

华泰柏瑞基金管理有限公司  
华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资  
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：中国银行股份有限公司

清算报告出具日：2020年8月7日

清算报告公告日：2020年8月27日

# 华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金

## 清算报告

### 一、重要提示

华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2018 年 3 月 14 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整合精选混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]467 号）进行募集。《华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金基金合同》自 2018 年 6 月 25 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，依据《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》和《华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，提议终止《华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。

本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会投票表决起止时间为 2020 年 6 月 3 日至 2020 年 7 月 3 日 17:00 止，计票日为 2020 年 7 月 6 日。本次大会审议并通过了《关于华泰柏瑞国企整合精选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自表决通过之日起生效。

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 2020 年 7 月 8 日进入清算期。基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司、基金托管人中国银行股份有限公司、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 2020 年 7 月 8 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	华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞国企整合
基金代码	005806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月25日
最后运作日 (2020-7-7)基金份额 总额	3,040,408.64份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,把握国企整合精选投资机会,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、大类资产配置;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、融资业务投资策略。
业绩比较基准	中证国有企业改革指数收益率 $\times$ 80%+中债综合指数收益率 $\times$ 20%
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	中国银行股份有限公司

### 三、基金运作情况

华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2018]第 467 号《关于准予华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金注册的批复》注册，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 217,753,976.43 元，经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2018)第 0378 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 6 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 217,928,174.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 174,197.59 份基金份额。

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，依据《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》和《华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，提议终止《华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金基金合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。本基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会投票表决起止时间为 2020 年 6 月 3 日至 2020 年 7 月 3 日 17:00 止，计票日为 2020 年 7 月 6 日。本次大会审议并通过了《关于华泰柏瑞国企整合精选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自表决通过之日起生效。

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 2020 年 7 月 8 日进入清算期。

### 四、财务会计报告

#### 1、资产负债表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金

报告截止日：2020年7月7日

单位：人民币元

资产	本期末 2020年7月7日 (基金最后运作日)	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	398,255.23	578,388.13
结算备付金	219.51	2,419.42
存出保证金	2,471.19	7,317.22
交易性金融资产	-	7,672,125.03
其中：股票投资	-	7,672,125.03
债券投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	3,853,382.37	346,616.94
应收利息	47.55	136.40
应收申购款	-	655.32
<b>资产总计</b>	<b>4,254,375.85</b>	<b>8,607,658.46</b>
<b>负债和所有者权益</b>		
<b>负债：</b>		
卖出回购金融资产款	-	-
应付赎回款	459,373.67	360,443.69
应付管理人报酬	1,255.55	10,701.83
应付托管费	209.26	1,783.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,072.62	4,379.64
应付利息	-	-
其他负债	66,859.90	140,668.43
<b>负债合计</b>	<b>534,771.00</b>	<b>517,977.23</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	3,040,408.64	7,152,919.75
未分配利润	679,196.21	936,761.48
<b>所有者权益合计</b>	<b>3,719,604.85</b>	<b>8,089,681.23</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>4,254,375.85</b>	<b>8,607,658.46</b>

注：

1. 报告截止日 2020 年 7 月 7 日(基金最后运作日)，基金份额总额 3,040,408.64 份，基金份额净值为 1.2234 元。

2. 财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 7 日(基金最后运作日)止期间。

## 2、利润表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金

报告期间：2020年1月1日至2020年7月7日（基金最后运作日）

项目	本期 2020年1月1日至2020年7月7日 (基金最后运作日)	上年度可比期间 2019 年1月1日至2019年 12月31日
<b>一、收入</b>	<b>-213,087.93</b>	<b>17,822,911.29</b>
利息收入	2,132.04	15,911.34
其中：存款利息收入	2,132.04	15,911.34
债券利息收入	-	-
买入返售金融资 产收入	-	-
投资收益(损失以“-”填列)	-312,455.64	6,396,997.55
其中：股票投资收益	-367,370.36	5,883,212.41
债券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	54,914.72	513,785.14
公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	-28,118.90	11,240,043.78
其他收入	125,354.57	169,958.62
<b>减：二、费用</b>	<b>181,313.05</b>	<b>962,963.56</b>
管理人报酬	47,988.70	427,822.99
托管费	7,998.14	71,303.93
销售服务费	-	-
交易费用	34,372.58	301,574.96
利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产 支出	-	-
税金及附加	-	-
其他费用	90,953.63	162,261.68
<b>三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)</b>	<b>-394,400.98</b>	<b>16,859,947.73</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>	<b>-394,400.98</b>	<b>16,859,947.73</b>

