

华宝安益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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2022年7月

一、重要提示

华宝安益混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2021】35号文准予注册，本基金基金合同于2021年9月29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”），基金托管人为中信银行股份有限公司（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》、《华宝安益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并终止基金合同，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2022年6月23日，自2022年6月24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2022年6月16日发布的《关于华宝安益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、基金托管人中信银行股份有限公司、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	华宝安益混合型证券投资基金
基金简称	华宝安益混合
基金主代码	011375
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年9月29日
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。
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、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）及存托凭证、债券（包括国债、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、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本

	基金的股票（含存托凭证）投资比例为基金资产的 0%-40%；同业存单投资占基金资产的比例不超过 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、本基金的投资策略还包括可转换债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、其他金融工具投资策略等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×80%
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	中信银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可【2021】35 号文准予注册，由基金管理人依照法律法规的规定及《基金合同》的约定自 2021 年 7 月 5 日至 2021 年 9 月 27 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2021 年 9 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,372,923.10 份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为 534 户。

根据基金合同“第五部分 基金备案”之“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 50 个工作日出现前述情形之一的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2022 年 6 月 14 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。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 2022 年 6 月 23 日，自 2022 年 6 月 24 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

(一) 华宝安益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 2022 年 6 月 23 日
资产：	
银行存款	37,762.52
结算备付金	205,766.43
存出保证金	10,321.96
资产合计：	253,850.91
负债：	
应付赎回款	16,520.55
应付管理人报酬	131.26
应付托管费	21.89
其他负债	9,081.95
负债合计：	25,755.65
所有者权益：	
实收基金	232,253.35
未分配利润	-4,158.09
所有者权益合计	228,095.26
负债与所有者权益合计：	253,850.91

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《证券投资基金会计核算业务指引》等有关规定编制的。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，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

六、清算情况

自2022年6月24日至2022年6月28日止清算期间，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

本基金最后运作日银行存款、结算备付金和存出保证金余额中包含应计利息余额为人民币63.33元，由于尚未结息，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131.26元，该款项已于2022年6月24日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币21.89元，该款项已于2022年6月24日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币16,520.55元，该款项已于2022年6月24日、2022年6月27日支付。清算期内产生应付赎回款1,123.13元，已于2022年6月27日、2022年6月28日支付。
- (4) 本基金最后运作日其他负债为人民币9,081.95元。其中应付审计费为人民币4,000.00元，该款项将于清算期结束后支付。其中应付律师费为人民币5,000.00元，该款项将于清算期结束后支付。应付交易费用为人民币75.00元，该款项将于清算期结束后支付。其中应付赎回费为人民币6.95元，该款项已于2022年6月24日支付。清算期内产生应付赎回费1.03元，已于2022年6月28日支付。

3、清算期间的清算损益情况

项目	自2022年6月24日 至2022年6月28日 止清算期间
一、收益	
1、利息收入	27.79
2、赎回费收入	1.08
收益小计	<u>28.87</u>

二、费用	
费用小计	-
三、清算期间净收益	28.87

4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额（单位：人民币元）
一、最后运作日 2022 年 6 月 23 日基金净资产	228,095.26
加：清算期间净收益	28.87
减：清算期间的赎回对价金额	1,125.24
二、2022 年 6 月 28 日基金净资产	226,998.89

资产处置及负债清偿后，于 2022 年 6 月 28 日本基金剩余财产为人民币 226,998.89 元，根据本基金的基金合同约定，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。

清算起始日 2022 年 6 月 24 日至清算款划出日前一日的银行存款利息，存出保证金利息和结算备付金利息均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。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。

七、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 《华宝安益混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《华宝安益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。

华宝安益混合型证券投资基金基金财产清算小组
2022年7月