

# 银河臻选多策略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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2022年2月10日

## § 1 重要提示

银河臻选多策略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》、《银河臻选多策略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[2019]2217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216,793,316.62份。基金合同于2020年5月9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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

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,经履行相关程序后,《基金合同》应当终止:1、基金份额持有人大会决定终止的;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。”

根据基金管理人2021年12月10日发布的《银河基金管理有限公司关于银河臻选多策略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》,本次基金份额持有人大会于2021年12月9日表决通过了《关于终止银河臻选多策略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。

根据《银河基金管理有限公司关于银河臻选多策略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》,本基金最后运作日为2021年12月10日,自2021年12月13日起进入清算期。

由基金管理人银河基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2021年12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,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	银河臻选多策略混合
交易代码	006945
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2020年5月9日	
报告期末(2021年12月10日)基金份额总额	1,006,674.62份	
下属分级基金的基金简称:	银河臻选多策略混合 A	银河臻选多策略混合 C
下属分级基金的交易代码:	006945	008387
报告期末(2021年12月10日)下属分级基金的份额总额:	549,484.87份	457,189.75份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产持续稳定增值。	
投资策略	<p>本基金在综合分析多方面因素的基础上,将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间进行配置,同时采取积极主动的股票投资和债券投资策略,严格控制下行风险,力争实现基金份额净值的长期平稳增长。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法,综合分析宏观经济面、政策面、市场面等多种因素以及证券市场的演化趋势,评估股票、债券等各类资产的预期收益和风险,在投资比例限制范围内,确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的比例。本基金考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率,居民消费价格指数(CPI),生产者价格指数(PPI),货币供应量(M0, M1, M2)的增长率等指标;政策面因素包括但不限于货币政策、财政政策、产业政策的变化趋势等;市场因素包括但不限于市场的资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体 P/E、P/B 等指标 相对于长期均值水平的偏离度等。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将主要遵循“自下而上”的分析框架,采用定性分析和定量分析相结合的方法精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票进行投资,以此构建股票组合。</p> <p>3、债券投资策略; 4、资产支持证券投资策略; 5、金融衍生品投资策略:包括(1)股指期货投资策略和(2)国债期货投资策略; 6、存托凭证投资策略。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+上证国债指数收益率×75%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,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	招商银行股份有限公司	

### § 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2019]2217号《关于准予银河臻选多策略混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由基金管理人银河基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2020年5月9日生效，首次设立募集规模为216,793,316.62份基金份额。

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》以及《银河臻选多策略混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，基金份额持有人大会决定终止基金合同，会议决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人应当终止基金合同，并对银河臻选多策略混合型证券投资基金进行变现及实施清算程序。本次基金份额持有人大会于2021年12月9日表决通过了《关于终止银河臻选多策略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，基金管理人于2021年12月10日刊登了《银河基金管理有限公司关于银河臻选多策略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》。本基金的清算期间为2021年12月13日(清算开始日)起至2021年12月31日(清算结束日)止期间。自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

本基金的清算报告仅为供本基金基金管理人用以本基金清算相关监管报送或公告之目的而编制，清算报告以非持续经营为基础编制。因此，清算报告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。清算报告仅列示了2021年12月10日(最后运作日)及2021年12月31日(清算结束日)的清算资产负债表和2021年12月13日(清算开始日)至2021年12月31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》、《银河基金管理有限公司关于银河臻选多策略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》及基金合同的有关规定。

### § 4 财务报告

#### 4.1 资产负债表

会计主体：银河臻选多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月10日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2021 年 12 月 10 日
<b>资 产：</b>	
银行存款	1, 038, 184. 87
结算备付金	12, 272. 73
存出保证金	218. 30
交易性金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	1, 194. 55
应收股利	-
应收申购款	2, 747. 84
资产总计	1, 054, 618. 29
负债和所有者权益	最后运作日 2021 年 12 月 10 日
<b>负 债：</b>	
应付证券清算款	-
应付赎回款	30, 958. 54
应付管理人报酬	183. 75
应付托管费	30. 61
应付销售服务费	13. 38
应付交易费用	-
应交税费	-
其他负债	15, 080. 26
负债合计	46, 266. 54
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	1, 006, 674. 62
未分配利润	1, 677. 13
所有者权益合计	1, 008, 351. 75
负债和所有者权益总计	1, 054, 618. 29

