

# 华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2018年6月

资产附注号

本期末

2018年2月26日

(基金最后开放日的确认日)

上年度末

2017年12月31日

资产：

银行存款 53,279,279.32 301,282,938.27

结算备付金 1,787,272.73 879,140.41

存出保证金 91,631.41 30,586.67

交易性金融资产 61,431,776.00 314,356,248.04

其中：股票投资 1,431,776.00 128,123,210.04

债券投资 -186,233,038.00

买入返售金融资产 7-14,100,000.00

应收证券清算款 -19,420.44

应收利息 827,217.53 4,423,232.65

应收申购款 13,389.28 -

资产总计 6,630,566.27 635,091,566.48

负债和所有者权益

负债：

应付赎回款 141,192.99 -

应付管理人报酬 22(d) 2,614.65 321,781.77

应付托管费 22(e) 653.66 80,445.45

应付交易费用 9505,258.20 514,942.12

其他负债 10100,337.55 150,000.00

负债合计 750,057.05 1,067,169.34

所有者权益：

实收基金 115,321,621.72 600,307,761.28

未分配利润 12558,887.50 33,716,635.86

所有者权益合计 5,880,509.22 634,024,397.14

负债和所有者权益总计 6,630,566.27 635,091,566.48

注：

1. 报告截止日 2018 年 2 月 26 日(基金最后开放日的确认日)，基金份额净值 1.1050 元，基金份额总额 5,321,621.72 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 26 日(基金最后开放日的确认日)。

项目 附注号

本期

2018 年 1 月 1 日

至 2018 年 2 月 26 日

(基金最后开放日的确认日)

上年度可比期间

2017 年 1 月 20 日

(基金合同生效日)至

2017 年 12 月 31 日

一、收入 7,387,900.25 39,654,798.58

利息收入 1,579,428.65 19,396,381.46

其中：存款利息收入 13 974,797.42 2,300,674.12

债券利息收入 242,371.99 16,153,188.85

买入返售金融资产收入 362,259.24 942,518.49

投资收益(损失以“-”填列) 13,045,087.90 13,195,466.41

其中：股票投资收益 14 13,119,962.02 10,948,457.93

债券投资收益 15 -132,924.92 -539,056.15

股利收益 16 58,050.80 2,786,064.63

公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 17 -7,237,059.65 7,062,950.71

其他收入(损失以“-”号填列) 18 443.35 -

减：二、费用 594,796.43 5,938,162.72

管理人报酬 22(b) 244,957.73 3,486,058.61

托管费 22(c) 61,239.43 871,514.62

交易费用 19 267,228.18 922,645.22

利息支出 - 476,212.06

其中：卖出回购金融资产支出 - 476,212.06

其他费用 20 20,910.64 181,732.21

税金及附加 460.45 -

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) 6,793,103.82 33,716,635.86

减：所得税费用 --

四、净利润(净亏损以“-”号填列) 6,793,103.82 33,716,635.86

项目

本期

2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 26 日

(基金最后开放日的确认日)

实收基金 未分配利润 所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值) 600,307,761.28 33,716,635.86 634,024,397.14

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) - 6,793,103.82 6,793,103.82

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) -594,986,139.56 -39,950,852.18 -634,936,991.74

其中：1.基金申购款 97,504.22 9,264.45 106,768.67

2.基金赎回款(以“-”号填列) -595,083,643.78 -39,960,116.63 -635,043,760.41

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) ---

五、期末所有者权益(基金净值) 5,321,621.72 558,887.50 5,880,509.22

项目

上年度可比期间

2017年1月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日

实收基金 未分配利润 所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值) 600,307,761.28 - 600,307,761.28

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) - 33,716,635.86 33,716,635.86

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) ---

其中：1.基金申购款 ---

2.基金赎回款(以“-”号填列) ---

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) ---

五、期末所有者权益(基金净值) 600,307,761.28 33,716,635.86 634,024,397.14

后附财务报表附注为财务报表的组成部分。

本财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：黄小蕙 主管会计工作的负责人：向辉 会计机构负责人：张幸骏

## 1 基金基本情况

华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金(原名为华宝兴业新动力一年定期开放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]2829号《关于准予华宝兴业新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司，已于2017年10月17日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，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 600,253,750.04 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 064 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 600,307,761.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 54,011.24 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。

根据《华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，即以封闭期和开放期相结合的方式运作。本基金的首个封闭期为自基金合同生效日(含)起至基金合同生效日所对应的下一年度对应日的前一日(含)。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日(含)起至首个开放期结束之日次日所对应的下一年度对应日的前一日(含)，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自每个封闭期结束后第一个工作日(含)起进入开放期，每个开放期最长不超过 20 个工作日，最短不少于 5 个工作日，期间可以办理申购与赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝新动力一年定期开放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(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券和货币市场工具(包括质押式及买断式回购、银行存款、同业存单等)、股指期货、权证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：封闭期内，本基金投资于股票的比例为基金资产净值的 0-100%，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，本基金投资于股票的比例为基金资产净值的 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，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50% + 上证国债指数收益率×50%。

