

# 贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

清算报告出具日：2026 年 8 月 4 日

清算报告公告日：2026 年 8 月 8 日

## 一、重要提示

贝莱德浦悦丰利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[2024]1701号变更注册，由贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金变更而来。贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2022]1936号《关于准予贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册，由基金管理人贝莱德基金管理有限公司于2022年11月1日至2022年11月18日止期间向社会公开发行人募集，募集期结束经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具普华永道中天验字（2022）第0909号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。《贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2022年11月23日生效。自2025年3月12日起，《贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金基金合同》生效，《贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司，登记机构为中国建设银行股份有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《贝莱德浦悦丰利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”）“第五部分 基金的存续”之“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”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50个工作日出现前述情形的，基金管理人应当终止基金合同，本基金按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”自基金合同生效以来，截至2026年7月9日，本基金已连续50个工作日基金资产净值低于5000万元。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，本基金管理人应当终止《基金合同》，并按照《基金合同》的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会。本基金最后运作日为2026年7

月9日，自2026年7月10日（含该日，下同）起，本基金进入基金财产清算程序。

基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，由上海市通力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                        | 贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金                                                                                                                                                                                              |
| 基金简称                        | 贝莱德浦悦丰利混合                                                                                                                                                                                                     |
| 基金代码                        | 016678                                                                                                                                                                                                        |
| 基金运作方式                      | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                        |
| 基金合同生效日                     | 2022 年 11 月 23 日                                                                                                                                                                                              |
| 最后运作日基金份额总额（2026 年 7 月 9 日） | 12,762,534.31 份                                                                                                                                                                                               |
| 投资目标                        | 本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现组合资产长期稳健的增值。                                                                                                                                                                     |
| 投资策略                        | <p>1、波动率控制策略</p> <p>本基金将明确产品风格定位并设立中长期投资管理目标，同时力争将回撤和波动率控制在较低水平，从而在风险可控的前提下追求实现产品投资目标。</p> <p>2、资产配置策略</p> <p>本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，结合全球宏观经济形势，研判国内外经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，对组合中股</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                       |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>票、债券、金融衍生品、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例进行战略配置和动态调整，以规避或分散市场风险，力争实现基金资产的中长期稳健增值。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金采用的债券投资策略包括：久期策略、信用策略、息差策略、可转换债券及可交换债券投资策略等。</p> <p>4、股票投资策略</p> <p>5、金融衍生品投资策略</p> <p>6、融资投资策略</p> |
| 业绩比较基准 | <p>中债综合财富（总值）指数收益率×75%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+一年期定期存款利率（税后）×5%</p>                                                                                                                                     |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，预期风险和收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金如果投资港股通标的股票，需承担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。</p>                                                                                                       |
| 基金管理人  | 贝莱德基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                           |
| 基金托管人  | 上海浦东发展银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                        |

三、基金运作情况

本基金系经中国证监会证监许可[2024]1701号变更注册，由贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金变更而来。贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2022]1936号《关于准予贝莱德浦悦丰

利一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册，由基金管理人依照法律法规、《贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金基金合同》等规定，于2022年11月1日至2022年11月18日止期间向社会公开发行募集。《贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2022年11月23日正式生效，《贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金基金合同》生效日的基金份额总数为270,403,390.61份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为3,663户。自2025年3月12日起，《贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金基金合同》生效，《贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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》、《基金合同》的有关规定，截至2026年7月9日日终，本基金资产净值连续50个工作日低于5000万元，触发《基金合同》的终止情形，无需召开基金份额持有人大会，进入资产变现及清算程序。本基金最后运作日为2026年7月9日，并从2026年7月10日起进入清算期。本基金清算期自2026年7月10日起至2026年7月21日止。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

### 1、资产负债表

会计主体：贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金

报告截止日：2026年7月9日

单位：人民币元

| 资产       | 本期末<br>2026 年 7 月 9 日<br>(基金最后运作日) |
|----------|------------------------------------|
| 资产：      |                                    |
| 货币资金     | 42,792.23                          |
| 结算备付金    | 384.43                             |
| 存出保证金    | -                                  |
| 交易性金融资产  | 13,704,107.37                      |
| 其中：股票投资  | 3,127,548.28                       |
| 基金投资     | -                                  |
| 债券投资     | 10,576,559.09                      |
| 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 | -                                  |
| 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    | -                                  |
| 应收股利     | -                                  |
| 应收申购款    | -                                  |
| 递延所得税资产  | -                                  |
| 其他资产     | -                                  |
| 资产总计     | 13,747,284.03                      |

| 负债和净资产      | 本期末<br>2026 年 7 月 9 日<br>(基金最后运作日) |
|-------------|------------------------------------|
| <b>负债：</b>  |                                    |
| 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       | 355,210.72                         |
| 应付管理人报酬     | 2,258.22                           |
| 应付托管费       | 564.54                             |
| 应付销售服务费     | 516.34                             |
| 应付投资顾问费     | -                                  |
| 应交税费        | 125.19                             |
| 应付利润        | -                                  |
| 递延所得税负债     | -                                  |
| 其他负债        | 93,470.70                          |
| 负债合计        | 452,145.71                         |
| <b>净资产：</b> |                                    |
| 实收基金        | 12,762,534.31                      |
| 其他综合收益      | -                                  |
| 未分配利润       | 532,604.01                         |
| 净资产合计       | 13,295,138.32                      |
| 负债和净资产总计    | 13,747,284.03                      |

