

# 华安新希望灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年二月二日

## §1 重要提示

华安新希望灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2015]2051号《关于准予华安新希望灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及中国证监会证券投资基金机构监管部机构部函[2016]2355号《关于华安新希望灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人自2016年11月11日至2016年11月15日期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第60971571\_B21号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年11月18日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,份额注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据市场环境变化,为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,基金管理人依据《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《华安新希望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,终止《基金合同》。鉴于华安新希望灵活配置混合型证券投资基金已连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元,为维护基金份额持有人利益,根据本基金基金合同的约定,不需召开基金份额持有人大会,本基金管理人与基金托管人协商一致,决定本基金最后运作日为2017年12月25日,自2017年12月26日进入清算期。

由基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2017年12月26日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并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,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## §2 基金产品概况

基金简称	华安新希望灵活配置混合
基金主代码	002037
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年11月18日
报告期末(2017年12月25日)基金份额总额	10,021,056.62份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。
业绩比较基准	50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

### §3 基金运作情况概述

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[2015]2051号《关于准予华安新希望灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及中国证监会证券基金机构监管部机构部函[2016]2355号《关于华安新希望灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自2016年11月11日至2016年11月15日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2016)验字第60971571\_B21号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年11月18日生效。首次设立募集规模为600,005,014.21份基金份额，其中认购资金利息折合0.30份基金份额。自2016年11月18日至2017年12月25日期间，本基金按基金合同正常运作。

为适应市场环境变化，更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《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《基金合同》的有关规定，终止《基金合同》。鉴于华安新希望灵活配置混合型证券投资基金已连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元，为维护基金份额持有人利益，根据本基金基金合同的约定，不需召开基金份额持有人大会，本基金管理人与基金托管人协商一致，决定本基金最后运作日为2017年12月25日，自2017年12月26日进入清算期。

### §4 财务报告

#### 4.1 资产负债表

会计主体：华安新希望灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月25日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2017年12月25日
<b>资 产：</b>	
银行存款	11,246,674.40
结算备付金	47,727.27

存出保证金	18,084.30
应收利息	2,513.18
资产总计	11,314,999.15
<b>负债和所有者权益</b>	<b>最后运作日</b> <b>2017年12月25日</b>
<b>负 债:</b>	
应付赎回款	15.24
应付管理人报酬	4,604.87
应付托管费	1,151.22
应付销售服务费	3.64
其他负债	559,000.00
负债合计	564,774.97
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	10,021,056.62
未分配利润	729,167.56
所有者权益合计	10,750,224.18
负债和所有者权益总计	11,314,999.15

#### 4.2 利润表

会计主体：华安新希望灵活配置混合型证券投资基金

报告期间：2017年1月1日至2017年12月25日

项 目	本期 2017年1月1日至2017年12月25日 (基金最后运作日)
一、收入	27,385,490.86
1、利息收入	14,036,410.41
其中：存款利息收入	3,850,408.62
债券利息收入	7,416,993.89
买入返售金融资产收入	2,769,007.90
2、投资收益（损失以“-”填列）	13,374,035.25
其中：股票投资收益	11,577,960.70
债券投资收益	5,699.18
股利收益	1,790,375.37
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-27,668.76

4、其他收入（损失以“-”填列）	2,713.96
二、费用	3,541,136.30
1、管理人报酬	2,280,770.32
2、托管费	570,192.54
3、销售服务费	27.04
4、交易费用	259,876.63
5、利息支出	670.45
其中：卖出回购金融资产支出	670.45
6、其他费用	429,599.32
三、利润总额	23,844,354.56

注：本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师蒋燕华、蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)专字第 60971571\_B01 号标准无保留意见的审计报告。

## §5 基金财产分配

自 2017 年 12 月 26 日至 2018 年 1 月 2 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：

### 5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日存出保证金人民币 18,084.30 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的结算保证金。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2017 年 12 月 25 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日孳生的利息归基金资产所有，到账日第二日起垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金人民币 47,727.27 元，为存放于上海证券交易所的结算备付金。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2017 年 12 月 25 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日孳生的利息归基金资产所有，到账日第二日起垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

5.1.3 本基金最后运作日应收利息为人民币 2,513.18 元。其中应收银行存款利息人民币 2,498.38 元，应收结算备付金利息人民币 10.75 元，应收存出保证金利息人民币 4.05 元，上述款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于 2017 年 12 月 25 日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日孳生的利息归基金资产所有，到账日第二日起垫付资金孳生的利息归基金管理人所有。

## 5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 15.24 元，该款项已于 2017 年 12 月 26 日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 4,604.87 元，该款项已于 2017 年 12 月 26 日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,151.22 元，该款项已于 2017 年 12 月 26 日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 3.64 元，该款项已于 2017 年 12 月 26 日支付。

5.2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 559,000.00 元。其中应付证券时报信息披露费人民币 100,000.00 元，该款项已于 2017 年 12 月 29 日支付；应付中央国债登记结算有限责任公司交易费用人民币 9,000.00 元及应付基金管理人垫付款人民币 450,000.00 元将于 2018 年 1 月 2 日后支付。

## 5.3 清算期间的清算损益情况

5.3.1 清算期间持有的利息收入金额 3,885.90 元，系计提的自 2017 年 12 月 26 日至 2018 年 1 月 2 日的利息收入合计。

5.3.2 按照《华安新希望灵活配置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”的约定，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，从保护基金份额持有人份额人利益的角度出发，本基金的清算费用将由基金管理人代为支付。

#### 5.4 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2017年12月25日基金净资产	10,750,224.18
加：清算期间净收益	3,885.90
减：基金净赎回转出金额（于2017年12月26日确认的投资者赎回转出申请）	3.80
二、2018年1月2日基金净资产	10,754,106.28

根据本基金的基金合同及《华安新希望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》的约定，将基金财产清算后的全部剩余资产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。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2018年1月2日止的剩余财产为人民币10,754,106.28元。

截至2018年1月2日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币11,140,895.63元，其中人民币450,000.00元系基金管理人代垫的存出保证金、结算备付金以及以当前适用的利率预估的银行存款、存出保证金及结算备付金利息。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人负有义务于收到基金托管人通知后当日内将款项补足。

#### 5.5 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，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

## §6 备查文件

### 6.1 备查文件目录

- 1、华安新希望灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 12 月 25 日资产负债表及审计报告
- 2、《华安新希望灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

### 6.2 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 <http://www.huaan.com.cn>。

### 6.3 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。

华安新希望灵活配置混合型证券投资基金  
基金财产清算小组

二〇一八年一月二日