根据《华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及华宝基金管理有限公司于 2018 年 2 月 27 日发布的《关于华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金自 2018 年 2 月 27 日起进入基金财产清算程序。

## 2 财务报表编制基础

如财务报表附注 1 所述，自 2018 年 2 月 27 日起，本基金进入清算程序，因此本基金财务报表以清算基础编制。

本基金财务报表按附注 3 中所述的重要会计政策和会计估计以清算基础编制。于 2018 年 2 月 26 日(基金最后开放日的确认日)，所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

此外，本基金财务报表按照中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及在财务报表附注 3 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 3 重要会计政策和会计估计

#### (a) 会计期间

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 26 日(基金最后开放日的确认日)。比较财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

#### (b) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### (c) 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### (d) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

于上年度可比期间，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。自上年度末起，各项金融资产以可收回金额和账面价值孰低计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### (e) 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### (f) 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### (g) 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### (h) 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### (i) 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### (j) 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### (k) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### (l) 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：**(1)** 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；**(2)** 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；**(3)** 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

(m) 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(2) 本基金各项资产的可收回金额为资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

#### 4 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。



(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 5 银行存款

单位：人民币元

项目	
本期末	
2018 年 2 月 26 日	
(基金最后开放日的确认日)	
上年度末	
2017 年 12 月 31 日	
活期存款	3,279,279.32 1,282,938.27
定期存款	--
其他存款	- 300,000,000.00
合计	3,279,279.32 301,282,938.27

## 6 交易性金融资产

单位：人民币元

项目			
本期末			
2018 年 2 月 26 日(基金最后开放日的确认日)			
成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,605,884.94	1,431,776.00	-174,108.94
债券			
交易所市场	---		
银行间市场	---		
合计	---		

合计	1,605,884.94	1,431,776.00	-174,108.94
项目			
上年度末			
2017年12月31日			
成本	公允价值	公允价值变动	
股票	120,383,452.02	128,123,210.04	7,739,758.02
债券			
交易所市场	28,656,996.55	28,335,038.00	-321,958.55
银行间市场	158,252,848.76	157,898,000.00	-354,848.76
合计	186,909,845.31	186,233,038.00	-676,807.31
合计	307,293,297.33	314,356,248.04	7,062,950.71

注：

1.于2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)，本基金持有如下股票投资：

金额单位：人民币元

股票	代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末	估值	单价	复牌日期	复牌开	盘单价	数量(股)	期末	成本总额	期末	估值总额
600309	万华化	学	2017-12-05	重大资产重组	35.44	未知	未知	40,400	1,605,884.94	1,431,776.00	-				

2.如财务报表附注1所述，本基金自2018年2月27日起，进入基金财产清算程序。对于尚未变现的股票资产，待基金管理人将上述股票资产卖出变现后，以卖出股票资产的变现金额划付给基金份额持有人。

7 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目
本期末
2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)
账面余额 其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券 --
合计 --
项目
上期末
2017年12月31日
账面余额 其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券 14,100,000.00 -
合计 14,100,000.00 -

## 8 应收利息

单位：人民币元

项目
本期末
2018年2月26日
(基金最后开放日的确认日)
上年度末
2017年12月31日
应收活期存款利息 22,559.62 719.77
应收其他存款利息 - 1,072,500.00
应收结算备付金利息 4,498.27 435.16
应收债券利息 - 3,348,541.69
应收买入返售证券利息 - 1,020.85
其他 159.64 15.18
合计 27,217.53 4,423,232.65

## 9 应付交易费用

单位：人民币元

项目
本期末
2018年2月26日
(基金最后开放日的确认日)
上年度末
2017年12月31日
交易所市场应付交易费用 501,848.39 508,997.50
银行间市场应付交易费用 3,409.81 5,944.62

合计 505,258.20 514,942.12

10;其他负债

单位：人民币元

项目

本期末

2018年2月26日

(基金最后开放日的确认日)

上年度末

2017年12月31日

预提费用 100,337.55 150,000.00

合计 100,337.55 150,000.00

11;实收基金

金额单位：人民币元

项目

本期

2018年1月1日至2018年2月26日

(基金最后开放日的确认日)

