

鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资 基金清算报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

公告日期：2019年7月19日

一、重要提示

鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]2346号《关于准予鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2017]1167号《关于同意鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币319,244,389.37元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第582号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年6月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为319,347,198.32份,其中,认购资金利息折合102,808.95份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于2019年5月27日表决通过的《关于终止鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》以及本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于2019年5月28日发布的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华量化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》,本基金从2019年5月29日起进入清算期。

本基金清算期为2019年5月29日至2019年6月5日,由本基金管理人鹏华基金管理有限公司、基金托管人中国建设银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海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 鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金

基金简称 鹏华量化策略混合

基金主代码 004489

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2017年6月21日

基金管理人 鹏华基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

最后运作日(2019年05月28日)基金份额总额 14,914,729.02

最后运作日（2019年05月28日）基金份额净值 0.8793

2、基金产品说明

投资目标 本基金通过灵活运用多种量化投资策略，在充分控制基金财产风险和保证基金资产流动性的基础上，力争实现基金资产长期稳健的保值增值。

投资策略 1、资产配置策略 本基金依据宏观和行业经济变量、资本市场金融时间序列数据等构建量化模型和工具对市场的投资者行为、市场情绪、风险偏好等进行系统分析和评估。通过基本面分析框架与量化模型相结合的方式综合评估不同大类资产在不同时期的投资价值及其风险收益特征，在股票、债券和货币等资产间进行大类资产的灵活配置。在基金合同要求内，合理使用金融工具动态调整组合的风险暴露，以期达到控制组合下行风险实现稳健增值的目标。 2、股票投资策略 本基金以量化方法构建股票组合，并结合基本面研究成果对股票组合进行评估，剔除投资风险较大的个股，以期获得相对市场表现的长期稳定的超额回报。量化选股体系包括量化选股模型、风险评估模型以及组合优化模型等。 （1）量化选股模型 本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值（value）、质量（quality）、动量（momentum）、成长（growth）、一致预期（consensus expectation）等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。由于宏观经济环境和市场环境总是变化的，本基金将在充分评估的基础上对因子组合进行动态调整。 （2）风险评估模型 本基金将对股票组合的风险暴露进行分解，构建风险因子。在分析个股的风险因子暴露程度后，通过量化方法对投资组合的风险进行综合评估，最终将投资组合风险控制目标范围内。 （3）组合优化模型 本基金将综合考虑量化选股模型、风险评估模型、交易和冲击成本、投资品种和比例限制，最终得出优化目标下的个股及权重，形成组合优化模型。 3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券，力争实现组合的保值增值。 4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。 5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

业绩比较基准（若有） 沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%

风险收益特征（若有） 本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

三、基金运作情况

1、基金基本情况

鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]2346号《关于准予鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2017]1167号《关于同意鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 319,244,389.37 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 582 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华量化策略灵活配置混合型

证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 319,347,198.32 份，其中，认购资金利息折合 102,808.95 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等)、货币市场工具(含同业存单等)、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

自 2017 年 6 月 21 日至 2019 年 5 月 28 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

2、清算原因

根据《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于 2019 年 5 月 27 日表决通过的《关于终止鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》以及本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于 2019 年 5 月 28 日发布的《鹏华基金管理有限公司关于鹏华量化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 2019 年 5 月 29 日起进入基金财产清算程序。

3、清算起始日

本基金从 2019 年 05 月 29 日起进入清算期，清算期间为 2019 年 5 月 29 日至 2019 年 6 月 5 日。

4、清算报表编制基础

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。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。

四、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 5 月 28 日

单位：人民币元

资产 最后运作日

2019 年 05 月 28 日

资产：

银行存款 12,893,460.09

结算备付金

存出保证金 227.32

交易性金融资产

其中：股票投资

基金投资

债券投资

| | |
|----------------|---------------|
| 资产支持证券投资 | |
| 贵金属投资 | |
| 衍生金融资产 | |
| 买入返售金融资产 | |
| 应收证券清算款 | 174,005.33 |
| 应收利息 | 14,242.47 |
| 应收股利 | |
| 应收申购款 | 198,632.38 |
| 递延所得税资产 | |
| 其他资产 | |
| 资产总计 | 13,280,567.59 |
| 负债和所有者权益 最后运作日 | |
| 2019年05月28日 | |
| 负 债: | |
| 短期借款 | - |
| 交易性金融负债 | - |
| 衍生金融负债 | - |
| 卖出回购金融资产款 | |
| 应付证券清算款 | |
| 应付赎回款 | 41,478.89 |
| 应付管理人报酬 | 23,020.73 |
| 应付托管费 | 3,836.78 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应付交易费用 | 6,945.73 |
| 应交税费 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 90,431.18 |
| 负债合计 | 165,713.31 |
| 所有者权益: - | |
| 实收基金 | 14,914,729.02 |
| 未分配利润 | -1,799,874.74 |
| 所有者权益合计 | 13,114,854.28 |
| 负债和所有者权益总计 | 13,280,567.59 |

