

鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资 基金清算报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

公告日期：2019年10月29日

一、重要提示

鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金(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[2016]2250号文准予募集注册,于2017年5月25日成立并正式运作。本基金基金管理人为鹏华基金管理有限公司,本基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为维护基金份额持有人利益,基金管理人根据《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《鹏华新科技传媒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”),提议终止基金合同。本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开,会议已于2019年9月3日表决通过了《关于终止鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》,自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。

本基金从2019年9月5日起进入清算期,由本基金管理人鹏华基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所组成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)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称	鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华新科技传媒混合
基金主代码	004514
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年5月25日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
最后运作日（2019年9月4日）基金份额总额	17,211,472.48份
最后运作日（2019年9月4日）基金份额净值	1.0010元

2、基金产品说明

投资目标	有效控制风险的前提下，精选新科技传媒主题企业进行投资，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略 本基金所指的新科技传媒主题企业具有以下特点：1、所处领域是科技创新和文化传媒的前沿行业；2、拥有创新的产品、服务或营销方式等，符合未来科技创新和文化发展方向，具有较长的生命力，并可能改变人们未来的生活方式；3、创造新的商业模式，并带来经营理念、生产技术、营销体系的改变，从而为企业产生实际效益。 本基金将通过系统和深入的基本面研究，密切关注新科技传媒主题相关行业及公司，分享中国经济增长模式转变带来的投资机会。包括但不限于大数据、云计算、量子通信、虚拟现实、人工智能、无人驾驶、精准医疗、物联网、智慧农业、电影电视、动漫游戏、新闻传播、文化教育、体育竞技、广告会展等等。除上述行业之外，如果某些细分行业和公司同样符合新科技传媒主题的定义，本基金也会酌情将其纳入新科技传媒主题的投资范围。 未来如果基金</p>

管理人认为有更适当的新科技传媒主题划分标准，基金管理人有权对新科技传媒主题的界定方法进行变更，并在招募说明书更新中公告，不需召开持有人大会。若因基金管理人界定新科技传媒主题的方法调整或者上市公司经营发生变化等原因导致本基金持有的新科技传媒主题相关公司发行的证券的比例低于非现金基金资产的 80%，本基金将在十个交易日之内进行调整。

3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

(1) 久期策略 本基金将主要采取久期策略，通过自上而下的组合久期管理策略，以实现组合利率风险的有效控制。为控制风险，本基金采用以“目标久期”为中心的资产配置方式。目标久期的设定划分为两个层次：战略性配置和战术性配置。“目标久期”的战略性配置由投资决策委员会确定，主要根据对宏观经济和资本市场的预测分析决定组合的目标久期。“目标久期”的战术性配置由基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的范围内进行调整。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，直至接近目标久期上限，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，直至目标久期下限，以减小债券价格下降带来的风险。

(2) 收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

(3) 骑乘策略 本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。

(4) 息差策略 本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。

(5) 个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

(6) 信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未

	<p>来信用利差可能下降的信用债进行投资。 4、权证投资策略 本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。 5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。 6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。 7、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证 TMT 产业主题指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%</p>
风险收益特征	<p>本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。</p>

三、基金运作情况

1、基金基本情况

鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金(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”)《关于准予鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2250号文)批准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集，基金合同于2017年5月25日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金

合同生效日基金份额总额为 217,767,116.37 份。本基金基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

自 2017 年 5 月 25 日至 2019 年 9 月 4 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

2、清算原因

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”约定：“有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、《基金合同》约定的其他情形；4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况”。

根据市场环境变化，为维护基金份额持有人利益，基金管理人根据《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，提议终止基金合同。本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议已于 2019 年 9 月 3 日表决通过了《关于终止鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。

3、清算起始日

本基金从 2019 年 9 月 5 日起进入清算期，清算期间为 2019 年 9 月 5 日至 2019 年 9 月 12 日。

4、清算报表编制基础

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。

四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 9 月 4 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2019 年 9 月 4 日
资 产：	
银行存款	17,440,562.29

结算备付金	115,000.00
存出保证金	18,985.44
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	25,059.89
应收股利	-
应收申购款	2,589.46
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	17,602,197.08
负债和所有者权益	最后运作日 2019年9月4日
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	248,944.84
应付管理人报酬	2,919.33
应付托管费	486.56
应付销售服务费	-
应付交易费用	21,762.50
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	100,004.81
负债合计	374,118.04
所有者权益：	
实收基金	17,211,472.48
未分配利润	16,606.56
所有者权益合计	17,228,079.04
负债和所有者权益总计	17,602,197.08

注：报告截止日 2019 年 9 月 4 日(基金最后运作日)，基金份额净值 1.0010 元，基金份额总额 17,211,472.48 份。

五、清算情况

在清算期间，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：

1、清算费用

按照基金合同“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。

2、资产处置情况

(1) 备付金、保证金、应收款和其他资产处置情况

序号	项目	运作终止日账面价值	清算金额	清算期期末账面价值
1	结算备付金	115,000.00		115,000.00
2	存出保证金	18,985.44	-	18,985.44
3	应收利息（注）	25,059.89	2,215.50	27,275.39
4	应收申购款	2,589.46	-2,589.46	-

注：应收利息不含应收债券利息、应收资产证券化利息和应收买入返售金融资产利息。

(2) 金融资产处置情况

注：截至运作终止日末本基金未持有金融资产。

3、负债清偿情况

序号	项目	运作终止日金额	清算期变动金额(账面价值减少以“-”填列)	清算期期末金额
1	应付赎回款	248,944.84	-248,944.84	-
2	应付管理人报酬	2,919.33	-2,919.33	-
3	应付托管费	486.56	-486.56	-
4	应付交易费用	21,762.50	-21,762.50	-
5	其他负债（注）	100,004.81	-29,769.81	70,235.00

注：其他负债变动为①支付2018年信息披露费30,000.00元；②支付应付赎回费4.81元；③计提银行汇划费235.00元。

4、清算期的清算损益情况

项目	2019年9月5日 至2019年9月12日
一、收入	9,894.26
1. 利息收入	2,215.50
其中：存款利息收入	2,215.50
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）	-
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3. 公允价值变动损益（损失以“-”号填列）	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）（注 ¹ ）	7,678.76
二、费用	479.19
1. 管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用（注 ² ）	479.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	9,415.07
减：所得税费用	-

四、净利润总额（净亏损以“-”号填列）	9,415.07
---------------------	----------

注：1. 其他收入为赎回费收入；

2. 清算期产生银行汇划费 244.19 元，并预提后续清算款划付汇划费 235.00 元。

5、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2019年9月4日基金净资产	17,228,079.04
加：清算期间净收益	9,415.07
加：应付利润结转实收基金金额	-
减：净赎回金额（含费用）	9,766,184.81
二、2019年9月12日基金净资产	7,471,309.30

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。

清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息归基金份额持有人所有。于清算划款日的应收利息余额由基金管理人以自有资金先行垫付，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。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

6、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。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金资产负债表及审计报告；
- (2) 关于《鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

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。

鹏华新科技传媒灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2019年10月29日