

华泰柏瑞基金管理有限公司
华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金
金
清算报告

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：2019年5月7日

清算报告公告日：2019年6月17日

华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞兴利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]2777号《关于准予华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准进行募集。

《华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月29日正式生效,基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:

“基金合同生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金合同自动终止,无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规另有规定时,从其规定。”

截止2019年3月6日日终,本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元,触发基金合同终止情形,基金合同自动终止,基金管理人已就该事项于2019年3月7日刊登了《华泰柏瑞兴利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》。

基金管理人、基金托管人、普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2019年3月7日成立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)对本基金进行清算审计,上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、基金概况

| | |
|----------------------------|--|
| 基金名称 | 华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华泰柏瑞兴利混合 |
| 基金代码 | 003970/ 003971 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 12 月 29 日 |
| 最后运作日 (2019-3-6) 基金份额总额 | 3,320,419.55 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极灵活的合理资产配置,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争基金资产的持续稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略包括(1)大类资产配置;(2)股票投资策略;(3)债券投资策略(4)权证投资策略;(5)资产支持证券投资策略;(6)其他金融衍生工具投资策略;(7)融资业务的投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2016]2777号《关于准予华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依

照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 300,020,678.14 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(2016)第 1692 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 300,061,930.18 份基金份额，其中认购资金利息折合 41,252.04 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：

“基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规另有规定时，从其规定。”

截止 2019 年 3 月 6 日日终，本基金已连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，触发基金合同终止情形，基金合同自动终止，基金管理人已就该事项于 2019 年 3 月 7 日刊登了《华泰柏瑞兴利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》。

本基金的最后运作日确定为 2019 年 3 月 6 日，自 2019 年 3 月 7 日起进入清算程序。

四、财务会计报告

1、资产负债表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 3 月 6 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2019年3月6日 (基金最后运作日) | 上年度末 2018年12月31日 |
|-------------------|-------------------------------|----------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 3,362,760.16 | 10,833,823.06 |
| 结算备付金 | 8,000.00 | 62,708.25 |
| 存出保证金 | 20,597.25 | 29,770.84 |
| 应收利息 | 7,441.24 | 2,109.24 |
| 应收申购款 | - | 25.00 |
| 资产总计 | 3,398,798.65 | 10,928,436.39 |
| 负债和所有者权益 | | |
| 负债： | | |
| 应付赎回款 | 8,915.83 | - |
| 应付管理人报酬 | 1,735.34 | 7,983.55 |
| 应付托管费 | 433.83 | 1,995.89 |
| 应付销售服务费 | 9.61 | 15.13 |
| 应付交易费用 | - | 55,313.86 |
| 其他负债 | 424,108.85 | 360,000.00 |
| 负债合计 | 435,203.46 | 425,308.43 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 3,320,419.55 | 11,498,723.68 |
| 未分配利润 | -356,824.36 | -995,595.72 |
| 所有者权益合计 | 2,963,595.19 | 10,503,127.96 |
| 负债和所有者权益总计 | 3,398,798.65 | 10,928,436.39 |

注：

1.报告截止日 2019 年 3 月 6 日(基金最后运作日)，基金份额总额 3,320,419.55 份；其中 A 类基金份额净值为 0.8924 元，基金份额为 3,268,468.88 份；C 类基金份额净值为 0.9018 元，基金份额为 51,950.67 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日(基金最后运作日)止期间。

2、利润表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金

报告期间：2018 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日（基金最后运作日）

| 项目 | 本期 2019年1月1日至 2019年3月6日 (基金最后运作日) | 上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日 |
|----------------------------|--|--------------------------------------|
| 一、收入 | 5,956.47 | -9,662,427.18 |
| 利息收入 | 5,939.56 | 3,489,813.58 |
| 其中：存款利息收入 | 5,332.00 | 61,412.80 |
| 债券利息收入 | - | 3,405,860.15 |
| 买入返售金融资产收入 | 607.56 | 22,540.63 |
| 投资收益(损失以“-”填列) | - | -13,975,626.06 |
| 其中：股票投资收益 | - | -18,211,945.70 |
| 债券投资收益 | - | 739,274.79 |
| 股利收益 | - | 3,497,044.85 |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | - | 820,170.48 |
| 其他收入 | 16.91 | 3,214.82 |
| 减：二、费用 | 78,715.32 | 2,339,486.82 |
| 管理人报酬 | 3,696.28 | 939,150.91 |
| 托管费 | 924.09 | 234,787.62 |
| 销售服务费 | 23.69 | 490.48 |
| 交易费用 | 19.80 | 444,453.60 |
| 利息支出 | - | 307,770.73 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | 307,770.73 |
| 税金及附加 | - | 7,237.58 |
| 其他费用 | 74,051.46 | 405,595.90 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | -72,758.85 | -12,001,914.00 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | -72,758.85 | -12,001,914.00 |