五、清算情况

在清算期间，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《基金合同》第二十部分“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、资产处置情况

(1) 备付金、保证金、应收款和其他资产处置情况

序号 项目 运作终止日账面价值 清算期变动金额(账面价值减少以“-”填列) 清算期期末账面价值

| | | | | |
|---|---------|-------------|-------------|-----------|
| 1 | 结算备付金 | -206,500.00 | 206,500.00 | |
| 2 | 存出保证金 | 227.32 | 2,190.22 | 2,417.54 |
| 3 | 应收证券清算款 | 174,005.33 | -174,005.33 | - |
| 4 | 应收利息(注) | 14,242.47 | 2,123.5 | 16,365.97 |
| 5 | 应收股利 | - | - | - |
| 6 | 应收申购款 | 198,632.38 | -198,632.38 | - |
| 7 | 递延所得税资产 | - | - | - |
| 8 | 其他资产 | - | - | - |

注：应收利息不含应收债券利息、应收资产证券化利息和应收买入返售金融资产利息。

(2) 金融资产处置情况

注：无。

3、负债清偿情况

序号 项目 运作终止日金额 清算期变动金额(账面价值减少以“-”填列) 清算期期末金额

| | | | | |
|----|-----------|-----------|------------|-----------|
| 1 | 短期借款 | - | - | - |
| 2 | 交易性金融负债 | - | - | - |
| 3 | 衍生金融负债 | - | - | - |
| 4 | 卖出回购金融资产款 | - | - | - |
| 5 | 应付证券清算款 | - | - | - |
| 6 | 应付赎回款 | 41,478.89 | -41,478.89 | - |
| 7 | 应付管理人报酬 | 23,020.73 | -23,020.73 | - |
| 8 | 应付托管费 | 3,836.78 | -3,836.78 | - |
| 9 | 应付销售服务费 | - | - | - |
| 10 | 应付交易费用 | 6,945.73 | -6,945.73 | - |
| 11 | 应交税费 | - | - | - |
| 12 | 应付利息 | - | - | - |
| 13 | 应付利润 | - | - | - |
| 14 | 递延所得税负债 | - | - | - |
| 15 | 其他负债 | 90,431.18 | -5,631.18 | 84,800.00 |

4、清算期的清算损益情况

项目 2019年05月29日

至2019年06月05日

一、收入 2,198.33

1.利息收入 2,123.50

其中：存款利息收入 2,123.50

债券利息收入 -

资产支持证券利息收入 -

买入返售金融资产收入 -
 其他利息收入 -
 2.投资收益（损失以“-”号填列） -
 其中：股票投资收益 -
 基金投资收益 -
 债券投资收益 -
 资产支持证券投资收益 -
 贵金属投资收益 -
 衍生工具收益 -
 股利收益 -
 3.公允价值变动损益（损失以“-”号填列） -
 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）
 5.其他收入（损失以“-”号填列） 74.83
 二、费用 44,427.81
 1.管理人报酬 -
 2.托管费 -
 3.销售服务费 -
 4.交易费用 -
 5.利息支出 -
 其中：卖出回购金融资产支出 -
 6.其他费用 44,427.81
 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） -42,229.48
 减：所得税费用 -
 四、净利润总额（净亏损以“-”号填列） -42,229.48

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 2019 年 05 月 28 日基金净资产 13,114,854.28

加：清算期间净收益 -42,229.48

加：应付利润结转实收基金金额

减：净赎回金额（含费用） 7,153.57

二、2019 年 06 月 05 日基金净资产 13,065,471.23

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。

清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款、备付金、保证金等产生的应收利息归份额持有人所有。于清算划款日前一日的应收利息余额由基金管理人以自有资金先行垫付，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。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

6、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。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金资产负债表及审计报告；
- (2) 《鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金财产清算小组

2019年7月19日