

银河量化价值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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023年6月8日

§ 1 重要提示

银河量化价值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》、《银河量化价值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[2017]872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439,092,382.00份。基金合同于2017年10月13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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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,在履行相关程序后,《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2023年4月27日发布的《银河基金管理有限公司关于银河量化价值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2023年4月26日表决通过了《关于终止银河量化价值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量化价值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2023年4月27日,自2023年4月28日起进入清算期。

由基金管理人银河基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2023年4月28日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由毕马威华振会计师事务所(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	银河量化价值混合
交易代码	005053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年10月13日

报告期末(2023年4月27日)基金份额总额	6,654,101.38份	
下属分级基金的基金简称:	银河量化价值混合A	银河量化价值混合C
下属分级基金的交易代码:	005053	013026
报告期末(2023年4月27日)下属分级基金的份额总额:	6,570,179.02份	83,922.36份
投资目标	本基金运用量化投资策略进行资产配置和股票投资,在有效控制风险的前提下,力求基金资产长期增值。	
投资策略	1、资产配置策略;2、股票投资策略:本基金将运用量化选股模型,以量化多因子选股、事件驱动选股策略为主,辅以量化行业配置、套利策略等多个策略,力求寻找基本面良好,价值相对低估,波动偏低,能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。同时,本基金也将对基金整体的波动和风险进行控制,力求基金资产长期增值;3、固定收益类资产投资策略;4、金融衍生品投资策略:(1)股指期货投资策略;(2)权证投资策略;5、存托凭证投资策略。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种,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	中国建设银行股份有限公司	

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2017]872号《关于准予银河量化价值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2017年10月13日生效,首次设立募集规模为439,092,382.00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《银河量化价值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,并对银河量化价值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2023年4月26日表决通过了《关于终止银河量化价值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2023年4月27日刊登了《银河基金管理有限公司关于银河量化价值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2023年4月28日(清算开始日)起至2023年5月12

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2023年4月27日(最后运作日)的清算资产负债表和2023年4月28日(清算开始日)至2023年5月12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量化价值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:银河量化价值混合型证券投资基金

报告截止日:2023年4月27日

单位:人民币元

资产	最后运作日 2023年4月27日
资产:	-
银行存款	3,251,488.95
结算备付金	6,134.82
存出保证金	2,979.91
交易性金融资产	74,460.00
其中:股票投资	74,460.00
债券投资	-
买入返售金融资产	-
应收清算款	5,436,811.21
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	8,771,874.89
负债和所有者权益	最后运作日 2023年4月27日
负债:	-
应付清算款	-
应付赎回款	207.61
应付管理人报酬	13,392.44

应付托管费	2,232.07
应付销售服务费	472.30
应付销售费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	15,625.11
负债合计	31,929.53
所有者权益：	-
实收基金	6,654,101.38
未分配利润	2,085,843.98
所有者权益合计	8,739,945.36
负债和所有者权益总计	8,771,874.89

注：1、本基金最后运作日 2023 年 4 月 27 日，银河量化价值混合 A 基金份额净值人民币 1.3180 元，基金份额总额 6,570,179.02 份；银河量化价值混合 C 基金份额净值人民币 0.9608 元，基金份额总额 83,922.36 份；银河量化价值混合基金份额总额 6,654,101.38 份。

2、本财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师王国蓓、汪霞签字出具了毕马威华振审字第 2307051 号无保留意见带强调事项段和其他事项段的审计报告。

§ 5 基金财产分配

自 2023 年 4 月 28 日至 2023 年 5 月 12 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余额为人民币 6,134.82 元。其中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结算备付金为人民币 6,130.06 元，已于 2023 年 5 月 11 日调整。结算备付金利息为人民币 4.76 元。该款项将由基金管理人银河基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 2,979.91 元，其中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为人民币 2,974.83 元，已于 2023 年 5 月 5 日调整。存出保证金利息为人民币 5.08 元。该款项将由基金管理人银河基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.3 本基金最后运作日银行存款中所含活期存款利息为人民币 2,586.53 元，该款项将由基金管理人银河基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金

管理人所有。

5.1.4 本基金最后运作日交易性金融资产余额为人民币 74,460.00 元，其中股票投资余额为 74,460.00 元，该笔金融资产已于 2023 年 04 月 28 日卖出，卖出所得清算款为人民币 73,936.16 元，该笔款项已于 2023 年 5 月 4 日结算回托管户。

5.1.5 本基金最后运作日应收清算款余额为人民币 5,436,811.21 元，该笔款项已于 2023 年 4 月 28 日结算回托管户。

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余额为人民币 13,392.44 元，该款项已于 2023 年 5 月 8 日支付完毕。

5.2.2 本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 2,232.07 元，该款项已于 2023 年 5 月 8 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 472.30 元，该款项已于 2023 年 5 月 8 日支付完毕。

5.2.4 本基金最后运作日其他负债余额为人民币 15,625.11 元。其中预提的清算审计费为人民币 8,013.33 元，该款项将于拿到审计费发票后支付。计提的应付交易费用为应付佣金，合计为人民币 7,611.06 元，该款项已于 2023 年 5 月 8 日支付。计提的应付赎回费为人民币 0.72 元，于 2023 年 4 月 28 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 207.61 元，清算期间支付了应付赎回款人民币 207.61 元，于清算结束日应付赎回款余额为 0.00 元。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2023 年 4 月 28 日至 2023 年 5 月 12 日止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	1,274.84
其中：银行存款利息收入	1,268.61
结算备付金利息收入	3.64
存出保证金利息收入	2.59
债券利息收入	0.00
2、投资收益（注 2）	-444.00
3、公允价值变动损益	0.00
4、其他收入（注 3）	0.04
清算收益小计	830.88

二、清算费用	
1、交易费用（注4）	148.04
2、银行费用（注5）	15.00
清算费用小计	163.04
三、清算净收益	667.84

注1：利息收入为2023年4月28日至2023年5月12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：投资收益为2023年4月28日至2023年5月12日期间股票卖出产生的差价损失；

注3：其他收入为2023年4月28日确认的基金赎回产生的赎回费归资产部分；

注4：交易费用为2023年4月28日至2023年5月12日期间卖出股票产生的应付佣金；

注5：银行费用为2023年4月28日至2023年5月12日期间划款产生的汇款费；

注6：根据《银河基金管理有限公司关于银河量化价值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：律师费人民币40,000.00元，公证费人民币10,000.00元，合计为人民币50,000.00元。

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2023年4月27日基金净资产	8,739,945.36
加：清算期间净收益	667.84
减：基金净赎回转出金额（于2023年4月28日确认的投资者赎回申请）	42,230.64
二、2023年5月12日基金资产净值	8,698,382.56

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量化价值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2023年5月12日止的剩余财产为人民币8,698,382.56元，其中银河量化价值混合A剩余财产为人民币8,617,758.67元，银河量化价值混合C剩余财产为人民币80,623.89元。清算起始日（2023年4月28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、存出保证金利息归基金份额持有人所

有。该款项由基金管理人垫付，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 2023 年 5 月 12 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 8,701,714.50 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、银河量化价值混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告。
- 2、《银河量化价值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.cgf.cn>

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。

银河量化价值混合型证券投资基金基金财产清算小组

2023 年 5 月 12 日(清算报告出具日期)