基金份额(份) 账面金额

上年度末 600,307,761.28 600,307,761.28

本期申购 97,504.22 97,504.22

本期赎回(以“-”号填列) -595,083,643.78 -595,083,643.78

基金最后开放日的确认日 5,321,621.72 5,321,621.72

注：赎回含转换出份额。 12;未分配利润 单位：人民币元

项目 已实现部分 未实现部分 未分配利润合计

上年度末 26,653,685.15 7,062,950.71 33,716,635.86

本期利润 14,030,163.47 -7,237,059.65 6,793,103.82

本期基金份额交易产生的变动数 -39,770,052.99 -180,799.19 -39,950,852.18

其中：基金申购款 16,366.32 -7,101.87 9,264.45

基金赎回款 -39,786,419.31 -173,697.32 -39,960,116.63

本期已分配利润 ---

基金最后开放日的确认日 913,795.63 -354,908.13 558,887.50

13;存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2018年1月1日至

2018年2月26日

(基金最后开放日的确认日)

上年度可比期间

2017年1月20日

(基金合同生效日)至2017年12月31日

活期存款利息收入 21,835.04 135,748.21

其他存款利息收入 948,750.00 2,121,333.33

结算备付金利息收入 4,063.11 42,467.95

其他 149.27 1,124.63

合计 974,797.42 2,300,674.12

14;股票投资收益 单位: 人民币元

项目

本期

2018 年 1 月 1 日至

2018 年 2 月 26 日

(基金最后开放日的确认日)

上年度可比期间

2017 年 1 月 20 日

(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

卖出股票成交金额 132,142,169.59 267,524,300.87

减: 卖出股票成本总额 119,022,207.57 256,575,842.94

买卖股票差价收入 13,119,962.02 10,948,457.93

15 债券投资收益

单位: 人民币元

项目

本期

2018 年 1 月 1 日至

2018 年 2 月 26 日

(基金最后开放日的确认日)

上年度可比期间

2017 年 1 月 20 日

(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

卖出债券、债转股及债券到期兑付成交总额 190,371,671.16 658,828,797.25

减: 卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总

额 186,909,845.31 645,319,511.55

减: 应收利息总额 3,594,750.77 14,048,341.85

买卖债券差价收入 -132,924.92 -539,056.15

16 股利收益

于 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 26 日(基金最后开放日的确认日)止期间, 本基金的股利收益均为股票投资产生的股利收益(2017 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间: 同)。

17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目

本期

2018年1月1日至

2018年2月26日

(基金最后开放日的确认日)

上年度可比期间

2017年1月20日

(基金合同生效日)至2017年12月31日

交易性金融资产 -7,237,059.65 7,062,950.71

——股票投资 -7,913,866.96 7,739,758.02

——债券投资 676,807.31 -676,807.31

合计 -7,237,059.65 7,062,950.71

18 其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2018年1月1日至

2018年2月26日

(基金最后开放日的确认日)

上年度可比期间

2017年1月20日

(基金合同生效日)至2017年12月31日

基金赎回费收入 294.16 -

基金转换费收入 149.19 -

合计 443.35 -

注：

1.本基金在同一开放期内申购后又赎回的赎回费率为1.50%，其他情形下不收取赎回费，赎回费全额归入基金资产。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

19 交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2018年1月1日至

2018年2月26日  
(基金最后开放日的确认日)  
上年度可比期间  
2017年1月20日  
(基金合同生效日)至2017年12月31日  
交易所市场交易费用 265,628.18 914,575.11  
银行间市场交易费用 1,600.00 8,070.11  
合计 267,228.18 922,645.2

## 20 其他费用

单位：人民币元

### 项目

本期  
2018年1月1日至  
2018年2月26日  
(基金最后开放日的确认日)  
上年度可比期间  
2017年1月20日  
(基金合同生效日)至2017年12月31日  
审计费用 9,369.66 60,000.00  
信息披露费 967.89 90,000.00  
银行汇划费用 1,273.09 9,632.21  
债券账户维护费 9,300.00 21,000.00  
其他 -1,100.00  
合计 20,910.64 181,732.21

## 21 资产负债表日后事项

自资产负债表日(2018年2月26日)后至本财务报表批准报出日期间,本基金由银行存款、结算备付金和存出保证金产生的利息收入将由基金管理人华宝基金管理有限公司先行垫付,基金管理人垫付资金孳生的利息归本基金的基金管理人所有,待实际结息资金到账后再归还本基金的基金管理人,与之前预估数所产生的误差也由本基金的基金管理人承担。

