

银河嘉谊灵活配置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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2024年06月12日

§ 1 重要提示

银河嘉谊灵活配置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》、《银河嘉谊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”)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”)证监许可[2017]999号文注册公开募集。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238,834,855.90份。经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为安永华明(2018)验字第60821717_B01号的验资报告。基金合同于2018年2月6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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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“三、《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2024年5月15日发布的《银河基金管理有限公司关于银河嘉谊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》,本次基金份额持有人大会于2024年5月14日表决通过了《关于终止银河嘉谊灵活配置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嘉谊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》,本基金最后运作日为2024年5月15日,自2024年5月16日起进入清算期。

由基金管理人银河基金管理有限公司、基金托管人交通银行股份有限公司、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2024年5月16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

| | |
|-------|-------------------|
| 基金名称 | 银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 银河嘉谊混合 |
| 基金主代码 | 005459 |

| | | |
|-----------------------------|--|-------------|
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018年2月6日 | |
| 基金管理人 | 银河基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 报告期末（2024年5月15日）基金份额总额 | 999,573.59份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 投资目标 | 本基金在深入的基本面研究的基础上,通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理,力争实现基金资产的持续稳定增值。 | |
| 投资策略 | 1、大类资产配置策略;2、股票投资策略: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;3、债券投资策略:包括利率预期及久期配置策略、类属配置策略、信用债券投资策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略;4、资产支持证券投资策略;5、金融衍生品投资策略:(1)股指期货投资策略;(2)权证投资策略;(3)国债期货投资策略;6、存托凭证投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50% | |
| 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。 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 银河嘉谊混合A | 银河嘉谊混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005459 | 005460 |
| 报告期末（2024年5月15日）下属分级基金的份额总额 | 513,041.42份 | 486,532.17份 |

§ 3 基金运作情况概述

本基金系经中国证监会证监许可[2017]999号《关于准予银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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2018年2月6日生效,首次设立募集规模为238,834,855.90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《银河嘉谊灵活配置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,并对银河嘉谊灵活配置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2024年5月14日表决通过了《关于终止银河嘉谊灵活配置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 2024 年 5 月 15 日刊登了《银河基金管理有限公司关于银河嘉谊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》。本基金的清算期间为 2024 年 5 月 16 日(清算开始日)起至 2024 年 5 月 22 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。

本基金的清算报表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，清算报表以非持续经营为基础编制。因此，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。清算报表仅列示了 2024 年 5 月 15 日(最后运作日)的清算资产负债表和 2024 年 5 月 16 日(清算开始日)至 2024 年 5 月 22 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《银河基金管理有限公司关于银河嘉谊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》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：银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2024 年 5 月 15 日

单位：人民币元

| 资产 | 最后运作日 2024 年 5 月 15 日 |
|-----------------|--------------------------|
| 资产： | |
| 货币资金 | 1,057,748.50 |
| 结算备付金 | 5.98 |
| 存出保证金 | 1,896.16 |
| 交易性金融资产 | - |
| 其中：股票投资 | - |
| 债券投资 | - |
| 买入返售金融资产 | - |
| 应收申购款 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 1,059,650.64 |
| 负债和所有者权益 | 最后运作日 |

| | 2024年5月15日 |
|-------------------|---------------------|
| 负债： | |
| 应付清算款 | - |
| 应付赎回款 | 277.06 |
| 应付管理人报酬 | 266.15 |
| 应付托管费 | 44.35 |
| 应付销售服务费 | 21.26 |
| 应交税费 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付利润 | - |
| 其他负债 | 9,290.16 |
| 负债合计 | 9,898.98 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 999,573.59 |
| 未分配利润 | 50,178.07 |
| 所有者权益合计 | 1,049,751.66 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,059,650.64 |

注：1、截至本基金最后运作日 2024 年 5 月 15 日，银河嘉谊混合 A 基金份额净值 1.0525 元，基金份额总额 513,041.42 份；银河嘉谊混合 C 基金份额净值 1.0477 元，基金份额总额 486,532.17 份。银河嘉谊混合总份额合计为 999,573.59 份。

2、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 2410592 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 2024 年 5 月 16 日至 2024 年 5 月 22 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 清算费用

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，按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.2 资产处置情况

5.2.1 本基金最后运作日货币资金余额为人民币 1,057,748.50 元，其中活期存款为人民币 1,054,421.94 元，应计活期存款利息为人民币 3,326.56 元，该款项未结息部分将由基金管理人以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.2.2 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 5.98 元，均为应计结算备付金利息，该款项将由基金管理人以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.2.3 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 1,896.16 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 1,887.57 元，将于 2024 年 6 月 4 日全额调回托管户。应计存出保证金利息为人民币 8.59 元，该款项未结息部分将由基金管理人以自有资金垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.3 负债清偿情况

5.3.1 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 277.06 元，该款项已于 2024 年 5 月 16 日支付完毕。

5.3.2 本基金最后运作日应付管理人报酬余额为人民币 266.15 元，该款项已于 2024 年 5 月 16 日支付完毕。

5.3.3 本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 44.35 元，该款项已于 2024 年 5 月 16 日支付完毕。

5.3.4 本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 21.26 元，该款项已于 2024 年 5 月 16 日支付完毕。

5.3.5 本基金最后运作日其他负债余额为人民币 9,290.16 元，为预提 2024 年度审计费用并作为清算审计费，该款项将于清算结束后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

| 项目 | 自 2024 年 5 月 16 日至 2024 年 5 月 22 日止清算期间 |
|-------------|---|
| 一、清算收益 | |
| 1、利息收入（注 1） | 146.53 |
| 2、投资收益 | - |
| 3、公允价值变动损益 | - |
| 4、其他收入（注 2） | 5.43 |
| 清算收入小计 | 151.96 |
| 二、清算费用 | |
| 1、其他费用（注 3） | 10.00 |
| 清算费用小计 | 10.00 |
| 三、清算净收益 | 141.96 |

注 1：利息收入为计提的自 2024 年 5 月 16 日至 2024 年 5 月 22 日止清算期间的银行存款利息收入、存出保证金利息收入。该款项将于下一个结息日划入托管账户；

注 2：其他收入为产品赎回费收入人民币 5.43 元。

注 3：其他费用为银行汇款费人民币 10.00 元。

注 4：根据《银河基金管理有限公司关于银河嘉谊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》，本次召开基金份额持有人大会的费用（公证费及律师费）由基金管理人支付，费用明细如下：律师费人民币 25,000.00 元，公证费人民币 10,000.00 元，合计为人民币 35,000.00 元。

5.5 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 2024 年 5 月 15 日基金净资产 | 1,049,751.66 |
| 加：清算期间净收益 | 141.96 |
| 加：基金净申购转入金额 | - |
| 减：基金净赎回转出金额 | 26,290.40 |
| 二、2024 年 5 月 22 日基金资产净值 | 1,023,603.22 |

基金管理人将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嘉谊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》，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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2024 年 5 月 22 日止的剩余财产为人民币 1,023,603.22 元。其中银河嘉谊混合 A 剩余财产为人民币 533,954.80 元，银河嘉谊混合 C 剩余财产为人民币 489,648.42 元。

截至 2024 年 5 月 22 日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户货币资金余额（不含利息）共人民币 1,027,518.15 元。

清算起始日（2024 年 5 月 16 日）至清算款划出日前一日的货币资金产生的利息、结算备付金利息、存出保证金利息归基金份额持有人所有。该款项未结息部分由基金管理人垫付，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。

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、银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、《银河嘉谊灵活配置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住所，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住所免费查阅。

银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2024年5月22日(清算报告出具日期)