

华泰柏瑞基金管理有限公司
华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型
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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2023年12月28日

清算报告公告日：2023年12月29日

华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金（以下简称“华泰柏瑞军工股票基金”）变更注册而来。华泰柏瑞军工股票基金根据 2015 年 6 月 10 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】1218 号）和 2016 年 1 月 6 日中国证监会证券基金机构监管部《关于华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函【2016】24 号）的注册，进行募集。华泰柏瑞军工股票基金的基金合同于 2016 年 3 月 29 日正式生效。自 2016 年 8 月 3 日至 2016 年 9 月 1 日华泰柏瑞军工股票基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于修改华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金合同的议案》，本基金的基金名称自 2016 年 9 月 2 日起，由“华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金”，《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）同时生效。基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司（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《基金合同》“第五部分 基金的存续”中的约定：

“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、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。”

截至 2023 年 11 月 16 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，出现了基金合同终止事由。基金管理人经与基金托管人协商一致，决定依法对本基金财产进行清算并终止《基金合同》，该事项无须召开基金份额持有人大会进行表决。基金管理人已就该事项于 2023 年 11 月 28 日刊登了《华泰柏瑞精选回报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》。本基金最后运作日为 2023 年 11 月 30 日，自 2023 年 12 月 1 日（最后运作日的次日）起进入清算程序。

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 2023 年 12 月 1 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	华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞精选回报混合
基金代码	001524
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 2 日
最后运作日 (2023-11-30) 基金份额总额	485,322.30 份
投资目标	通过深入研究，本基金对股票、债券等金融资产进行灵活配置，在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，依据市场不同表现，在大类资产中进行配置，保证整体投资业绩的持续性。 1、大类资产配置

本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。

2、股票投资策略

本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的风险。

本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。

（1）行业配置策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的行业配置方法构建投资组合，综合考虑以下因素，进行股票资产在各行业间的配置。

1) 国家经济政策

本基金将积极关注政府未来的产业发展规划方向，以及配套的国家财政与税收政策、货币政策、产业政策、贸易政策、汇率政策等政策的变化，分析国家政策对主题行业的影响，重点投资于受益于国家政策变化、预期收益率较高的行业。

2) 经济周期

经济周期对各个行业的影响不尽相同，本基金主要从两个角度把握经济周期带来的投资机会：一是充分分析过

往历史数据，找出经济周期对行业景气度影响的共性规律；二是将对当前所处经济周期阶段进行前瞻性分析，根据各行业在经济周期各阶段的预期表现，进行行业配置与调整，为投资者追求超额收益。

3) 各行业的发展前景

本基金将重点关注各行业的发展进程，捕捉行业科技技术、制造工艺、商业模式、人才结构等因素的最新变化，从而预测各行业的发展前景，发掘具有广阔发展潜力的行业，并相应对基金资产的行业配置进行调整。

4) 各行业基本面的变化

本基金将对影响各行业基本面的因素进行跟踪分析，预期各行业基本面变化的拐点，超配基本面即将发生有利变化的行业，低配基本面即将发生不利变化的行业。

5) 各行业的相对估值水平

本基金将对各行业的相对估值水平进行动态分析，增加被市场低估的行业配置比例，降低盈利低于预期的行业配置比例。

6) 市场需求趋势

各行业市场需求的变化趋势不同，有的表现为刚性需求，有的呈现较大弹性，导致不同行业成长性出现差异。本基金将重点投资市场需求稳定或保持较高增长的行业。

7) 行业竞争格局

各行业内部的竞争格局不同，行业利润率存在较大差异。本基金将重点投资行业进入壁垒较高、利润率稳定或保持增长的行业。

(2) 个股选择策略

本基金股票资产以基本面良好的上市公司为投资对象，基于行业配置的要求，对股票进行分类和筛选，选择各行业龙头企业和价值被低估的企业作为重点关注对象。

1) 行业龙头企业。一般指在该行业里股本、市值、规模、市场占有率居前的代表性企业。这些企业由于规模巨大，市场占有率高，所以其自身发展对全行业有重大影响，往往引领全行业的发展方向和兴衰。

2) 成长性企业。一般指那些在较长时期内，具有持续挖掘未利用资源的能力、不同程度地表现出整体扩张的态势、未来发展预期良好的企业。

3) 价值低估企业。通过深入分析研究市场和股票价格变动的诸多因素，综合判断企业的内在价值。如果企业股票价格没能反映其真实价值或潜在价值，则视之为价值低估企业。

3、存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

4、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

5、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多

	<p>种因素对权证进行定价。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。</p> <p>7、其他金融衍生工具投资策略</p> <p>在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。</p> <p>8、融资融券业务的投资策略</p> <p>本基金还可以在条件允许的情况下在履行适当的程序后参与融资业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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。</p>

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

华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金（以下简称“华泰柏瑞军工股票基金”）变更注册而来。华泰柏瑞军工股票基金根据 2015 年 6 月 10 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】1218 号）和 2016 年 1 月 6 日中国证监会证券基金机构监管部《关于华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函【2016】24 号）的注册，进行募集。华泰柏瑞军工股票基金的基金合同于 2016 年 3 月 29 日正式生效。自 2016 年 8 月 3 日至 2016 年 9 月 1 日华泰柏瑞军工股票基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于修改华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金基金合同的议案》，本基金的基金名称自 2016 年 9 月 2 日起，由“华泰柏瑞中国军工主题股票型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金”，《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）同时生效。基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司（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《基金合同》“第五部分 基金的存续”中的约定：

