

华宝第三产业灵活配置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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024年8月

一、重要提示

华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2016 年 10 月 8 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华宝兴业第三产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2016】2276 号文）进行募集，本基金基金合同于 2017 年 5 月 25 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”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（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》、《华宝第三产业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”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，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 2024 年 7 月 18 日，自 2024 年 7 月 19 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 2024 年 7 月 11 日发布的《关于华宝第三产业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》。

基金管理人华宝基金管理有限公司、基金托管人中国工商银行股份有限公司、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	华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝第三产业混合
基金主代码	004481
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 25 日
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过挖掘第三产业上市公司的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金采取积极的大类资产配置策略，通过宏观策略研究，综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策以及市场流动性等方面的因素，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。 2、股票投资策略

本基金采取积极的股票选择策略，将“自上而下”的行业配置策略和“自下而上”的股票精选策略相结合，根据对宏观经济、中观行业和市场风险特征变化的判断，进行投资组合的动态优化，实现基金资产长期稳定增值。

（1）第三产业的主题界定

根据《国民经济行业分类》（GB/T 4754—2011），国家统计局在2012年对第三产业进行了明确界定，本基金将主要依据该标准来选择重点投资行业，具体包括以下几类：

1)《国民经济行业分类》中界定的第三产业，包括：批发和零售业，交通运输、仓储和邮政业，住宿和餐饮业，信息传输、软件和信息技术服务业，金融业，房地产业，租赁和商务服务业，科学研究和技术服务业，水利、环境和公共设施管理业，居民服务、修理和其他服务业，教育，卫生和社会工作，文化、体育和娱乐业，公共管理、社会保障和社会组织，以及农、林、牧、渔业中的农、林、牧、渔服务业等。

2) 由于行业边界的融合，有些上市公司的行业特征正在向服务业转变，其产业链更接近于消费终端，基金管理人将这部分上市公司也纳入本基金的第三产业界定范畴。

3) 随着未来经济转型、技术发展和新型商业模式的诞生，第三产业的外延也将逐步扩大，本基金将视实际情况调整未来产业投资主题的识别及认定。

（2）个股选择

本基金将采取“自上而下”和“自下而上”相结合的精选策略，深入研究宏观经济以及所属行业的中观发展趋势，分析企业的基本面和发展前景。结合定性分析和定量分析，综合判断符合上述主题界定公司的投资价值，构建投资组合。

对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。

3、债券投资策略

本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券，以有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

首先，本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合的久期。

其次，债券投资组合的构建与调整是一个自下而上的过程，需综合评价个券收益率、波动性、到期期限、票息、赋税条件、流动性、信用等级以及债券持有人结构等决定债券价值的影响因素。同时，本基金将运用系统化的定量分析技术和严格的投资管理制度等方法管理风险，通过久期、平均信用等级、个券集中度等指标，将组合的风险控制在合理的水平。在此基础上，通过各种积极投资策略的实施，追求组合较高的回报。

4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。

5、股指期货投资策略

	<p>本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过研究对证券市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、其他金融工具投资策略</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品，基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标，制定与本基金相适应的投资策略、比例限制、信息披露方式等。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%	
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。	
基金管理人	华宝基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华宝第三产业混合 A	华宝第三产业混合 C
下属分级基金的交易代码	004481	012798

三、 基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会 2016 年 10 月 8 日证监许可【2016】2276 号文注册，由基金管理人依照法律法规的规定及《基金合同》的约定自 2017 年 4 月 7 日至 2017 年 5 月 19 日止期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2017 年 5 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,089,305.26 份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为 210 户。

根据基金合同“第五部分 基金备案”：《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 2024 年 7 月 9 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，根据基金合同约定，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2024年7月18日，自2024年7月19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

华宝第三产业灵活配置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 2024年7月18日
资产：	
货币资金	155,641.95
结算备付金	69,381.47
存出保证金	2,402.08
资产合计	227,425.50
负债：	
应付管理人报酬	4,984.25
应交托管费	830.72
应付销售服务费	4.45
其他负债	46,771.56
负债合计	52,590.98
净资产：	
实收基金	166,634.78
未分配利润	8,199.74
净资产合计	174,834.52
负债和净资产合计	227,425.50

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《资产管理产品相关会计处理规定》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，本清算报表无比较期间的相关数据列示。

六、清算情况

自2024年7月19日起至2024年7月24日止的清算期间，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) 本基金最后运作日银行存款为人民币155,641.95元，其中托管户存款为人民币153,875.44元，应计银行存款利息为人民币1,766.51元，由于银行尚未结息，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。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币69,381.47元，其中存放于广发期货有限公司股指期货备付金账户的结算备付金为人民币69,303.51元，应计清算备付金利息为人民币77.96元，由于银行尚未结息，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。
- (3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币2,402.08元，其中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为人民币1,421.82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为人民币977.46元，应计存出保证金利息为人民币2.80元，由于银行尚未结息，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。

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4,984.25元，该款项已于2024年7月23日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币830.72元，该款项已于2024年7月23日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币4.45元，该款项已于2024年7月23日支付。
- (4) 本基金最后运作日其他负债为人民币46,771.56元。其中应付律师费为人民币5,000.00元，已于2024年7月23日支付；应付审计费为人民币2,000.00元，应付中证报信息披露费为人民币39,771.56元，均已于2024年7月24日支付。

3、 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

自2024年7月19日
至2024年7月24日
止清算期间

项目	
一、 收益	
1、 利息收入（注1）	8.11
收益小计	8.11
二、 费用	
1、 其他费用（注2）	45.00
小计	45.00
三、 清算期间净损益	-36.89

注1：利息收入系自2024年7月19日至2024年7月24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、清算备付金利息收入。

注2：其他费用系自2024年7月19日至2024年7月24日止清算期间的银行汇划手续费。

4、 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2024年7月18日基金净资产	174,834.52
加： 清算期间净损益	-36.89
减： 清算期间支付赎回款、赎回费	-
二、 2024年7月24日基金净资产	174,797.63

资产处置及负债清偿后，截至本次清算结束日2024年7月24日，本基金剩余财产为人民币174,797.63元，根据基金合同的约定，本基金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。

自清算起始日2024年7月19日至清算款划出日前一日的银行存款利息、清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。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。基金管理人自有资金垫款产生的利息归属基金管理人所有。

七、 备查文件

1、 备查文件目录

- （1）《华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》；
- （2）关于《华宝第三产业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

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。

华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组
2024年8月