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2018年8月13日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金简称	银河量化配置混合
基金主代码	005385
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月11日
报告期末(2018年8月12日)基金份额总额	3,668,631.98份
投资目标	本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资，在严格控制风险的前提下，力求

	基金资产长期、稳定的增值。
投资策略	本基金将运用量化选股模型，以量化多因子选股、事件驱动选股策略为主，辅以量化行业配置、套利策略等多个策略，力求寻找基本面良好，并能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。同时，本基金也将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+ 中证综合债券指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的基金品种，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

银河量化配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河量化配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“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[2017]1002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203,187,219.08份。基金合同于2018年2月11日正式生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。根据基金管理人2018年8月11日发布的《银河基金管理有限公司关于银河量化配置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的公告》，本基金基金份额持有人大会于2018年8月9日表决通过了《关于终止银河量化配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，大会决议自该日起生效。根据《关于终止银河量化配置混合型证券投资基金基金合同有关事

项的议案》及《关于终止银河量化配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的说明》，本基金最后运作日为2018年8月12日，自2018年8月13日进入清算程序。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。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：银河量化配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年8月12日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2018年8月12日
资 产：	
银行存款	1,694,057.50
结算备付金	220,454.55
存出保证金	1,154.59
交易性金融资产（债券投资）	2,014,000.00
买入返售金融资产	800,000.00
应收利息	29,360.25
资产总计	4,759,026.89
负债和所有者权益	最后运作日 2018年8月12日
负 债：	
应付赎回款	35,950.22
应付证券清算款	800,000.00
应付管理人报酬	2,993.96
应付托管费	499.01
其他负债	169,578.84
负债合计	1,009,022.03

所有者权益：	
实收基金	3,668,631.98
未分配利润	81,372.88
所有者权益合计	3,750,004.86
负债和所有者权益总计	4,759,026.89

注：本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师蒋燕华、费泽旭签字出具了安永华明(2018)专字第 60821717_B01 号标准无保留意见的审计报告。

§5 基金财产分配

自 2018 年 8 月 13 日至 2018 年 8 月 21 日止清算期间，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 本基金最后运作日结算备付金为人民币 220,454.55 元，为存放于上海证券交易所(以下简称“上交所”)的结算备付金。该款项由基金管理人银河基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 8 月 20 日划入托管账户。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。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金为人民币 1,154.59 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算保证金。该款项由基金管理人银河基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 8 月 20 日划入托管账户。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。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 2,014,000.00 元，明细如下：

证券 代码	证券 名称	交易 市场	终止日 估值单价	数量 (单位：张)	终止日 成本总额	终止日 估值总额
018005	国开 1701	上交所	100.70	20,000	2,004,663.92	2,014,000.00

根据《银河量化配置混合型证券投资基金基金合同》第十四部分“基金资产估值”的约定，对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定

的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。证券国开 1701 最后运作日的估值单价为前一交易日中证估值净价。该证券已于 2018 年 8 月 13 日全部出售，成交金额人民币 2,013,606.90 元，变现款项已于 2018 年 8 月 14 日划入托管账户。

5.1.4 本基金最后运作日买入返售金融资产为人民币 800,000.00 元，明细如下：

证券 代码	证券 名称	交易 市场	成交数量	成交金额	回购收益
204001	GC001	上交所	8,000	800,000.00	50.19

该买入返售金融资产已于 2018 年 8 月 13 日到期，成交金额人民币 800,050.19 元，变现款项已于 2018 年 8 月 14 日划入托管账户。

5.1.5 应收利息：截至本基金最后运作日银行存款利息人民币 1,139.86 元，应收备付金利息人民币 1,499.2 元，应收保证金利息人民币 2.29 元，应收债券利息（暂未变现债券国开 1701）人民币 26,718.9 元且已于 2018 年 8 月 14 日划入托管账户；合计人民币 29,360.25 元；其中银行存款利息、应收备付金利息、应收保证金利息款项由基金管理人以自有资金垫付，管理人垫资款项已于 2018 年 8 月 20 日划入托管账户，后期由管理人的垫资款孳生的利息将于清算期后与垫资款一并返还给基金管理人。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 应付证券清算款：截至本基金最后运作日应付证券清算款人民币 800,000.00 元，该款项已于 2018 年 8 月 13 日支付。

5.2.2 应付赎回款：截至本基金最后运作日应付赎回款人民币 35,950.22 元，款项已于 2018 年 8 月 13 日及 2018 年 8 月 14 日相继支付。

5.2.3 应付管理人报酬：截至本基金最后运作日应付管理人报酬人民币 2,993.96 元，款项已于 2018 年 8 月 16 日支付。

5.2.4 应付托管费：截至本基金最后运作日应付托管费人民币 499.01 元，款项已于 2018 年 8 月 16 日支付。

5.2.5 其他负债：截至本基金最后运作日其他负债合计人民币 169,578.84 元，其中人民币 169,443.36 元，即为预提中国证券报信息披露费、预提上海证券报信息披露费、预提深圳证券时报信息披露费的预提信披费用，待收到其付费通知书及发票再行支付； 应付赎回费人民币 135.48 元已于 2018 年 8 月 13 日、2018 年 8 月 14 日支付。

5.2.6 其他：按照《银河量化配置混合型证券投资基金基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定，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，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。清算期审计费用人民币 20,000.00 元待后续收到审计付费通知书再行支付。依据《银河基金管理有限公司关于银河量化配置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的公告》，此次持有人大会的费用（公证费人民币 15,000.00 元及律师费人民币 40,000.00 元）将由基金财产支付并于 2018 年 8 月 16 日已支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2018年8月13日至2018年8月21日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	1,047.35
2、投资损益	8,942.98
3、公允价值变动损益	-9,336.08
4、交易费用	-2.04
清算收入小计	652.21
二、清算费用	
清算费用小计（注2）	75,000.00
三、清算净收益	-74,347.79

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 8 月 13 日至 2018 年 8 月 21 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息、债券利息与买入返售金融资产收入。截至 2018 年 8 月 16 日止利息收入中人民币 403.62 元已划入托管账户，剩余的款项由基金管理人银河基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2018 年 8 月 20 日划入托管账户。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。

注 2:详见 5.2.6。

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 2018 年 8 月 12 日基金净资产	3,750,004.86
加：清算期间净收益	-74,347.79
减：基金净赎回转出金额（于 2018 年 8 月 13 日确认的投资者赎回转出申请）	0.00
二、2018年8月21日基金资产净值	3,675,657.07

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2018 年 8 月 21 日止属于委托人的剩余财产为人民币 3,675,657.07 元。根据本基金的基金合同及《关于银河量化配置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的公告》，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。

截至 2018 年 8 月 21 日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币 3,890,206.21 元，其中人民币 250,000.00 元系基金管理人代垫的结算备付金、存出保证金以及以当前适用的利率预估的银行存款利息、结算备付金利息、存出保证金利息。

5.5 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，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、银河量化配置混合型证券投资基金 2018 年 8 月 12 日资产负债表及审计报告
- 2、《银河量化配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.galaxyasset.com>。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

银河量化配置混合型证券投资基金
基金财产清算小组

2018年8月21日(清算报告出具日期)