注：本财务报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师单峰、曹阳签字出具了普华永道中天特审字(2019)第 1942 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

本基金自 2019 年 3 月 7 日起进入清算程序，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. 资产处置情况

1.1 本基金最后运作日存出保证金金额 20,597.25 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金。已于 2019 年 4 月 2 日划入托管账户。

1.2 本基金最后运作日结算备付金 8,000.00 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金。已于 2019 年 4 月 2 日划入托管账户。

1.3 本基金最后运作日应收利息为 7,441.24 元。其中应收活期银行存款利息为 7,220.12 元，应收保证金利息金额为 113.18 元，应收结算备付金利息为 107.94 元。上述款项由基金管理人以自有资金垫付，待回款后再返还基金管理人。

2. 负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付赎回款 8,915.83 元，该款项于 2019 年 3 月 7 日支付。

2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 1,735.34 元，该款项于 2019 年 3 月 27 日支付。

2.4 本基金最后运作日应付托管费 433.83 元，该款项于 2019 年 3 月 27 日支付。

2.5 本基金最后运作日应付销售服务费 9.61 元，该款项于 2019 年 3 月 27 日支付。

2.6 应付审计费 70,684.70 元，该款项于 2019 年 4 月 22 日支付 60,000.00 元，于 2019 年 5 月 7 日支付 20,000.00 元，差额计入清算费用。

2.7 应付信息披露费 353,424.15 元（中证报、上证报、证券时报分别 117,808.05 元），已于 2019 年 3 月 12 日支付中证报 100,000.00 元，于 2019 年 4 月 12 日支付上证报与证券时报各 100,000.00 元，剩余款项待收到报社信息披露费发票后支付。

3.清算费用

按照《华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金》第十九部分“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。考虑到本基金清算的实际情况，清算过程中发生的费用主要为划款手续费、律师费、银行间账户维护费等。

4、清算日的清算损益情况

| 项目 | 自 2019 年 3 月 7 日至 2019 年 5 月 7 日止清算期间 |
|------------|---------------------------------------|
| 一、清算收益 | |
| 利息收入（注 1） | 3,961.05 |
| 信息披露费(注 2) | 53,424.15 |
| 清算收入小计 | 57,385.20 |
| 二、清算费用 | |
| 划款手续费 | 116.00 |
| 律师费用 | 20,000.00 |
| 审计费用（注 3） | 9,315.30 |
| 银行间账户维护费 | 6,200.00 |
| 清算费用小计 | 35,631.30 |
| 三、清算净收益 | 21,753.90 |

注 1：利息收入系计提的自 2019 年 3 月 7 日至 2019 年 5 月 7 日止清算期间的银行存款、备付金、保证金利息。

注 2：2019 年 1 月 1 日起不收取信息披露费，截至 2019 年 3 月 6 日预提金额 53,424.15 元计入清算收益。

注 3：2019 年审计费用实际金额为 80,000.00 元，高于 2019 年 3 月 6 日预提金额 70,684.70 元，差额计入清算费用。

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 3 月 6 日基金净资产 | 2,963,595.19 |
| 加：清算期间净收益 | 21,753.90 |
| 减：最后运作日（2019 年 3 月 6 日）当日申请，2019 年 3 月 7 日确认的赎回款 | 8,439.60 |
| 二、2019 年 5 月 7 日基金资产净值 | 2,976,909.49 |

截至本次清算期结束日2019年5月7日，本基金剩余财产为2,976,909.49元。自本次清算期结束日次日2019年5月8日至本次清算款划出前一日的银行存款产生的利息亦归基金份额持有人所有。本基金归属于基金持有人的剩余财产将按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

为便于及时向基金份额持有人分配剩余资产，基金管理人将在清算款划出日以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应收利息等。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起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，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将根据法律法规及本基金的基金合同约定及时行分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 6 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告
- (2) 《华泰柏瑞兴利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

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 www.huatai-pb.com。

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。

华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金
基金财产清算小组

清算报告出具日：2019年5月7日