

华泰柏瑞基金管理有限公司华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金清算报告

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年11月29日

清算报告公告日：2019年1月2日

华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞爱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[2015]1250号《关于准予华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及中国证监会机构部函[2016]2089号《关于华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集。《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月20日正式生效。基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》“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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式或与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

基金合同存续期内，如基金资产净值连续60个工作日低于5000万元，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权决定终止本基金合同。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

截止2018年11月1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2018年11月2日刊登了《华泰柏瑞爱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2018年11月2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 华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金

基金简称 华泰柏瑞爱利混合

基金代码 001533

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2016年9月20日

最后运作日

(2018-11-1) 基金份额总额 1,405,348.03

投资目标 在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值，前瞻性地把握不同时期股票市场、债券市场和银行间市场的收益率，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金的投资策略包括(1)资产配置策略；(2)股票投资策略；(3)固定收益资产投资策略；(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。

业绩比较基准 中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率(税后)+1%。

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 上海银行股份有限公司

三、基金运作情况

华泰柏瑞爱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[2015] 1250 号《关于准予华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及中国证监会机构部函[2016]2089 号《关于华泰柏瑞爱利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》和《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞爱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 200,878,831.93 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 1228 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,898,913.94 份基金份额,其中认购资金利息折合 20,082.01 份基金份额。

根据《华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》“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,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式或与其他基金合并等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

基金合同存续期内,如基金资产净值连续 60 个工作日低于 5000 万元,经与基金托管人协商一致,基金管理人有权决定终止本基金合同。

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。”

截止 2018 年 11 月 1 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 2018 年 11 月 2 日刊登了《华泰柏瑞爱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 2018 年 11 月 1 日,自 2018 年 11 月 2 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:华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018 年 11 月 1 日

单位:人民币元

资产 本期末

2018 年 11 月 1 日

(基金最后运作日) 上年度末

2017 年 12 月 31 日

资产:

银行存款 1,740,555.48 5,117,626.43

结算备付金 -95,456.84

存出保证金 104,249.91 22,073.60

交易性金融资产 -549,691,556.64

其中:股票投资 -128,897,256.64

债券投资 -420,794,300.00

买入返售金融资产 -3,700,000.00

应收利息 4,432.85 4,386,641.09

资产总计 1,849,238.24 563,013,354.60

负债和所有者权益

负债：

卖出回购金融资产款 - 7,000,000.00

应付证券清算款 - 3,725,599.89

应付管理人报酬 2,679.92 372,885.36

应付托管费 502.49 69,916.01

应付交易费用 2,766.72 91,331.65

应付利息 - 7,287.40

其他负债 300,818.45 360,000.00

负债合计 306,767.58 11,627,020.31

所有者权益：

实收基金 1,405,348.03 499,972,579.19

未分配利润 137,122.63 51,413,755.10

所有者权益合计 1,542,470.66 551,386,334.29

负债和所有者权益总计 1,849,238.24 563,013,354.60

注：

1.报告截止日 2018 年 11 月 1 日(基金最后运作日),基金份额净值为 1.0976 元,基金份额为 1,405,348.03 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 1 日(基金最后运作日)止期间。

2、利润表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞爱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 2018 年 11 月 1 日（基金最后运作日）

项目 本期

2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 1 日

(基金最后运作日) 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

一、收入 14,836,770.27 58,531,481.52

利息收入 12,053,799.18 15,118,203.48

其中：存款利息收入 149,836.05 65,450.22

债券利息收入 11,487,364.22 14,939,094.02

买入返售金融资产收入 416,598.91 113,659.24

投资收益(损失以“-”填列) 10,513,779.34 34,725,692.79

其中：股票投资收益 6,224,323.39 33,036,263.66

债券投资收益 3,058,248.51 -2,092,596.45

股利收益 1,231,207.44 3,782,025.58

公允价值变动收益(损失以“-”号填列) -7,731,267.14 8,687,356.20

其他收入 458.89 229.05

减：二、费用 4,795,983.51 6,422,594.21

管理人报酬 2,638,265.81 4,386,559.85

托管费 494,674.87 822,479.94

交易费用 719,138.92 457,102.07

利息支出 581,779.30 354,017.65

其中：卖出回购金融资产支出 581,779.30 354,017.65

税金及附加 12,923.79 -

其他费用 349,200.82 402,434.70

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) 10,040,786.76 52,108,887.31

减：所得税费用 --

四、净利润(净亏损以“-”号填列) 10,040,786.76 52,108,887.31

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(2018)第 2641 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

本基金自 2018 年 11 月 2 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 本基金最后运作日应收利息为 4,432.85 元。其中应收活期银行存款利息为 4,239.47 元，应收保证金利息金额为 193.38 元，上述款项由基金管理人于清算款划出日以自有资金垫付，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管理人报酬 2,679.92 元，该款项于 2018 年 11 月 19 日支付。

2.2 本基金最后运作日应付托管费 502.49 元，该款项于 2018 年 11 月 19 日支付。

2.3 应付银行间交易手续费 2,766.72 元，该款项已于 2018 年 11 月 22 日支付。

2.4 应付审计费 50,135.90 元，该款项待收到会计师事务所审计费发票后支付。

2.5 应付信息披露费 250,682.55 元（中证报、上证报、证券时报分别 83,560.85 元），该款项待收到报社信息披露费发票后支付。

3. 清算费用

按照《华泰柏瑞爱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、律师费等。

4、清算日的清算损益情况

项目 自 2018 年 11 月 2 日至 2018 年 11 月 29 日止清算期间

一、清算收益

利息收入-利息收入（注 1） 1,103.54

审计费用（注 2） 135.90

清算收入小计 1,239.44

二、清算费用

预留划款手续费（注 3） 300.00

律师费用 20,000.00

中债销户缴费 3,000.00

上清销户缴费 3,200.00

管理费（注 4） 33.81

托管费（注 5） 6.34

清算费用小计 26,540.15

三、清算净收益 -25,300.71

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 11 月 2 日至 2018 年 11 月 29 日止清算期间的存款利息，其中银行存款利息为 968.58 元，上交所保证金利息为 56.56 元，深交所保证金利息为 78.40 元。

注 2：2018 年审计费用实际金额为 50,000.00 元，低于 2018 年 11 月 1 日预提金额 50,135.90 元，差额计入清算收益。

注 3：预留金额与实际扣款金额的误差由管理人承担。

注 4：本基金于 2018 年 11 月 2 日按照 2018 年 11 月 1 日(基金最后运作日)基金资产净值 0.80%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。注 5：本基金于 2018 年 11 月 2 日按照 2018 年 11 月 1 日(基金最后运作日)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。

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 2018 年 11 月 1 日基金净资产

1,542,470.66

加：清算期间净收益 -25,300.71

二、2018 年 11 月 29 日基金资产净值 1,517,169.95

截至本次清算期结束日 11 月 29 日，本基金剩余可分配基金持有人财产为 1,517,169.95 元。自本基金进入清算程序起至全部清算款划出前一日，由银行存款、结算备付金及结算保证金产生的利息亦属份额持有人所有。基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司将于清算款划出日以自有资金垫付上述利息收入（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金将于实际结息资金到账后返还给基金管理人。结息后将由基金托管人退还基金管理人，与之前预估数所产生的误差也由基金管理人承担。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。

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进行分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1)华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 1 日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告

(2)《华泰柏瑞爱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。

华泰柏瑞爱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：2018 年 11 月 29 日