

华泰柏瑞基金管理有限公司
华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2018年5月10日

清算报告公告日：2018年6月28日

华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来。华泰柏瑞国企改革基金根据 2015 年 7 月 3 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1499 号）和 2016 年 11 月 8 日中国证监会证券基金机构监管部《关于华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函[2016]2727 号）进行募集。《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2017 年 9 月 27 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”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，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

截止 2018 年 3 月 19 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，触发基金合同终止情形，基金合同自动终止，基金管理人已就该事项于 2018 年 3 月 20 日刊登了《华泰柏瑞嘉利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、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 3 月 20 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	华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞嘉利混合
基金主代码	004358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年9月27日
最后运作日（2018-3-19） 基金份额总额	7,274,429.61
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	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；（7）融资业务的投资策略。
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债券型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	中国建设银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金由华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“华泰柏瑞国企”）变更注册而来，华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券

投资基金根据 2015 年 7 月 3 日中国证监会《关于准予华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1499 号）和 2016 年 11 月 8 日中国证监会证券基金机构监管部《关于华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》（机构部函[2016]2727 号）进行募集。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金总份额为 200,232,903.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,011.70 份基金份额。自 2017 年 8 月 28 日至 2017 年 9 月 26 日华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资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《关于修改华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同的议案》。自 2017 年 9 月 27 日起，由《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。自 2017 年 9 月 27 日至 2018 年 3 月 19 日期间，本基金按照基金合同约定正常运作。

根据《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”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，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。”

截止 2018 年 3 月 19 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。根据基金合同约定，本基金管理人应当终止基金合同，并对本基金进行变现及清算程序，且无需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于 2018 年 3 月 20 日刊登了《华泰柏瑞嘉利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 2018 年 3 月 19 日，自 2018 年 3 月 20 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：华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年3月19日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年3月19日 (基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	6,500,746.74	6,982,698.61
结算备付金	-	298,045.36
存出保证金	58,528.20	21,645.72
交易性金融资产	2,250,562.00	5,798,054.31
其中：股票投资	2,250,562.00	5,798,054.31
应收利息	11,543.88	1,671.54
资产总计	8,821,380.82	13,102,115.54
负债和所有者权益		
负债：		
应付赎回款	3,434.73	5,964.82
应付管理人报酬	5,549.96	128,301.50
应付托管费	1,156.26	26,729.49
应付交易费用	3,064.19	337,358.33
其他负债	388,881.14	341,966.55
负债合计	402,086.28	840,320.69
所有者权益：		
实收基金	7,274,429.61	10,231,723.47
未分配利润	1,144,864.93	2,030,071.38
所有者权益合计	8,419,294.54	12,261,794.85
负债和所有者权益总计	8,821,380.82	13,102,115.54

注：

(1) 报告截止日2018年3月19日(基金最后运作日)，基金份额总额7,274,429.61份，基金份额净值1.1574元。

(2) 本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年3月19日(基金最后运作日)止期间。

(3) 于2018年3月19日(基金最后运作日)，基金份额持有人申请赎回的本基金份额共计988.19份，该赎回申请于2018年3月20日确认。于2018年3月22日，由基金资产支付赎回款项共计1,140.87元，本基金剩余待清算份额余额为7,273,441.42份。

2、利润表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金

报告期间：2018年1月1日至2018年3月19日（基金最后运作日）

项目	本期 2018年1月1日至 2018年3月19日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2017 年9月27日(基金合 同生效日)至 2017年 12月31日
一、收入	-154,858.40	4,025,788.89
利息收入	9,872.34	57,418.02
其中：存款利息收入	9,872.34	57,382.55
债券利息收入	-	35.47
投资收益(损失以“-”填列)	322,858.83	15,584,078.89
其中：股票投资收益	228,508.83	15,737,781.30
债券投资收益	-	-2,248.12
股利收益	94,350.00	-151,454.29
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-493,671.65	-11,893,543.67
其他收入	6,082.08	277,835.65
减：二、费用	118,674.52	1,541,297.92
管理人报酬	24,769.76	634,689.35
托管费	5,160.40	132,226.95
交易费用	6,661.44	678,297.31
其他费用	82,082.92	96,084.31
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-273,532.92	2,484,490.97
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-273,532.92	2,484,490.97

注：本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、曹阳签字出具了普华永道中天特审字（2018）第1892号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