## 22 重大关联方关系及关联交易

### (a) 关联方

#### 关联方名称 与本基金的关系

华宝基金管理有限公司“(华宝基金”)基金管理人、登记机构、基金销售机构  
中国银行股份有限公司“(中国银行”)基金托管人、基金销售机构

华宝信托有限责任公司“(华宝信托”)基金管理人的股东

华平资产管理有限合伙(Warburg;Pincus;Asset;Management,L.P.)自2017年10月17日起,系基金管理人的股东

领先资产管理有限公司(Lyxor;Asset;Management;S.A.)截止至2017年10月16日,系基金管理人的股东

中国宝武钢铁集团有限公司“(宝武集团”)华宝信托的最终控制人

华宝证券有限责任公司“(华宝证券”)受宝武集团控制的公司

华宝投资有限公司“(华宝投资”)受宝武集团控制的公司

宝钢集团财务有限责任公司“(宝钢财务”)受宝武集团控制的公司

注:

1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.2017年10月17日,华宝基金管理有限公司正式完成上海市工商局变更登记备案手续,变更后公司的股权结构为:华宝信托有限责任公司持股51%,Warburg Pincus Asset Management,L.P.持股49%。

(b) 管理人报酬/应付管理人报酬

支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。本基金于2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)按照该日基金资产净值(扣除按该日基金资产净值计提的管理人报酬和托管费之前的基金资产净值)0.60%的年费率计提一天的管理人报酬后,即停止管理人报酬的计提。

于2018年1月1日至2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)止期间,本基金共产生管理人报酬244,957.73元(2017年1月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间:3,486,058.61元);于2018年2月26日(基金最后开放日的确认日),本基金应付管理人报酬余额为2,614.65元(2017年12月31日:321,781.77元)。

(c) 托管费/应付托管费

支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。本基金于2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)按照该日基金资产净值(扣除按该日基金资产净值计提的管理人报酬和托管费之前的基金资产净值)0.15%的年费率计提一天的托管费后,即停止托管费的计提。

于2018年1月1日至2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)止期间,本基金共产生托管费61,239.43元(2017年1月20日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间:871,514.62元);于2018年2月26日(基金最后开放日的确认日),本基金应付托管费余额为653.66元(2017年12月31日:80,445.45元)。

(d) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元



## 关联方

名称

本期

2018年1月1日至

2018年2月26日

(基金最后开放日的确认日)

上年度可比期间

2017年1月20日

(基金合同生效日)至

2017年12月31日

期末余额 当期利息收入 期末余额 当期利息收入

中国银行 3,279,279.32 21,835.04 1,282,938.27 135,748.21

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

## 23 金融工具及其风险

如财务报表附注1所述，自2018年2月27日起，本基金进入基金财产清算期。于2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)，本基金资产包括银行存款、结算备付金、存出保证金、股票投资及应收利息等。本基金面临的与本报告期末本基金所持有的金融工具相关的风险主要为其他价格风险。

其他价格风险主要是本基金所面临的市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

于2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)，本基金持有的交易性金融资产的估值总额为1,431,776.00元，若交易性金融资产估值上升/(下降)5%，基金资产净值上升/(下降)71,588.80元。

## 24 其它需要说明的事项

### a、本基金的清算费用包括：

1、聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，费用人民币20,000元；其中9,369.66元基金已计提，剩余10,630.34元由基金财产承担。

2、聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书，费用人民币20,000.00元，由基金财产承担。

3、划付各项费用、清算款等费用而产生的划款手续费，由基金财产承担。

### b、应收利息的特别说明：

为保护委托人利益，管理人将垫付清算期产生的应收利息，管理人垫付资金孳生的利息归管理人所有。

2018年2月27日至清算款划出日前的银行存款的利息归委托人所有，为保护投资者利益，加快清盘速

度，本管理人将先行垫付该笔资金，供清盘分配使用，结束后将由托管人退还管理人，与之前预估数所产生的误差也由管理人承担。

#### c、基金剩余财产的分配：

按照《华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产清算”的规定，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。

剩余财产的具体分配顺序见下表：

金额单位：人民币元

项目 分配顺序

一、2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)所有者权益 5,880,509.22

加：基金最后开放日的确认日后至清算款划出日（2018年7月3日）前一日的银行存款产生的利息 12,609.49

加：停牌股票变现损益 319,331.36

减：清盘报告律师费 20,000.00

减：清盘报告审计费 10,630.34

减：银行汇划费 9,200.00+150.00（预估）

二、可供分配剩余财产总额 6,172,469.73

管理人预计于收到证监会备案函5个工作日内，将所有垫付款项入账、费用支付，并下达指令给托管人，将届时可供分配财产总额划付给委托人。

基金份额持有人获取的金额=（可供分配剩余财产总额/合同截止日总份额）\*每个客户持有份额

#### d、相关账户的注销：

基金清算完毕后，资产管理人配合资产托管人按照规定注销基金尚存的资金账户、证券账户及其他账户。

#### 25 备查文件

a.《华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2018年1月1日至2018年2月26日(基金最后开放日的确认日)止期间的财务报表及审计报告》

b.律师事务所关于《华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组

2018年6月