

华宝港股通香港精选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：2021年9月

一、重要提示

华宝港股通香港精选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【2018】649号文准予注册，本基金基金合同于2018年6月20日正式生效。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华宝港股通香港精选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）的有关规定，本基金已出现基金合同终止事由，本基金管理人根据法律法规的规定及基金合同的约定履行了基金财产清算程序并终止基金合同，此事项无需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2021年9月3日，自2021年9月4日起，本基金进入清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见基金管理人于2021年8月26日发布的《关于华宝港股通香港精选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、安永华明会计师事务所（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，由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	华宝港股通香港精选混合型证券投资基金
基金简称	华宝香港精选混合
基金主代码	005883
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月20日
投资目标	本基金通过精选个股和严格的风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括香港证券市场公开上市的港股通标的股票、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、权证、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）。 本基金不投资于境内市场股票。

	本基金投资于港股通标的股票资产的比例为基金资产的 60%-95%。
投资策略	本基金将依靠定量与定性相结合的方法，自下而上地精选个股。定量的方法包括分析相关的财务指标和市场指标，选择财务健康，成长性好，估值合理的股票。定性的方法则是结合本基金研究团队的案头研究和实地调研，深入分析企业的基本面和长期发展前景，及短期重大影响事件。
业绩比较基准	恒生综合指数收益率×80%+人民币银行活期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金将通过港股通投资香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
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

三、基金运作情况

华宝港股通香港精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可【2018】649号文准予注册，由基金管理人依照法律法规的规定及《基金合同》的约定自2018年5月16日至2018年6月13日期间向社会公开募集。本基金基金合同于2018年6月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为444,279,721.58份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为6,498户。

根据基金合同“第五部分 基金备案”之“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之一的，本基金将依据《基金合同》第十九部分的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。法律法规另有规定时，从其规定。”

截至2021年8月24日日终，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据法律法规的规定及基金合同的约定，基金管理人应终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序，不需召开基金份额持有人大会。本基金的最后运作日为2021年9月3日，自2021年9月4日起，本基金进入清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

四、财务会计报告

(一) 华宝港股通香港精选混合型证券投资基金最后运作日资产负债表

单位：人民币元

	最后运作日 2021年9月3日
资产：	
银行存款	12,894,652.64
应收利息	5,518.11
应收股利	36,553.07
资产合计：	12,936,723.82
负债：	
应付赎回款	1,405,011.57
应付管理人报酬	1,923.91
应付托管费	320.66
应付交易费用	316,121.84
其他负债	16,211.76
负债合计	1,739,589.74
所有者权益：	
实收基金	9,903,755.65
未分配利润	1,293,378.43
所有者权益合计	11,197,134.08
负债与所有者权益合计：	12,936,723.82

五、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。

六、清算情况

自2021年9月4日至2021年9月14日止清算期间，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、资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日应收股利余额为人民币36,553.07元，其中人民币18,937.69元已于2021年9月9日和9月10日划入托管账户，其中人民币-59.83元为汇兑损益。清算结束日剩余应收股利余额为人民币17,555.55元，将在清算款划出日之前划入托管账户，相应的汇兑损益由基金产品承担。

(2) 本基金最后运作日应收利息余额为人民币5,518.11元，由于尚未结息，将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币1,923.91元，该款项已于2021年9月6日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币320.66元，该款项已于2021年9月6日支付。

(3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币1,405,011.57元，该款项已于9月6日、9月7日、9月8日、9月9日、9月10日、9月13日和9月14日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币316,121.84元，该款项已于2021年9月6日和9月7日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币16,211.76元。其中应付审计费为人民币12,930.44元，该款项已于2021年9月13日支付。其中应付赎回费为人民币3,281.32元，该款项已于9月6日、9月7日、9月8日、9月9日、9月10日、9月13日和9月14日支付。

3、清算期间的清算损益情况

项目	自2021年9月4日 至2021年9月14日 止清算期间
一、收益	
1、利息收入	1,281.27
2、赎回费收入	147.04
收益小计	<u>1,428.31</u>
二、费用	
1、银行划款手续费	155.00
2、汇兑损益（注1）	59.83
3、律师费用	10,000.00
费用小计	<u>10,214.83</u>
三、清算期间净收益	<u>-8,786.52</u>

注1：因港股股利的股息除权日与股息实际发放日存在汇率差异，所以产生了汇兑损益

4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额（单位：人民币元）
一、最后运作日 2021 年 9 月 3 日基金净资产	11,197,134.08
加：清算期间净收益	-8,786.52
减：清算期间支付赎回款、赎回费	97,457.41
二、2021 年 9 月 14 日基金净资产	11,090,890.15

资产处置及负债清偿后，于2021年9月14日本基金剩余财产为人民币11,090,890.15元，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。

清算起始日2021年9月4日至清算款划出日前一日的银行存款利息，存出保证金利息和结算备付金利息均属基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。尚未结息的利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

七、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 《华宝港股通香港精选混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《华宝港股通香港精选混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

以上文件存于基金管理人办公场所备投资者查阅。

3、查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件。