

华泰柏瑞基金管理有限公司
华泰柏瑞盛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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年12月14日

清算报告公告日：2019年1月30日

华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞盛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] 1593号《关于准予华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集。

《华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月3日正式生效。基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《华泰柏瑞盛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10月12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10月13日刊登了《华泰柏瑞盛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10月13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	华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞盛利混合
基金代码	002069/002070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月3日
最后运作日 (2018-10-12) 基金 份额总额	2,002,543.94
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等潜在的投资机会，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）其他金融衍生工具投资策略。
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	中国银行股份有限公司

三、基金运作情况

华泰柏瑞盛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] 1593号《关于准予华泰柏瑞盛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》和《华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞盛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 200,003,129.88 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 212 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,007,129.89 份基金份额,其中认购资金利息折合 4000.01 份基金份额。

根据《华泰柏瑞盛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 10 月 12 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 10 月 13 日刊登了《华泰柏瑞盛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 10 月 12 日,自 2018 年 10 月 13 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：华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年10月12日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年10月12日 (基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	1,531,263.13	8,292,115.40
结算备付金	-	350,954.15
存出保证金	69,865.99	40,876.01
交易性金融资产	731,430.40	3,677,606.36
其中：股票投资	731,430.40	3,677,606.36
应收证券清算款	-	234,283.01
应收利息	1,708.94	1,972.86
资产总计	2,334,268.46	12,597,807.79
负债和所有者权益		
负债：		
应付赎回款	-	11.57
应付管理人报酬	429.95	61,425.41
应付托管费	107.48	15,356.36
应付销售服务费	0.13	0.31
应付交易费用	106,805.74	290,837.10
其他负债	281,092.65	360,000
负债合计	388,435.95	727,630.75
所有者权益：		
实收基金	2,002,543.94	10,094,872.32
未分配利润	-56,711.43	1,775,304.72
所有者权益合计	1,945,832.51	11,870,177.04
负债和所有者权益总计	2,334,268.46	12,597,807.79

注：

1. 报告截止日2018年10月12日(基金最后运作日)，基金份额总额2,002,543.94份；其中华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额净值为0.9717元，基金份额为2,001,439.31份；华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额净值为0.9197元，基金份额为1,104.63份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年10月12日(基金

最后运作日)止期间。

2、利润表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞盛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10月12日（基金最后运作日）

项 目	本期 2018年1月1日至 2018年10月12日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2017年3月3日(基 金合同生效日)至 2017年12月31日
一、收入	-5,338,490.67	27,165,113.88
利息收入	289,118.12	969,697.20
其中：存款利息收入	250,512.64	277,433.63
债券利息收入	-	24,584.60
买入返售金融资 产收入	38,605.48	667,678.97
投资收益(损失以“-”填列)	-5,129,467.03	25,264,244.85
其中：股票投资收益	-6,551,596.81	22,562,181.23
债券投资收 益	-	-4,218.20
股利收益	1,422,129.78	2,706,281.82
公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	-976,336.76	665,356.16
其他收入	478,195.00	265,815.67
减：二、费用	1,489,583.94	2,752,216.58
管理人报酬	422,505.32	1,015,535.12
托管费	105,626.25	253,883.79
销售服务费	2.86	4.59
交易费用	659,578.93	1,105,181.21
其他费用	301,870.58	377,611.87
三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)	-6,828,074.61	24,412,897.30
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“- ”号填列)	-6,828,074.61	24,412,897.30

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2608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 10 月 13 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 69,865.99 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。上述款项中截止清算款划出日未能变现的，由基金管理人以自有资金垫付，于清算款划出日划入托管账户。

1.2 本基金最后运作日应收利息为 1,708.94 元。其中应收活期银行存款利息为 1,667.94 元，应收保证金利息金额为 41.00 元。上述款项中截止清算款划出日未能变现的，由基金管理人以自有资金垫付，于清算款划出日划入托管账户。

1.3 本基金最后运作日持有的交易性金融资产已于 2018 年 11 月 8 日、2018 年 12 月 4 日变现，变现金额 657,453.67 元。

2. 负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬 429.95 元，该款项于 2018 年 11 月 2 日支付。

2.2 本基金最后运作日应付托管费 107.48 元，该款项于 2018 年 11 月 2 日支付。

2.3 本基金最后运作日应付销售服务费 0.13 元，该款项已于 2018 年 11 月 2 日支付。

2.4 应付交易费用 106,805.74 元，该款项已于 2018 年 10 月 30 日支付。

2.5 应付审计费 46,848.30 元，该款项已于 2018 年 12 月 4 日支付 45,000.00 元，差额计入清算收益。

2.6 应付信息披露费 234,244.35 元（中证报、上证报、证券时报分别 78,081.45 元），该款项已于 2018 年 12 月 4 日支付。

3.清算费用

按照《华泰柏瑞盛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、交易费用等。

4、清算日的清算损益情况

项目	自 2018 年 10 月 13 日至 2018 年 12 月 14 日止清算期间
一、清算收益	
利息收入-利息收入（注 1）	2,278.03
审计费用（注 2）	1,848.30
投资收益	-73,260.00
股利收入	436.80
清算收入小计	-68,696.87
二、清算费用	
划款手续费	160.00
律师费用	20,000.00
交易费用	1,316.60
清算费用小计	21,476.60
三、清算净收益	-90,173.47

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 10 月 13 日至 2018 年 12 月 14 日止清算期间的存款利息，其中银行存款利息为 2,085.45 元，保证金利息为 192.58 元。

注 2：2018 年审计费用实际金额为 45,000.00 元，低于 2018 年 10 月 12 日预提金额 46,848.30 元，差额计入清算收益。

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 10 月 12 日基金净资产	1,945,832.51
加：清算期间净收益	-90,173.47
减：最后运作日（2018 年 10 月 12 日）当日申请，2018 年 10 月 15 日确认的赎回款	18.11
减：最后运作日（2018 年 10 月 12 日）当日申请，2018 年 10 月 15 日确认的赎回费	0.01
二、2018 年 12 月 14 日基金资产净值	1,855,640.92

截至本次清算期结束日12月14日，本基金剩余可分配基金持有人财产为1,855,640.92元。自本基金进入清算程序起至全部清算款划出前一日，本基金由银行存款、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基金持有人清算款划出日以自有资金垫付该笔款项（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。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) 华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 10 月 12 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告
- (2) 《华泰柏瑞盛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。

华泰柏瑞盛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12月14日