

华泰柏瑞基金管理有限公司
华泰柏瑞恒利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：兴业银行股份有限公司

清算报告出具日：2026年9月16日

清算报告公告日：2026年9月18日

华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2021 年 6 月 28 日中国证券监督管理委员会《关于准予华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]2247 号）注册募集。《华泰柏瑞恒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”）自 2021 年 9 月 14 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定：“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，管理人应及时通知基金托管人，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会审议。”截至 2026 年 8 月 13 日日终，本基金已出现连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。本基金将根据基金合同约定进行基金财产清算并终止，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于 2026 年 8 月 14 日刊登了《华泰柏瑞恒利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》。本基金最后一个运作日为 2026 年 8 月 13 日，自 2026 年 8 月 14 日起，本基金进入基金资产清算程序，不再开放办理申购、赎回业务。自 2026 年 8 月 14 日起，停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。

基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2026 年 8 月 14 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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	华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞恒利混合
基金代码	012953/012954
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 14 日
最后运作日 (2026 年 8 月 13 日) 基金份额总额	11,958,582.90 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下, 通过积极灵活的合理资产配置, 追求超越业绩比较基准的投资回报, 力争基金资产的持续稳健增值。
投资策略	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、债券组合投资策略; 3、股票投资策略; 4、存托凭证投资策略; 5、资产支持证券投资策略; 6、股指期货投资策略; 7、融资业务的投资策略。
业绩比较基准	中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+中证 1000 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金, 其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金, 低于股票型基金。本基金可能投资港股通标的股票, 除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等

	一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

三、基金运作情况

华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2021 年 6 月 28 日中国证券监督管理委员会《关于准予华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]2247 号）注册募集。《华泰柏瑞恒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”）自 2021 年 9 月 14 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定：“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，管理人应及时通知基金托管人，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会审议。”截至 2026 年 8 月 13 日日终，本基金已出现连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。本基金将根据基金合同约定进行基金财产清算并终止，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于 2026 年 8 月 14 日刊登了《华泰柏瑞恒利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》。本基金最后一个运作日为 2026 年 8 月 13 日，自 2026 年 8 月 14 日起，本基金进入基金资产清算程序，不再开放办理申购、赎回业务。自 2026 年 8 月 14 日起，停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。

基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司、基金托管人兴业银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2026 年 8 月 14 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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。

四、财务会计报告

1、资产负债表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 8 月 13 日

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 8 月 13 日 (基金最后运作日)
资产：	
货币资金	15,078,414.70
结算备付金	6,522.79
存出保证金	11,966.86
交易性金融资产	
其中：股票投资	
基金投资	
债券投资	
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	23,769.40
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	15,120,673.75

负债和净资产	本期末 2026 年 8 月 13 日 (基金最后运作日)
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	883,633.34
应付管理人报酬	4,081.90
应付托管费	680.33
应付销售服务费	563.04
应付投资顾问费	
应交税费	
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	91,807.94
负债合计	980,766.55
净资产：	
实收基金	11,958,582.90
其他综合收益	
未分配利润	2,181,324.30
净资产合计	14,139,907.20
负债和净资产总计	15,120,673.75

注：报告截止日 2026 年 8 月 13 日，基金份额总额 11,958,582.90 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1873 元，基金份额总额 6,906,049.18 份；下属 C 类基金份额净值 1.1757 元，基金份额总额 5,052,533.72 份。

财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师施翊洲、胡莲莲签字出具了安永华明（2026）专字第 70025451_B12 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

自 2026 年 8 月 14 日至 2026 年 9 月 2 日为止为本基金清算期间，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 本基金最后运作日银行存款为人民币 15,078,414.70 元，其中托管户存款为人民币 15,075,659.75 元，应计银行存款利息为人民币 2,754.95 元。清算款划出日前一日的应计银行存款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。

1.2 基金最后运作日结算备付金为人民币 6,522.79 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金本金为人民币 3,220.49 元，应计结算备付金利息为人民币 10.89 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金本金为人民币 3,282.13 元，应计结算备付金利息为人民币 9.28 元。清算款划出日前一日的应计利息与尚未划回基金托管账户的结算备付金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币 11,966.86 元，存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金本金为人民币 3,478.32 元，应计存出保证金利息为人民币 3.05 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金本金为人民币 8,479.74 元，应计存出保证金利息为人民币 5.75 元。清算款划出日前一日的存出保证金利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。

1.4 本基金最后运作日应收申购款为人民币 23,769.40 元，已于 2026 年 8 月 14 日全部划入基金托管户。

2、负债清偿情况

2.1 基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 4,081.90 元，已于 2026 年 8 月 14 日支付。

2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 680.33 元，已于 2026 年 8 月 14 日支付。

2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 563.04 元，已于 2026 年 8 月 14 日支付。

2.4 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 883,633.34 元，已于 2026 年 8 月 14 日支付。

2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 91,807.94 元。其中应付赎回费为人民币 79.49 元，已于 2026 年 8 月 14 日支付；应付国投证券股份有限公司交易佣金 925.17 元，该款项已于 2026 年 8 月 14 日支付；应付华泰证券股份有限公司交易佣金 1,805.53 元，该款项已于 2026 年 8 月 14 日支付；应付回购交易手续费为人民币 4.50 元，该款项已于 2026 年 8 月 17 日支付；应付债券交易手续费为人民币 75.00 元，该款项已于 2026 年 8 月 17 日支付；应付中央国债登记结算有限责任公司债券结算服务费和回购结算服务费分别为人民币 450.00 元和人民币 360.00 元，该款项已于 2026 年 8 月 18 日支付；预提银行间账户维护费及查询服务费为人民币 6,200.00 元，该款项已于 2026 年 8 月 18 日支付；预提审计费为人民币 18,492.75 元，已于 2026 年 8 月 28 日支付；预提信息披露费为人民币 49,315.50 元，已于 2026 年 8 月 31 日支付；预提划款手续费为人民币 255.29 元，已于 2026 年 9 月 1 日支付；预提划款手续费及律师费等为人民币 13,844.71 元，于清算期间尚未支付。

3、清算费用

按照《华泰柏瑞恒利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，清算过程中未发生费用。

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结束日： 2026 年 8 月 14 日至 2026 年 9 月 2 日
一、营业总收入	2,724.60
1.利息收入	2,724.60
其中：存款利息收入	
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“-”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	
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	
8. 其他费用	
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,724.60
减：所得税费用	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,724.60
五、其他综合收益的税后净额	
六、综合收益总额	2,724.60

注：1、存款利息收入系自 2026 年 8 月 14 日至 2026 年 9 月 2 日止清算期间计提

的银行存款利息收入、存出保证金利息收入及结算备付金利息收入。

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 8 月 13 日基金净资产	14,139,907.20
加：清算期间净收益	2,724.60
减：确认赎回对净值的影响	228,808.23
二、2026 年 9 月 2 日基金资产净值	13,913,823.57

截至本次清算期结束日2026年9月2日，本基金剩余财产为13,913,823.57元。根据基金合同的约定，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 8 月 14 日至清算款划出日前一日的银行存款利息、结算备付金利息及存出保证金利息亦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。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，尚未结息的利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担。基金管理人自有资金垫款产生的利息归属基金管理人所有。

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) 华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金清算审计报告
- (2) 《华泰柏瑞恒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。

华泰柏瑞恒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 9 月 16 日