注：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，注册会计师张炯、朱宏宇签字出具了普华永道中天特审字(2020)第 2874 号标准无保留意见

见的审计报告。

## 五、基金财产分配

本基金自 2020 年 7 月 8 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 2,471.19 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。上述款项已于 2020 年 8 月 4 日变现。

1.2 本基金最后运作日期货结算备付金 219.51 元，已于 2020 年 8 月 4 日变现。

1.3 本基金最后运作日应收利息为 47.55 元。其中应收活期银行存款利息为 44.79 元，应收期货结算备付金利息为 1.05 元，应收保证金利息金额为 1.71 元。上述款项中截止清算款划出日未能变现的，由基金管理人以自有资金垫付，于清算款划出日划入托管账户。

### 2、负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付赎回款 459,373.67 元，其中 174,752.35 于 2020 年 7 月 8 日支付，284,621.32 于 2020 年 7 月 9 日支付。

2.2 本基金最后运作日应付赎回费 1040.61 元，其中 398.09 于 2020 年 7 月 8 日支付，642.52 于 2020 年 7 月 9 日支付。

2.3 本基金最后运作日应付管理人报酬 1,255.55 元，该款项于 2020 年 8 月 4 日支付。

2.4 本基金最后运作日应付托管费 209.26 元，该款项于 2020 年 8 月 4 日支付。

2.5 应付交易费用 7,072.62 元，该款项已于 2020 年 7 月 23 日支付。

2.6 法律咨询律师费 40,000.00 元，该款项已于 2020 年 7 月 23 日支付。

2.7 应付审计费 25,819.29 元, 该款项待收到会计师事务所审计费发票后支付。

### 3、清算费用

按照《华泰柏瑞国企整合精选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, 清算过程中发生的费用主要为划款手续费、律师费等。

### 4、清算日的清算损益情况

项目	自 2020 年 7 月 8 日至 2020 年 8 月 7 日止清算期间
一、清算收益	
利息收入 (注 1)	1,017.20
股利收入	-4,888.33
赎回费收入	1,139.03
清算收入小计	-2,732.10
二、清算费用	
划款手续费	145
清算费用小计	145
三、清算净收益	-2,877.10

注 1: 利息收入系计提的自 2020 年 7 月 8 日至 2020 年 8 月 7 日止清算期间的利息收入, 其中活期存款利息为 1,013.69 元, 结算备付金利息为 0.27 元, 结算保证金利息为 2.16 元, 交易保证金利息为 1.08。

### 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 2020 年 7 月 7 日基金净资产	3,719,604.85
加: 清算期间净收益	-2,877.10
加: 清算期间基金份额交易产生的净值影响	-437,180.87
二、2020 年 8 月 7 日基金资产净值	3,279,546.88

注: 于 2020 年 7 月 7 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 357,349.10 份, 该赎回申请于 2020 年 7 月 8 日确认。于 2020 年 7 月 10 日, 由基金资产支付赎回款 435,153.93 元, 赎回费 887.91 元; 于 2020 年 7

月 8 日，基金收到赎回费收入 1,139.03 元。本基金剩余待清算份额余额为 2,683,059.54 份。

截至本次清算期结束日 2020 年 8 月 7 日，本基金剩余财产为 3,279,546.88 元。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。

清算起始日 2020 年 7 月 8 日至清算款划出日前一日的银行存款、备付金和存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有，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，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

## 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) 华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 7 月 7 日（基金最后运作日）止期间的财务报表及审计报告
- (2) 《华泰柏瑞国企整合精选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](http://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。

华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金  
基金财产清算小组

清算报告出具日: 2020年8月7日