本基金自2018年03月20日起进入清算程序，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 本基金最后运作日存出保证金金额 58,528.20 元,为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金。2018 年 4 月 3 日及 2018 年 5 月 3 日中国证券登记结算有限责任公司进行结算保证金调整,金额调整至 59,357.18 元,该款项由基金管理人以自有资金垫付,于 2018 年 05 月 10 日划入托管账户,垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

1.2 本基金最后运作日应收利息为 11,543.88 元。其中应收活期银行存款利息为 10,798.78 元,应收结算备付金利息为 538.83 元,应收保证金利息金额为 206.27 元,已分别于 2018 年 3 月 21 日、2018 年 3 月 22 日结息到账。

1.3 本基金最后运作日股票投资为 2,250,562.00 元,为流通受限的停牌股票万华化学(股票代码 600309)。该款项由基金管理人以自有资金垫付,于 2018 年 05 月 10 日划入托管账户,垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。待上述停牌股票复牌后,基金管理人将股票卖出变现,变现金额与上述估值价格的差额由基金管理人享有或承担。

2. 负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付赎回款 3,434.73 元,应付赎回费 6.45 元,该款项于 2018 年 3 月 19 日和 2018 年 03 月 20 日支付。

2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 5,549.96 元,该款项于 2018 年 04 月 04 日支付。

2.3 本基金最后运作日应付托管费 1,156.26 元,该款项于 2017 年 04 月 04 日支付。

2.4 应付交易费用 3,064.19 元,该款项已于 2018 年 4 月 25 日支付。

2.5 本基金最后运作日其他负债 388,874.69 元,其中包括:

2.5.1 应付审计费 24,765.71 元,其中 11,944.07 元已于 2018 年 4 月 24 日支付,剩余部分收到会计师事务所审计费发票后支付。

2.5.2 应付信息披露费 364,108.98 元,其中 2018 年 3 月 30 日支付 200,000.00 元,5 月 2 日支付 42,739.32 元,5 月 7 日支付 21,369.66 元,剩余部分收到报社信息披露费发票后支付。

3.清算费用

按照《华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金》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划款手续费、审计费、律师费、账户维护费等。其中划款手续费分别于 2018 年 3 月 26 日、4 月 25 日支付，账户维护费已于 2018 年 4 月 18 日支付，审计费、律师费将于收到发票之后支付。

4、清算日的清算损益情况

项目	自 2018 年 3 月 20 日至 2018 年 5 月 10 日
一、清算收益	
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	6,715.19
清算收入小计	6,715.19
二、清算费用	
中债账户维护费（注 2）	4,500.00
划款手续费（注 3）	140.00
审计费用（注 4）	12,178.36
律师费用（注 5）	20,000.00
清算费用小计	36,818.36
三、清算净收益	-30,103.17

注：

(1) 利息收入系计提的自 2018 年 3 月 20 日至 2018 年 5 月 10 日止清算期间的银行存款及结算保证金利息。

(2) 中央国债登记结算有限责任公司对开户会员按季收取中债账户维护费，该笔费用为 2018 年 1 月至 3 月（办理销户手续期间）产生的费用。

(3) 划款手续费为自 2018 年 3 月 20 日至 2018 年 5 月 10 日止清算期间产生的费用。

(4) 审计费用为自 2018 年 3 月 20 日至 2018 年 5 月 10 日止清算期间产生的审计费用。

(5) 律师费用为自 2018 年 3 月 20 日至 2018 年 5 月 10 日止清算期间产生的律师费用。

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 2018 年 3 月 19 日基金净资产	8,419,294.54
加：清算期间净收益	-30,103.17

加：清算期间基金份额交易产生的净值影响	-1,143.01
二、2018年5月10日基金资产净值	8,388,048.36

注：于2018年3月19日(基金最后运作日)，基金份额持有人申请赎回的本基金份额共计988.19份，该赎回申请于2018年3月20日确认。于2018年3月22日，由基金资产支付赎回款1,140.87元，赎回费2.14元，本基金剩余待清算份额余额为7,273,441.42份。

截至本次清算期结束日2018年5月10日，本基金资产净值为8,388,048.36元。自本次清算期结束日次日(2018年5月11日)至本次清算款划出前一日的管理人垫付资金产生的利息归基金管理人所有。

本基金所有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。

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中国证监会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分配。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金2018年1月1日至2018年3月19日(基金最后运作日)止期间的财务报表及审计报告

(2) 《华泰柏瑞嘉利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。

华泰柏瑞嘉利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：2018年5月10日