注：基金最后运作日 2026 年 7 月 9 日，基金份额总额 12,762,534.31 份，其中 A 类基金份额净值 1.0469 元，基金份额 8,280,307.48 份；C 类基金份额净值 1.0321 元，基金份额 4,482,226.83 份。

## 五、清盘事项说明

自2026年7月10日至2026年7月21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) 本基金最后运作日货币资金为人民币42,792.23元，其中存放于托管账户人民币28,360.87元，应计银行存款利息人民币12.25元；其中存放于证券经纪商的证券交易结算资金人民币14,418.93元，应计券商交易结算资金利息人民币0.18元。券商交易结算资金及应计利息已于清算报告出具日前划入托管账户。为加快清盘速度，本基金基金管理人将以自有资金先行垫付清算款划出日前一日的货币资金利息，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

(2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币384.43元，其中存放于期货账户人民币0.00元，应计期货账户利息人民币384.43元。上述款项已于清算期间划入托管账户。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币13,704,107.37元，已于清算期间全部处置变现。

### 2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币355,210.72元，该款项已于清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币2,258.22元，该款项已于清算期间支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币564.54元，该款项已于清算期间支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币516.34元，该款项已于清算期间支付。

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币125.19元，该款项已于清算期间支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币93,470.70元，其中应付律师费人民币20,000.00元，应付赎回费人民币0.12元，应付交易费用人民币797.50元，预提审计费人民币15,000.00元，预提信息披露费人民币41,643.84元，预提中债账户维护费人民币7,000.00元，预提上清所账户维护费人民币7,000.00元，其他应付款人民币2,029.24元。其中上清所账户维护费人民币600.00元及中债账户维护费人民币1,000.00元于清算期间冲销，其他款项均已于清算期间支付。

### 3、清算费用

根据《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财产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。

### 4、停止运作后的清算损益情况说明

单位：人民币元

| 项 目               | 最后运作日后一日至清算<br>结束日：2026年7月10<br>日至2026年7月21日 |
|-------------------|----------------------------------------------|
| 一、营业总收入           | -14,958.94                                   |
| 1.利息收入            | 1,136.81                                     |
| 其中：存款利息收入         | 1,136.81                                     |
| 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        | -                                            |
| 其他利息收入            | -                                            |
| 2.投资收益（损失以“-”号填列） | -272,698.25                                  |
| 其中：股票投资收益         | -286,438.56                                  |

|                            |                   |
|----------------------------|-------------------|
| 基金投资收益                     | -                 |
| 债券投资收益                     | 15,337.42         |
| 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                       | -1,597.11         |
| 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）      | 256,602.50        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | -                 |
| <b>减：二、营业总支出</b>           | <b>-1,598.52</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | -                 |
| 其中：暂估管理人报酬                 | -                 |
| 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                   | 1.47              |
| 8. 其他费用                    | -1,599.99         |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-13,360.42</b> |
| 减：所得税费用                    | -                 |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-13,360.42</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       | <b>-</b>          |
| <b>六、综合收益总额</b>            | <b>-13,360.42</b> |

注 1：基金清算期间利息收入为人民币 1,136.81 元，系清算期间的银行存款利息

收入及存放于证券经纪商的证券交易结算资金利息收入。

注 2：本基金清算期间投资收益为人民币-272,698.25 元，系清算期间的卖出股票差价收入、卖出债券差价收入、交易费用、股息红利税及债券利息收入。

注 3：本基金清算期间公允价值变动收益为人民币 256,602.50 元，系清算期间处置交易性金融资产所致，为原计入交易性金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

注 4：本基金清算期间税金及附加为人民币 1.47 元，系清算期间的债券利息收入产生的税费。

注 5：本基金清算期间其他费用为人民币-1,599.99 元，系清算期间产生的存托服务费、冲销的上交所账户维护费及中债账户维护费。

## 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 2026 年 7 月 9 日基金净资产            | 13,295,138.32 |
| 加：清算期间净收益                              | -13,360.42    |
| 减：基金净赎回金额（于 2026 年 7 月 10 日确认的投资者赎回申请） | 381,111.99    |
| 二、清算结束日 2026 年 7 月 21 日基金净资产           | 12,900,665.91 |

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日2026年7月21日，本基金剩余财产为人民币12,900,665.91元。根据本基金《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。

自本基金清算起始日2026年7月10日至清算款划出前一日的银行存款等产生的利息归基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，本基金基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（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。

## 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，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

## 六、备查文件

### 1、备查文件目录

（1）贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金清算审计报告

（2）上海市通力律师事务所关于《贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

### 2、存放地点

基金管理人的办公场所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金

基金财产清算小组

清算报告出具日：2026年8月4日