

兴业量化精选灵活配置混合型发 起式证券投资基金清算报告

基金管理人：兴业基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

清算报告公告日：2020年11月23日

一、重要提示

兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经 2017 年 8 月 11 日中国证监会证监许可[2017]1482 号文准予募集注册，募集期为 2017 年 11 月 27 日至 2017 年 12 月 18 日。募集结束后，该产品于 2017 年 12 月 26 日获中国证监会机构部函[2017]2920 号文备案后正式成立，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据相关法律法规和《兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金份额持有人大会决定终止《基金合同》的，《基金合同》应当终止。本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，于 2020 年 10 月 28 日表决通过了《关于终止兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金管理人于 2020 年 10 月 30 日发布了《兴业基金管理有限公司关于兴业量化精选灵活配置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》。本基金最后运作日为 2020 年 10 月 30 日，自 2020 年 10 月 31 日起，本基金进入清算期。

由基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和通力律师事务所于 2020 年 11 月 03 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，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：	兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称：	兴业量化混合	
基金主代码：	005133	
基金运作方式：	契约型开放式	
基金合同生效日：	2017 年 12 月 26 日	
基金管理人名称：	兴业基金管理有限公司	
基金托管人名称：	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业量化混合 A	兴业量化混合 C
下属分级基金的交易代码	005133	008218

2、基金产品说明

投资目标	本基金通过计算机算法分析财务、技术因子和互联网大数据，使用多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过综合分析互联网大数据所反映的投资者行为出发，采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略。本基金所指数量化模型是建立在已为国际市场上广泛应用的多因子阿尔法模型的基础上，根据中国资本市场的实际情况，由本基金管理人的

	金融工程团队开发的更具针对性和实用性的多因子阿尔法选股模型。本基金在股票投资过程中将保持模型选股并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，力争实现基金资产长期稳定增值。为降低资本市场系统性风险对基金的影响，基金管理人在综合分析国内外宏观经济形势以及资本市场环境等因素的基础上，在对证券市场中长期走势判断的基础上，采取适度的资产配置策略。在投资过程中，在保持量化模型选股的前提下，基金管理人可以调整、增加、或减少所使用的量化模型。
业绩比较基准	中证800指数收益率×55%+中证综合债券指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

单位：人民币元

	最后运作日 2020年10月30日	清算结束日 2020年11月6日
资产：		
银行存款	22,300,032.57	17,335,116.67
结算备付金	557,063.99	148,750.00
存出保证金	30,199.32	-
应收利息	19,203.61	23,238.71
应收申购款	427.37	-
资产总计	22,906,926.86	17,507,105.38
负债：		
应付赎回款	80,368.55	-
应付管理人报酬	54,988.64	-
应付托管费	7,331.79	-
应付销售服务费	0.12	-
其他负债	87,189.40	86,833.54
负债合计	229,878.50	86,833.54
所有者权益：		
实收基金	19,594,599.62	15,047,798.91
未分配利润	3,082,448.74	2,372,472.93
所有者权益合计	22,677,048.36	17,420,271.84

负债和所有者权益总计	22,906,926.86	17,507,105.38

注：1、本基金最后运作日 2020 年 10 月 30 日，基金份额净值人民币 1.1573 元，基金份额总额 19,594,599.62 份。其中下属 A 类基金份额净值 1.1573 元，基金份额总额 19,591,108.42 份，下属 C 类基金份额净值 1.0446 元，基金份额总额 3,491.20 份。

2、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。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。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

四、清算报表附注

1、基金基本情况

兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金经 2017 年 8 月 11 日中国证监会证监许可[2017]1482 号文准予募集注册，募集期为 2017 年 11 月 27 日至 2017 年 12 月 18 日。募集结束后，该产品于 2017 年 12 月 26 日获中国证监会机构部函[2017]2920 号文备案后正式成立，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。自 2017 年 12 月 26 日起至 2020 年 10 月 30 日止期间，本基金按《基金合同》约定正常运作。

2、清算原因

根据相关法律法规和《基金合同》的有关规定，基金份额持有人大会决定终止《基金合同》的，《基金合同》应当终止。本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，于 2020 年 10 月 28 日表决通过了《关于终止兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。本基金管理人于 2020 年 10 月 30 日发布了《兴业基金管理有限公司关于兴业量化精选灵活配置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》。本基金最后运作日为 2020 年 10 月 30 日，自 2020 年 10 月 31 日起，本基金进入清算期。

3、清算期间

本基金的清算期间为 2020 年 10 月 31 日(清算开始日)起至 2020 年 11 月 6 日(清算结束日)止期间。

4、清算报表编制基础

本清算报表以非持续经营为基础编制。因此，本清算报表列示资产和负债时不再区分流动资产和非流动资产、流动负债和非流动负债，期末资产项目以预计可收回金额列报，负债项目按照需要偿付的金额列报；实收基金和未分配利润以所有者权益项目进行列报。本清算报表仅列示了 2020 年 10 月 30 日(最后运作日)及 2020 年 11 月 6 日(清算结束日)的清算资产负债表和 2020 年 10 月 31 日(清算开始日)至 2020 年 11 月 6 日(清算结束日)止清算期间的清

