

华泰柏瑞基金管理有限公司

华泰柏瑞锦利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:兴业银行股份有限公司

清算报告出具日:2018年12月20日
清算报告公告日:2019年1月30日

华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2016年11月23日中国证监会监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2291号)的注册,进行募集。华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金基金合同自2017年1月13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。

根据本基金基金合同“第五部分 基金备案”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、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。”

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。”

截至2018年10月11日,本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元,触发上述条件,本基金管理人向证监会提交终止基金合同并召开基金份额持有人大会进行表决的解决方案。

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会投票表决起止时间为2018年10月13日至2018年11月12日17:00止,会议计票日为2018年11月13日。本次大会审议并通过了《关于华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》,本次基金份额持有人大会决定的事项表决议过之日起生效。

本次基金份额持有人大会决议生效后,根据基金份额持有人大会表决通过的议案及方案说明,本基金于2018年11月16日进入清算期。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2018年11月15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	华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞锦利混合
基金主代码	华泰柏瑞锦利混合 A:000410 华泰柏瑞锦利混合 C:004016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月13日
基金合同终止日	2018年11月13日
基金份额总额	1,003,777,11
投资目标	在严控投资风险和保持资产流动性的前提下,通过积极灵活的资产配置,追求超越业绩基准的投资回报,力争获得超越基金净值的稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括:(1)资产配置策略;(2)股票投资策略;(3)固定收益类资产投资策略;(4)权证投资策略;(5)资产支持证券投资策略;(6)股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于货币基金与货币市场基金,低于股票型基金。
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

华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2016年11月23日中国证监会监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2291号)的注册,进行募集。华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金基金合同自2017年1月13日起生效,基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。

根据本基金基金合同“第五部分 基金备案”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、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。”

法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。”

截至2018年10月11日,本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元,触发上述条件,本基金管理人向证监会提交终止基金合同并召开基金份额持有人大会进行表决的解决方案。

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会投票表决起止时间为2018年10月13日至2018年11月12日17:00止,会议计票日为2018年11月13日。本次大会审议并通过了《关于华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金终止基金合同有关事项的议案》,本次基金份额持有人大会决定的事项表决议过之日起生效。

本次基金份额持有人大会决议生效后,根据基金份额持有人大会表决通过的议案及方案说明,本基金于2018年11月16日进入清算期。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2018年11月15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。

四、财务会计报告

1、资产负债表(已审计)

会计主体:华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年11月14日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年11月14日 (基金最后运作日)	上年期末 2017年12月31日
资产:			
银行存款	5	1,278,379,72	3,062,420,94
结算备付金		-	407,251,38
存出保证金		16,057,981	21,750,07
买入返售金融资产		-	478,622,994.96
其中:质押型		-	86,440,876.96
债券投资		-	392,082,118.00
买入返售货币资产		-	9,000,133.60
应收证券清算款		-	7,677,961.74
应收利息	6	6,029,34	6,181,076.94
资产总计		1,301,046,02	564,872,991.42
负债:			
卖出回购金融资产款		-	36,294,269.11
应付管理人报酬	210c	231,24	243,318.26
应付托管费	210d	67,931	60,626.96
应付交易费用	210e	-	0.31
应付利息	7	55,906,37	103,710.36
应付其他费用		-	39,797,67
其他负债	8	312,725,75	300,000.00
负债合计		360,923,17	27,091,916.26
所有者权益:			
实收基金	9	1,003,777,11	444,003,082.03
未分配利润	10	-72,663,96	33,177,994.13
所有者权益合计		931,125,75	477,176,076.16
负债和所有者权益总计		1,301,046,02	564,872,991.42

注:本基金报告截止日2018年11月14日(基金最后运作日),基金份额总额1,003,777,11份,其中华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额1,003,089,05份,基金份额净值0.9276元;华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额688,006份,基金份额净值0.8883元。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年11月14日(基金最后运作日)止期间。

3.自2018年11月15日本基金进入清算程序起至本财务报表批准报出日(2018年11月30日)止期间,经华泰柏瑞基金管理公司登记系统确认的基金赎回款为179.29元,基金赎回款份额为193.28份,为2018年11月14日(基金最后运作日)提出申请并于2018年11月15日确认的基金赎回款项及基金赎回回款。

4.利润表(已审计)

会计主体:华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年11月14日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年11月14日 (基金最后运作日)	上年度 2017年12月31日 (基金最后运作日)
收入:			
利息收入		-471,34798	37,899,384.76
其中:存款利息收入	11	3,417,766,80	14,677,892.76
债券利息收入		310,443,03	1,096,147,50
存款利息收入		2,481,040,61	12,547,894.67
买入返售金融资产收入		617,473,93	243,318.26
应收利息		-5,021,462,02	21,685,042.66
其中:买入返售金融资产收入	12	-5,840,26,158	18,665,744.71
债券投资收益	13	-1,746,428,57	143,602,99
衍生工具收益	14	996,330,9	-
股利收入	15	665,889,06	2,285,694.96
公允价值变动收益/损失以“-”号填列	16	-2,136,495,61	2,136,495,61
其他收入	17	163,819,83	384
减:二、费用		1,904,966,22	5,771,710,76
管理人报酬	210c	744,769,66	2,667,076,63
托管费	210d	196,192,12	641,769,72
交易费用	210e	152	412
利息支出		20,711,19	798,317,18
其中:卖出回购金融资产支出		20,711,19	798,317,18
其他费用		6,606,36	-
其他费用	19	365,082,07	396,992,10
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-6,376,316,20	32,796,613,71
减:所得税费用	四、净利润(亏损总额以“-”号填列)	-6,376,316,20	32,796,613,71

注:本财务报告经华泰柏瑞基金管理公司登记系统确认的基金赎回款为179.29元,基金赎回款份额为193.28份,为2018年11月14日(基金最后运作日)提出申请并于2018年11月15日确认的基金赎回款项及基金赎回回款。

5.资产负债表(已审计)

会计主体:华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年11月14日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年11月14日 (基金最后运作日)	上年度 2017年12月31日 (基金最后运作日)
资产:			
银行存款	5	1,278,379,72	3,062,420,94
结算备付金		-	407,251,38
存出保证金		16,057,981	21,750,07
买入返售金融资产		-	478,622,994.96
其中:质押型		-	86,440,876.96
债券投资		-	392,082,118.00
买入返售货币资产		-	9,000,133.60
应收证券清算款		-	7,677,961.74
应收利息	6	6,029,34	6,181,076.94
资产总计		1,301,046,02	564,872,991.42
负债:			
卖出回购金融资产款		-	36,294,269.11
应付管理人报酬	210c	231,24	243,318.26
应付托管费	210d	67,931	60,626.96
应付交易费用	210e	-	0.31
应付利息	7	55,906,37	103,710.36
应付其他费用		-	39,797,67
其他负债	8	312,725,75	300,000.00
负债合计		360,923,17	27,091,916.26</