

银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

清算报告

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

清算报告公告日：2018年11月30日

目录

重要提示	3
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	8
五、备查文件	15

重要提示

银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型而来。银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型为本基金已于 2016 年 2 月 5 日经中国证监会证监许可[2016]247 号文准予变更注册，并经基金份额持有人大会表决通过。基金管理人已于 2016 年 4 月 25 日披露了《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》，自公告之日起，《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》失效且《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》、《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

（以下简称“《基金合同》”）等有关规定，本基金基金份额持有人大会于 2018 年 9 月 26 日以通讯方式表决通过了《关于终止银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。本基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告详见刊登在 2018 年 9 月 27 日指定媒介和基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）上的《关于银华量化智慧动力灵活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公告》。

本基金自 2018 年 9 月 28 日起进入财产清算期，基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2018 年 9 月 28 日成立基金财产清算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）对本基金进行清算审计，上海市通力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	银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银华量化智慧动力灵活配置混合
基金主代码	000062
基金运作方式	契约型开放式
基金投资目标	综合使用多种量化策略指导资产配置和选股，在严格控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于证券投资基金中风险和预期收益较高的品种，其风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
基金合同生效日	2016 年 4 月 25 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
登记机构	银华基金管理股份有限公司

二、基金运作情况

本基金由银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型而来。银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型为本基金已于 2016 年 2 月 5 日经中国证监会证监许可[2016]247 号文准予变更注册，并经基金份额持有人大会表决通过。基金管理人已于 2016 年 4 月 25 日披露了《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议

生效的公告》，自公告之日起，《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》失效且《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效，自 2016 年 4 月 25 日至 2018 年 9 月 27 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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》和《基金合同》的有关规定，基金管理人决定终止《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。本基金基金份额持有人大会于 2018 年 9 月 26 日表决通过了《关于终止银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。本基金从 2018 年 9 月 28 日起进入清算期。

三、财务会计报告

1、清算期间

银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金的清算期间为 2018 年 9 月 28 日至 2018 年 10 月 19 日止。

2、清算财务报表的编制基础

本清算财务报表系本基金因基金财产清算而向中国证监会备案及公告清算报告之目的而编制。基于此目的，本清算财务报表系在清算基础上，参照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》厘定的如附注三所述的会计政策和会计估计编制。

清算资产负债表

单位：人民币元

项目	2018年9月27日 (最后运作日)	2018年10月19日 (清算结束日)
资产：		
银行存款	23,494,968.12	38,991,721.27
结算备付金	239,341.48	177,550.49
存出保证金	16,592.72	24,924.73
交易性金融资产	2,003,625.60	1,473,218.21
应收证券清算款	15,849,995.54	0.00
应收利息	1,068.65	18,520.52
资产总计	41,605,592.11	40,685,935.22
负债和净资产		
负债：		
卖出回购金融资产款	-	-
应付赎回款	889.87	0.00
应付管理人报酬	44,745.28	0.00
应付托管费	7,457.52	0.00
应付销售服务费	-	-

应付交易费用	181,047.89	94.22
应付税费	-	-
应付利息	-	-
其他负债	253,000.00	34,700.00
负债合计	487,140.56	34,794.22
净资产	41,118,451.55	40,651,141.00
负债和净资产总计	41,605,592.11	40,685,935.22

清算损益表

单位：人民币元

项目	2018年9月28日(清算开始日) 至 2018年10月19日(清算结束日)
一、 收益	-285,544.35
1、利息收入	17,451.87
2、处置交易性金融资产产生的净损失	-83,931.73
3、股息红利个税	-1,956.47
4、公允价值变动损益	-217,108.02
二、 费用	463.25

1、交易费用	463.25
三、 收益(损失)总额	-286,007.60
减：所得税费用	-
四、 净收益(损失)	-286,007.60

四、清算情况

自2018年9月28日至2018年10月19日止清算期间，基金财产清算组对本基金的资产、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、 根据《关于以通讯方式召开银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，本基金进入清算程序后（即自2018年9月28日起(含2018年9月28日)），停止计提基金管理费、基金托管费。
- 2、 资产处置情况
 - (1) 本基金最后运作日存出保证金为人民币16,592.72元，截至2018年10月19日余额为人民币24,924.73元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。
 - (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币239,341.48元，截至2018年10月19日余额为人民币177,550.49元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。
 - (3) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币15,849,995.54元，该款项已于2018年9月28日划入托管账户。

- (4) 本基金最后运作日应收利息为人民币1,068.65元，包括应收银行存款利息人民币988.01元、应收存出保证金利息人民币5.25元及应收结算备付金人民币75.39元。截至2018年10月19日应收利息余额为人民币18,520.52，其中应收银行存款利息人民币18,212.84元、应收存出保证金利息人民币25.93元及应收结算备付金利息人民币281.75元，该款项将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。
- (5) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币2,003,625.60元，全部为股票投资，明细如下：

其中截至清算期结束日已变现的股票明细如下：

金额单位：人民币元

股票名称	股票代码	最后运作日 估值单价	数量 (单位：股)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
招商银行	600036	30.43	100	2,795.75	3,043.00
国投资本	600061	8.29	100	900.17	829.00
国机汽车	600335	10.43	17,700	194,545.72	184,611.00
方大特钢	600507	10.87	100	1,140.57	1,087.00
无锡银行	600908	5.73	1	5.73	5.73
旗滨集团	601636	4.08	100	432.55	408.00
灵康药业	603669	10.53	100	1,010.00	1,053.00
中集集团	000039	11.83	1	11.01	11.83
华锦股份	000059	7.08	1	6.87	7.08
TCL 集团	000100	2.77	1	2.75	2.77
中联重科	000157	3.73	1	3.66	3.73

