

华安新瑞利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：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2022年12月17日

§1 重要提示

华安新瑞利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[2016]2607号《关于准予华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，于2016年12月01日成立并正式运作。

根据市场环境变化，为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《华安新瑞利灵活配置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信银行股份有限公司协商一致，提议终止《华安新瑞利灵活配置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。根据管理人2022年12月06日发布的《华安基金管理有限公司关于华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于2022年12月05日表决通过了《关于终止华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为2022年12月06日，自2022年12月07日进入清算期。

基金管理人华安基金管理有限公司、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）和上海源泰律师事务所于2022年12月07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	华安新瑞利灵活配置混合
基金主代码	003797
交易代码	003797
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2016 年 12 月 01 日	
报告期末（2022 年 12 月 06 日）基金份额总额	366,451.89 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	中证 800 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%	
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	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安新瑞利灵活配置混合 A	华安新瑞利灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	003797	003798
报告期末下属分级基金的份额总额	357,217.65 份	9,234.24 份

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2607号注册，由基金管理人华安基金管理有限公司依照法律法规、《华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等规定于2016年11月23日至2016年11月28日向社会公开发行募集，基金合同于2016年12月01日生效。基金合同生效日的基金总份额为600,011,815.21份基金份额。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

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《华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，经与本基金托管人协商一致，提议终止《华安新瑞利灵活配置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。根据管理人2022年12月06日发布的《华安基金管理有限公司关于华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于2022年12月05日表决通过了《关于终止华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为2022年12月06日，自2022年12月07日进入清算期。

§4 财务报告

4.1 资产负债表

会计主体：华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月06日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2022年12月06日
资 产：	
银行存款	624,840.11

结算备付金	580.72
存出保证金	11,213.20
应收申购款	99.85
资产总计	636,733.88
负债和净资产	最后运作日 2022年12月06日
负 债:	
其他负债	147,296.81
负债合计	147,296.81
所有者权益:	
实收基金	366,451.89
未分配利润	122,985.18
净资产合计	489,437.07
负债和净资产总计	636,733.88

注 1：本基金的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。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，本清算财务报表并无比较期间的数据列示。

注 2：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，注册会计师陈胜、张旭颖签字出具了安永华明（2022）专字第 60971571_B11 号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2022 年 12 月 07 日至 2022 年 12 月 13 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 本基金最后运作日银行存款为人民币 624,840.11 元，其中存放于托管账户人民币 622,292.69 元，应计银行存款利息人民币 2,547.42 元。应计银行存款

利息由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，基金管理人垫付资金已于 2022 年 12 月 7 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。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币 580.72 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人民币 467.20 元，应计结算备付金利息人民币 113.32 元；其中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人民币 0.00 元，应计结算备付金利息人民币 0.20 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，基金管理人垫付资金已于 2022 年 12 月 7 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。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币 11,213.20 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人民币 6,574.63 元，应计存出保证金利息人民币 24.32 元；其中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人民币 4,594.59 元，应计存出保证金利息人民币 19.66 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，基金管理人垫付资金已于 2022 年 12 月 7 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。

5.1.4 本基金最后运作日应收申购款为人民币 99.85 元，已于 2022 年 12 月 7 日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日其他负债为人民币 147,296.81 元，其中预提审计费人民币 46,576.60 元，该款项将于本基金年度财务报表审计报告出具后支付，若因本基金终止运作未出具年度财务报表审计报告，冲回该项预提费用产生的收益将按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人；其中预提信息披露费 100,000.00 元，该款项将于 2022 年 12 月 13 日之后支付；其中应付交易费用人民币 720.21 元，将于 2022 年 12 月 13 日之后支付。

5.3 清算期间的清算损益情况

项目	自2022年12月07日 至2022年12月13日 止清算期间
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	88.20
2、其他收入（注2）	7.83
清算收入小计	96.03
二、清算费用	
其他费用小计	-
三、清算净收益	96.03

注 1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2022 年 12 月 07 日至 2022 年 12 月 13 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。其中预提的银行存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息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 2022 年 12 月 07 日划入托管账户。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。

注 2：其他收入系基金赎回费收入。

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2022年12月06日基金净资产	489,437.07
加：清算期间净收益	96.03
基金净申购转入金额 （于2022年12月7日确认的投资者申购转入申请）	1,499.78
减：基金净赎回转出金额 （于2022年12月7日确认的投资者赎回转出申请）	35,236.63
二、2022年12月13日基金净资产	455,796.25

根据本基金的基金合同的约定，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。

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。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析。

§6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- 2、关于《华安新瑞利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>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>），清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

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。

华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二二年十二月十三日（清算报告出具日）