算损益表及重要报表项目说明，除上述内容外，本基金遵循《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《兴业基金管理有限公司关于兴业量化精选灵活配置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》及《基金合同》的有关规定。

五、清算情况

自 2020 年 10 月 31 日至 2020 年 11 月 06 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：

1、清算费用

按照《兴业量化精选灵活配置混合型发起式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。

2、最后运作日资产处置情况

(1) 本基金最后运作日活期存款人民币 22,300,032.57 元，是存储于基金托管人招商银行股份有限公司的活期银行存款。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 557,063.99 元，将根据中国证券登记结算公司关于结算备付金调整规则，于期后划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 30,199.32 元，于 2020 年 11 月 3 日划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日应收利息人民币 19,203.61 元，其中包括活期银行存款利息人民币 18,551.90 元、应收清算备付金利息人民币 603.19 元、应收存出保证金利息人民币 48.52 元。应收利息一般于每季度 3 月、6 月、9 月、12 月的 21 日（节假日顺延）结息。

(5) 本基金最后运作日应收申购款为人民币 427.37 元，于 2020 年 11 月 2 日划入托管账户。

3、最后运作日负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 54,988.64 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 7,331.79 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 0.12 元，该款项已于 2020 年 11 月 3 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 80,368.55 元，应付赎回费为 24.08 元，该款项已分别于 2020 年 11 月 2 日、11 月 3 日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 87,189.40 元，包括预提审计费、信息披露费、汇划手续费、应付赎回费。其中预提审计费为人民币 20,000.00 元；预提信息披露费为 66,448.32 元；汇划手续费为人民币 717.00 元；应付赎回费为人民币 24.08 元。

4、最后运作日申购、赎回申请及申购、赎回款支付情况

本基金管理人于 2020 年 11 月 2 日确认的最后运作日申购申请共计 498.13 份，应收申

购款 576.48 元，已于 2020 年 11 月 3 日划入托管账户。

本基金管理人于 2020 年 11 月 2 日确认的最后运作日赎回申请共计 4,542,992.02 份，应付赎回款 5,255,320.93 元，应付赎回费 720.83 元，确认的最后运作日转出申请共计 4,306.82 份，转出金额 4,954.19 元，应付转出费 6.93 元，已于 2020 年 11 月 4 日支付。

5、清算期间的损益情况

单位：人民币元

项目	自 2020 年 10 月 31 日（清算开始日） 至 2020 年 11 月 6 日（清算结束日）
一、清算收入	5,308.80
利息收入（注 1）	4,035.10
差价收入	
公允价值变动损益	
其他收入（注 2）	1,273.70
二、清算费用	385.22
管理人报酬（注 3）	
基金托管费（注 3）	
交易费用	
利息支出	
税金及附加	
其他费用（注 4）	385.22
三、清算净收益	4,923.58

注：

- 1、利息收入系以当前适用利率预估计提的自 2020 年 10 月 31 日(清算开始日)至 2020 年 11 月 6 日(清算结束日)期间的银行存款利息收入人民币 3,929.08 元、存出保证金利息收入人民币 4.08 元，清算备付金利息收入 101.94 元，共计人民币 4,035.10 元。
- 2、其他收入系自 2020 年 10 月 31 日(清算开始日)至 2020 年 11 月 6 日(清算结束日)期间确认的赎回费收入 1,250.54 元和转换费收入 23.16 元，共计人民币 1,273.70 元。
- 3、根据《兴业基金管理有限公司关于兴业量化精选灵活配置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 2020 年 10 月 31 日起，停止收取基金管理费、基金托管费、基金销售服务费。
- 4、其他费用系自 2020 年 10 月 31 日(清算开始日)至 2020 年 11 月 6 日(清算结束日)止清算期间计提的托管账户扣缴的汇划手续费。

6、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	自 2020 年 10 月 31 日（清算开始日） 至 2020 年 11 月 6 日（清算结束日）
一、最后运作日 2020 年 10 月 30 日基金净资产	22,677,048.36
加：清算期间净收益	4,923.58

加：最后运作日有效申购申请对应金额	576.48
减：最后运作日有效赎回及转出申请对应金额	5,262,276.58
二、2020年11月6日基金净资产	17,420,271.84

资产处置及负债清偿后，2020年11月6日本基金剩余财产为人民币17,420,271.84元，根据本基金的《基金合同》约定，依据基金从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、缴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。

2020年11月6日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。

为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，若于基金剩余财产划出日尚未收到结算备付金及应收利息，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项，供清盘分配使用。结息尾差由基金管理人承担。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。

7、基金财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后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) 《兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.cib-fund.com.）查阅。

3、查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金财产清算小组
2020年11月23日