

华宝新起点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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2023年9月

一、 重要提示

华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 8 月 25 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】1996 号文）和 2016 年 11 月 8 日中国证监会《关于准予华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2016】2564 号文）进行募集，本基金基金合同于 2016 年 12 月 19 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”），基金托管人为中国民生银行股份有限公司（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》、《华宝新起点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 2023 年 8 月 31 日，自 2023 年 9 月 1 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 2023 年 8 月 24 日发布的《关于华宝新起点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、基金托管人中国民生银行股份有限公司、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	华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝新起点混合
基金主代码	002111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月19日
投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过大类资产间的灵活配置和多样的投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券）、货币市场工具（质押及买断式回购、银行存款、同业存单等）、资产支持证券、股指期货、权证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（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>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。</p>
投资策略	<p>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 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 本基金将投资于债券，以有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>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。</p> <p>5、股指期货投资策略 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>本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>7、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。</p> <p>8、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×50%+上证国债指数收益率×50%
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	中国民生银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经 2015 年 8 月 25 日中国证监会《关于准予华宝兴业新起点灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2015】1996 号文）和 2016 年 11 月 8 日中国证监会《关于准予华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2016】2564 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 2016 年 12 月 12 日至 2016 年 12 月 14 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2016 年 12 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,056,202.54 份（含募集期间利息结转的份额），有效认购户数为 302 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 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，本基金合同终止，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 2023 年 8 月 22 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 2023 年 8 月 31 日，自 2023 年 9 月 1 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

华宝新起点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
	2023年8月31日
资产：	
银行存款	1,795,384.80
结算备付金	20,050,254.19
存出保证金	4,993.86
资产合计	21,850,632.85
负债：	
应付管理人报酬	12,070.84
应付托管费	3,017.70
应付赎回款	94,323.85
应付销售服务费	5,029.50
其他负债	85,557.37
负债合计	199,999.26
净资产：	
实收基金	16,861,476.02
未分配利润	4,789,157.57
净资产合计	21,650,633.59
负债和净资产合计	21,850,632.85

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2023年9月1日起至2023年9月5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。基金资产处置、负债清偿、清算期间的清算损益及基金净资产分配等情况如下：

1、 资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日银行存款为人民币1,795,384.80元，其中托管户存款为人民币1,794,003.88元，应计银行存款利息为人民币1,380.92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20,050,254.19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结算备付金为人民币38,529.98元，存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金为人民币20,000,000.00元，其中人民币20,000,000.00元已于2023年9月1日划入托管账户；应计结算备付金利息为人民币11,724.21元，由于银行尚未结息，该部分利息与尚未划回基金托管账户的结算备付金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际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4,993.86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2,348.64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2,605.30元，其中人民币1,599.88元已于2023年9月4日划入托管账户；应计存出保证金利息为人民币39.92元，由于银行尚未结息，该部分利息与尚未划回基金托管账户的存出保证金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际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12,070.84元，该款项已于2023年9月5日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币3,017.70元，该款项已于2023年9月5日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币5,029.50元，该款项已于2023年9月5日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币94,323.85元，该款项已于2023年9月1日、2023年9月4日支付。清算期内产生应付赎回款人民币10,231,097.46元，已于2023年9月5日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币85,557.37元。其中应付中证报信息披露费为人民币59,507.37元，该款项已于2023年9月4日支付；应付审计费为人民币16,000.00元，该款项已于2023年9月4日支付；应付律师费为人民币10,000.00元，该款项已于2023年9月4日支付；应付交易费用为人民币50.00元，该款项将于清算期后支付。

3、 清算期间的清算损益情况

	单位：人民币元
项目	自2023年9月1日 至2023年9月5日 止清算期间
一、收益	
1、利息收入（注1）	963.85
其他业务收入（注2）	19.07
收益小计	<u>982.92</u>
二、费用	
1、其他费用（注3）	240.50
费用小计	<u>240.50</u>
三、清算期间净损益	<u><u>742.42</u></u>

注1：利息收入系自2023年9月1日至2023年9月5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及结算备付金利息收入。

注2：其他业务收入系自2023年9月1日至2023年9月5日止清算期间的赎回费收入归基金资产。

注3：其他费用系自2023年9月1日至2023年9月5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2023年8月31日基金净资产	21,650,633.59
加：清算期间净损益	742.42
减：清算期间的赎回对价金额	10,231,116.53
二、2023年9月5日基金净资产	11,420,259.48

资产处置及负债清偿后，于清算结束日2023年9月5日，本基金剩余财产为人民币11,420,259.48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，按基金份额持有人的基金份额比例进行分配。

自清算起始日2023年9月1日至清算款划出日前一日的银行存款利息、结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，后续产生的各类划付手续费由投资者承担。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、尚未划回基金托管账户的结算备付金及存出保证金将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际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。

5、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、律师事务所出具的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，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

七、备查文件

1、备查文件目录

- (1) 《华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 关于《华宝新起点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。

华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金基金财产清算小组
2023年9月