“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、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。”

截至 2023 年 11 月 16 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，出现了基金合同终止事由。基金管理人经与基金托管人协商一致，决定依法对本基金财产进行清算并终止《基金合同》，该事项无须召开基金份额持有人大会进行表决。基金管理人已就该事项于 2023 年 11 月 28 日刊登了《华泰柏瑞精选回报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 2023 年 11 月 30 日，自 2023 年 12 月 1 日（最后运作日的次日）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：华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年11月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2023年11月30日 (基金最后运作日)	上年度末 2022年12月31日
资产：		
银行存款	735,761.74	4,405,206.66
结算备付金	-	-
存出保证金	25,236.18	20,854.22
交易性金融资产	-	503,917,687.12
其中：股票投资	-	122,543,042.70
基金投资	-	-
债券投资	-	381,374,644.42
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	6,998,024.38
债权投资	-	-
其中：债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
其他投资	-	-
其他债权投资	-	-
其他权益工具投资	-	-
应收清算款	-	138,498.50
应收股利	-	-
应收申购款	-	109.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	15,500.00	-
资产总计	776,497.92	515,480,380.72

负债和净资产	本期末 2023年11月30日 (基金最后运作日)	上年度末 2022年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付清算款	-	-
应付赎回款	81,997.66	-
应付管理人报酬	380.21	261,875.46
应付托管费	95.11	65,468.86
应付销售服务费	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	-	21,469.43
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	124,932.00	220,295.65
负债合计	207,404.98	569,109.40
净资产：		
实收基金	485,322.30	426,439,039.81
其他综合收益	-	-
未分配利润	83,770.64	88,472,231.51
净资产合计	569,092.94	514,911,271.32
负债和净资产总计	776,497.92	515,480,380.72

注：

1.报告截止日2023年11月30日(基金最后运作日)，基金份额总额485,322.30份，基金份额净值1.1726元。

2.本财务报表的实际编制期间为2023年1月1日至2023年11月30日(基金最后运作日)止期间。

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、胡莲莲签字出具了普华永道中天特审字(2023)第 3168 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

自2023年12月1日至2023年12月28日为止为本基金清算报告期，本基

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 本基金最后运作日托管户活期存款 735,154.70 元，应收活期银行存款利息为 607.04 元，上述利息按照季度结息日划至基金托管户。

1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 25,236.18 元，其中结算保证金 25,151.35 元，应收保证金利息金额为 84.83 元，结算保证金按照结算规则，逐步划回托管户，上述利息按照季度结息日划至基金托管户。

1.3 本基金最后运作日已确认的其他资产余额 15,500.00 元，其中其他应收款 15,500.00 元。截至 2023 年 12 月 14 日，上述款项 15,500.00 元均已收回基金托管户。

2、负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付赎回款 81,997.66 元，该款项于 2023 年 12 月 4 日全部支付。

2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 380.21 元，该款项于 2023 年 12 月 4 日全部支付。

2.3 本基金最后运作日应付托管费 95.11 元，该款项于 2023 年 12 月 4 日全部支付。

2.4 其他负债 124,932.00 元，其中应付赎回费 0 元；应付交易费用 0 元；预提费用 124,932.00 元，其中 46,027.20 元为应付审计费，于 2023 年 12 月 21 日支付；78,904.80 元为应付信披费，于 2023 年 12 月 22 日支付。

3、清算费用

按照《华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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剩余财产中支付。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交易费用、划款手续费等。

4、停止运作后的清算损益情况说明

项 目	最后运作日后一日至清算结束日：
-----	-----------------

	2023年12月1日至2023年12月28日
一、营业总收入	
1.利息收入	194.44
其中：存款利息收入	193.54
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
证券出借利息收入	-
其他利息收入	0.90
2.投资收益（损失以“-”填列）	-
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-
其他投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、营业总支出	-
1. 管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 投资顾问费	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 信用减值损失	-
7. 税金及附加	-
8. 其他费用	70.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	

减：所得税费用	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	124.44
五、其他综合收益的税后净额	
六、综合收益总额	124.44

注 1：利息收入系计提的自 2023 年 12 月 1 日至 2023 年 12 月 28 日止的银行存款利息及存出保证金利息。

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

一、最后运作日 2023 年 11 月 30 日基金净资产	569,092.94
加：清算期间净收益	124.44
减：确认赎回对净值的影响	10,889.46
二、2023 年 12 月 28 日基金资产净值	558,327.92

截至本次清算期结束日2023年12月28日，本基金剩余财产为558,327.92元。本基金剩余财产将在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。

本基金最后运作日后一日2023年12月1日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金利息亦属基金份额持有人所有，该部分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，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

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上海证监局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基金剩余财产的分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 11 月 30 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告

(2) 《华泰柏瑞精选回报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。

华泰柏瑞精选回报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：2023 年 12 月 28 日