阳光城	000671	5.99	1	5.96	5.99
启迪桑德	000826	13.44	1	15.27	13.44
浪潮信息	000977	24.35	1	27.01	24.35
中航光电	002179	43.95	1	42.03	43.95
华天科技	002185	5.09	1	5.27	5.09
信立泰	002294	27.77	1	26.87	27.77
通达动力	002576	8.79	1	8.86	8.79
永兴特钢	002756	13.51	1	13.79	13.51
梅泰诺	300038	9.25	1	15.54	9.25
长信科技	300088	5.06	1	5.64	5.06
智飞生物	300122	48.51	1	45.38	48.51
东方国信	300166	12.40	1	14.47	12.40
通裕重工	300185	1.75	1	1.81	1.75
舒泰神	300204	10.95	1	10.81	10.95
恒华科技	300365	24.62	1	21.82	24.62
全志科技	300458	25.02	1	23.23	25.02
光环新网	300383	14.38	8,481	123,813.63	121,956.78
合计				324,952.17	313,299.37

以上股票投资于2018年9月28日、2018年10月12日及2018年10月17日处置变现，处置损失为人民币83,931.73元，变现产生的证券清算款为人民币227,161.53元，已于2018年10月08日、2018年10月15日及2018年10月18日划入托管账户。

其中截至清算期结束日因重大事项停牌尚未变现的流通受限股票明细如下：

金额单位：人民币元

股票名称	股票代码	最后运作日 估值单价	数量 (单位：股)	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
美的集团	000333	41.61	32,496	1,562,091.30	1,352,158.56
小天鹅 A	000418	46.50	100	5,831.82	4,650.00
云南白药	000538	70.23	2,329	188,515.17	163,565.67
经纬纺机	000666	18.08	9,400	179,007.51	169,952.00
*ST 华泽	000693	0.00	332	8,363.53	0.00
合计				1,943,809.33	1,690,326.23

待停牌股票变现后，基金管理人将于第二次清算时再向基金份额持有人分配。截至2018年10月19日，本基金持有停牌股票尚未复牌。

3、 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日的应付赎回款人民币889.87元、应付管理人报酬人民币44,745.28元、应付托管费人民币7,457.52元和应付交易费用人民币181,047.89元，已于清算期内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币253,000.00元, 包含预提信息披露费人民币209,000.00元; 预提审计费人民币30,000.00元, 预提2018年第三季度及第四季度的账户维护费人民币14,000.00元。其中预提信息披露费已于2018年10月09日支付; 预提第三季度的账户维护费人民币9,300元已于2018年10月19日支付, 其余将于清算结束后支付。

单位：人民币元

项目	2018年9月28日至2018年10月19日 止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	17,451.87
处置交易性金融资产产生的净损失（注2）	-83,931.73
股息红利个税（注3）	-1,956.47
公允价值变动损益（注4）	-217,108.02
清算期间收益小计	-285,544.35
二、清算期间费用	
交易费用	463.25
清算期间费用小计（注5）	463.25
三、清算期间净损失	-286,007.60

注1：利息收入系计提的自2018年9月28日至2018年10月19日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息。

注2：处置交易性金融资产产生的净损失系清算期间卖出股票成交金额减去卖出股票最后运作日的股票估值总额后的差额。

注3：股息红利个税系根据《股息红利差别化纳税会计核算细则》（中基协发[2012]21号），于最后运作日转让交割股票后的次一交易日，

根据中登公司按投资者实际持股期限计算的应缴税额计提应缴税款而确认的红字股利收益。

注4：公允价值变动损益系因重大事项停牌而未能变现的流通受限股票采用指数收益法估值，而产生公允价值变动。

注5：除上述清算费用外的其他与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

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
最后运作日 2018 年 9 月 27 日基金净资产	41,118,451.55
减：清算期间净损失	286,007.60
减：基金净赎回金额（于 2018 年 9 月 28 日确认的投资者赎回申请）	181,302.95
2018 年 10 月 19 日基金净资产	40,651,141.00

资产处置及负债清偿后，于2018年10月19日本基金剩余财产为人民币40,651,141.00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。

2018年10月19日本基金剩余财产为人民币40,651,141.00元，其中尚未划回的存出保证金、结算备付金人民币202,475.22元；尚未变现的交易性金融资产人民币1,473,218.21元（该金额为停牌股票清算终止日估值金额，与停牌股票资产复牌后实际变现金额可能存在差异），应收银行存款、存出保证金、结算备付金的利息人民币18,520.52元。上述剩余未变现的资产将根据变现情况在第二次清算时按基金份额持有人持有的基金份额比率进行分配。

自清算期结束日次日2018年10月20日至本次清算款划出前一日银行存款利息亦属份额持有人所有，将在第二次清算时按基金份额持有人持有的基金份额比率分配。

五、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于〈银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金清算报告〉的法律意见》

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

基金财产清算组

二〇一八年十一月三十日