注：1、本基金最后运作日 2021 年 12 月 10 日，银河臻选多策略混合 A 基金份额净值人民币 1.0028 元，基金份额 549,484.87 份；银河臻选多策略混合 C 基金份额净值人民币 1.0003 元，基金份额 457,189.75 份；基金份额总额 1,006,674.62 份。

2、本财务报告已经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师孙维琦、冯适签字出具了德师报(审)字(22)第 S00016 号标准无保留意见的审计报告。

## § 5 基金财产分配

自 2021 年 12 月 13 日至 2021 年 12 月 31 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 12,272.73 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备付金,2022 年 1 月 5 日将全额调回托管户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金为人民币 218.30 元,为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的存出保证金,2022 年 1 月 5 日将全额调回托管户。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为人民币 1,194.55 元。其中,应收银行存款利息人民币 1,166.89 元,应收结算备付金利息人民币 26.85 元,应收存出保证金利息人民币 0.81 元。均已于 2021 年 12 月 21 日结息到账。

5.1.4 本基金最后运作日应收申购款为人民币 2,747.84 元,该款项已于 2021 年 12 月 13 日结转至托管户。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 183.75 元,该款项已于 2021 年 12 月 17 日支付完毕。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 30.61 元,该款项已于 2021 年 12 月 20 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 13.38 元,该款项已于 2021 年 12 月 17 日支付完毕。

5.2.4 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 30,958.54 元,该款项已分别于 2021 年 12 月 13 日、2021 年 12 月 14 日支付完毕。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 15,080.26 元,其中清算审计费为人民币 15,000.00 元,该款项已于 2021 年 12 月 29 日支付。计提的已发生但未支付的划款手续费为人民币 80.01 元,该款项将于 2022 年 1 月 7 日由托管行自动扣收。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

单位:人民币元

项目	自 2021 年 12 月 13 日至 2021 年 12 月 31 日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入(注 1)	201.05
其中:存款利息收入	201.05
债券利息收入	-
2、投资收益	-

3、公允价值变动损益	-
4、其他收入（注2）	9.58
清算收入小计	210.63
二、清算费用	
1、交易费用	-
2、其他费用（注3）	60.00
清算费用小计	60.00
三、清算净收益	150.63

注1：利息收入为2021年12月11日至2021年12月31日期间的银行存款利息收入、结算备付金利息收入、存出保证金利息收入；

注2：其他收入为2021年12月10日发起申请，2021年12月13日确认的赎回费收入；

注3：银行费用为2021年12月13日至2020年12月31日止清算期间划款产生的划款手续费；

注4：根据《银河基金管理有限公司关于银河臻选多策略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》，本次召开基金份额持有人大会的费用（公证费及律师费）将由本基金基金管理人支付，本次基金份额持有人大会费用明细如下：律师费40,000.00元人民币，公证费10,000.00元人民币，合计为50,000.00元人民币。

#### 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2021年12月10日基金净资产	1,008,351.75
加：清算期间净收益	150.63
减：基金净赎回转出金额（于2021年12月13日确认的投资者申购、转入、赎回申请）	-106,400.66
二、2021年12月31日基金资产净值	902,101.72

根据本基金的基金合同及《银河基金管理有限公司关于银河臻选多策略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》，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，各类基金份额按基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2021年12月31日止的剩余财产为人民币902,101.72元。后续划款预计产生的实时银行手续费暂估为人民币35元，扣除以上负债后

实际剩余财产为人民币 902,066.72 元。清算起始日（2021 年 12 月 13 日）至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息、结算备付金利息、交易保证金利息归基金份额持有人所有。托管行已将截至 2021 年 12 月 20 日的利息结算至托管户，自 2021 年 12 月 21 日起的利息暂由基金管理人垫付，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。

截至 2021 年 12 月 31 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 889,588.27 元。

## 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、银河臻选多策略混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告。
- 2、《银河臻选多策略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。

银河臻选多策略混合型证券投资基金基金财产清算小组

2021 年 12 月 31 日(清算报告出具日期)