

东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金  
清算报告

基金管理人：东兴证券股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年4月26日

清算报告公告日：2021年5月19日

## 目录

|               |   |
|---------------|---|
| 重要提示.....     | 3 |
| 一、基金概况.....   | 4 |
| 二、基金运作情况..... | 5 |
| 三、财务会计报告..... | 6 |
| 四、清算情况.....   | 8 |
| 五、备查文件.....   | 9 |

## 重要提示

东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已于 2016 年 8 月 2 日获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]1744 号文准予注册，自 2016 年 10 月 27 日起《东兴量化多策略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》”或“基金合同”）生效，基金管理人为东兴证券股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条的规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同”；第八十条规定，“有下列情形之一的，基金合同终止：（二）基金份额持有人大会决定终止”。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”的“二、基金合同的终止事由”中约定，“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”。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》，基金管理人已于 2021 年 3 月 8 日刊登了《东兴证券股份有限公司关于以通讯方式召开东兴量化多策略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》，并于 2021 年 3 月 9 日、2021 年 3 月 10 日陆续刊登了提示性公告。本次基金份额持有人大会于 2021 年 4 月 12 日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效，基金管理人于 2021 年 4 月 14 日刊登了《东兴量化多策略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的公告》。

本基金自 2021 年 4 月 15 日起进入财产清算期，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）和北京市天元律师事务所于 2021 年 4 月 15 日成立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）对本基金进行清算审计，北京市天元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    | 东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金   |
| 基金简称    | 东兴量化多策略混合  |
| 基金代码    | 003208   |
| 基金运作方式  | 契约型开放式   |
| 基金投资目标  | 本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。     |
| 业绩比较基准  | 中证 800 指数收益率*65%+中证综合债券指数收益率*35%                             |
| 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，属于中高风险水平的投资品种。 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 10 月 27 日   |
| 基金管理人   | 东兴证券股份有限公司   |
| 基金托管人   | 中国工商银行股份有限公司   |
| 注册登记机构  | 东兴证券股份有限公司   |

## 二、基金运作情况

东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2016 年 8 月 2 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]1744 号）的批复，自 2016 年 9 月 5 日至 2016 年 10 月 21 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 213,068,816.51 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2016]01460027 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 10 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 213,097,758.90 份，其中认购资金利息折合 28,942.39 份。自本基金基金合同生效日起至最后运作日止期间，本基金按基金合同约定正常运作。

为召集基金份额持有人大会审议《关于终止东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》，基金管理人已于 2021 年 3 月 8 日刊登了《东兴证券股份有限公司关于以通讯方式召开东兴量化多策略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》。

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》、《基金合同》等有关规定，经本基金份额持有人大会 2021 年 4 月 12 日表决通过，决定终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序。基金管理人已就该事项于 2021 年 4 月 14 日刊登了《东兴量化多策略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的公告》。

本基金自 2021 年 4 月 15 日起进入财产清算期，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）和北京市天元律师事务所于 2021 年 4 月 15 日成立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）对本基金进行清算审计，北京市天元律师事务所对清算事宜出具法律意见。

### 三、财务会计报告

基金清算资产负债表（已经审计）

会计主体：东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年4月26日（清算结束日）及2021年4月14日（最后运作日）

单位：人民币元

| 项目                | 2021年4月26日<br>(清算结束日) | 2021年4月14日<br>(最后运作日) |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| <b>资产：</b>        |                       |                       |
| 银行存款              | 4,277,258.82          | 4,339,525.63          |
| 结算备付金             | 24,782.61             | 24,782.61             |
| 存出保证金             | 1,799.99              | 1,799.99              |
| 应收利息              | 1,623.84              | 1,108.98              |
| <b>资产总计</b>       | <b>4,305,465.26</b>   | <b>4,367,217.21</b>   |
| <b>负债：</b>        |                       |                       |
| 应付赎回款             | -                     | 47,259.76             |
| 应付管理人报酬           | -                     | 2,708.01              |
| 应付托管费             | -                     | 451.34                |
| 应付交易费用            | -                     | 5,500.81              |
| 其他负债              | 103.33                | 15,017.24             |
| <b>负债合计</b>       | <b>103.33</b>         | <b>70,937.16</b>      |
| <b>所有者权益：</b>     |                       |                       |
| 实收基金              | 4,841,084.85          | 4,837,707.98          |
| 未分配利润             | -535,722.92           | -541,427.93           |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>4,305,361.93</b>   | <b>4,296,280.05</b>   |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>4,305,465.26</b>   | <b>4,367,217.21</b>   |

注：1、本基金最后运作日为2021年4月14日，基金份额净值为0.8881元，基金份额总额为4,837,707.98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。基金管理人编制清算报表是为了呈报东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金全体持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。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。

### 基金清算损益表（已经审计）

会计主体：东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年4月15日(清算开始日)至2021年4月26日(清算结束日)止期间

单位：人民币元

| 项目                     | 2021年4月15日(清算开始日)至<br>2021年4月26日(清算结束日)止期间 |
|------------------------|--|
| <b>一、收入</b>            | <b>541.05</b>                              |
| 1. 利息收入                | 514.86                                     |
| 其中：存款利息收入              | 514.86                                     |
| 2. 投资收益(损失以“-”填列)      | -  |
| 其中：股票投资收益              | -  |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -  |
| 4. 其他收入                | 26.19                                      |
| <b>二、费用</b>            | <b>-5,541.83</b>                           |
| 1. 管理人报酬               | -  |
| 2. 基金托管费               | -  |
| 3. 交易费用                | -  |
| 4. 其他费用                | -5,541.83                                  |
| <b>三、利润总额</b>          | <b>6,082.88</b>                            |
| 减：所得税费用                | -  |
| <b>四、净利润</b>           | <b>6,082.88</b>                            |

## 四、清算情况

自2021年4月15日至2021年4月26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、资产处置情况

(1) 本基金2021年4月14日(最后运作日)及2021年4月26日(清算结束日)银行存款均为存放于基金托管人中国工商银行股份有限公司的活期存款。

(2) 本基金2021年4月14日(最后运作日)应收利息为人民币1,108.98元，包括应收银行存款利息人民币1,093.74元、应收结算备付金利息人民币13.80元、应收存出保证金利息人民币1.44元。截至2021年4月26日(清算结束日)应收利息余额为人民币1,623.84元，包括应收银行存款利息人民币1,594.20元、应收结算备付金利息人民币27.24元、应收存出保证金利息人民币2.40元。2021年4月27日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息亦属份额持有人所有。

(3) 为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将在清算款划出托管账户前以自有资金先行垫付尚未返还的结算备付金、存出保证金和应收利息(该金额可能与实际结息金额存在略微差异)，供清盘分配使用。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。

### 2、负债清偿情况

(1) 本基金2021年4月14日(最后运作日)的应付赎回款为人民币47,259.76元，应付管理人报酬为人民币2,708.01元，应付托管费为人民币451.34元，应付交易费用为人民币5,500.81元，以上款项均已于清算期间支付。

(2) 本基金2021年4月14日(最后运作日)的其他负债中人民币2.11元为应付赎回费，已于清算期间内支付；人民币5,698.16元为每日预提的审计费，该审计费由基金管理人承担，已在清算期间冲销；人民币9,316.97元为每日预提的信息披露费，已于清算期间支付。2021年4月26日(清算结束日)的其他负债为人民币103.33元，均为其他应付款。

### 3、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

| 项目                            | 金额           |
|-------------------------------|--------------|
| 一、2021年4月14日（最后运作日）所有者权益      | 4,296,280.05 |
| 加：清算期间净收益                     | 6,082.88     |
| 加：基金净申购金额(2021年4月15日确认的投资者申请) | 2,999.00     |
| 二、2021年4月26日(清算结束日)所有者权益      | 4,305,361.93 |

资产处置及负债清偿后，2021年4月26日(清算结束日)本基金剩余财产人民币4,305,361.93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。

2021年4月27日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金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，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）供清盘分配使用。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。

#### 4、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，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

## 五、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、《东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》
- 2、《关于〈东兴量化多策略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。

东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

基金财产清算小组

二〇二一年四月二十六日