

华泰柏瑞基金管理有限公司
华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金
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：中国农业银行股份有限公司

清算报告出具日：2025 年 8 月 15 日

清算报告公告日：2025 年 8 月 19 日

华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2022 年 8 月 26 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2022]1982 号）注册募集。《华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）自 2023 年 3 月 14 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定：“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，管理人应及时通知基金托管人，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会审议。”截至 2025 年 7 月 24 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。根据基金合同约定，本基金管理人决定终止本基金基金合同，并对本基金基金财产进行清算，不需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于 2025 年 7 月 25 日刊登了《华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后运作日为 2025 年 7 月 24 日，自 2025 年 7 月 25 日起进入清算程序。自 2025 年 7 月 25 日起，停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。

基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于 2025 年 7 月 25 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所(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	华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞上证 50 指数增强
基金代码	016697/016698
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 14 日
最后运作日 (2025 年 7 月 24 日) 基金份额总额	17,470,653.66 份
投资目标	本基金力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。同时力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。
投资策略	1、股票投资策略 本基金为增强型指数基金，主要利用量化投资模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。 本基金运用的量化投资模型主要包括： (1) 多因子 alpha 模型——股票超额回报预测 多因子 alpha 模型以中国股票市场较长期的回溯研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类：价值（value）、质量（quality）、动量（momentum）、成长（growth）、市场预期等等。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库，

	科学地考虑了大量的各类信息，包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等等多方的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适合调整各因子类别的具体组成及权重。 (2) 风险估测模型——有效控制预期风险 (3) 交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩 (4) 投资组合的优化和调整 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金根据投资需要或市场环境变化，选择将部分资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资于港股。 2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、衍生品投资策略：(1) 股指期货投资策略；(2) 股票期权投资策略；(3) 国债期货投资策略；5、存托凭证投资策略；6、融资及转融通证券出借业务的投资策略。
业绩比较基准	上证 50 指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票，除需承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险，还需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

三、基金运作情况

华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2022 年 8 月 26 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2022]1982 号）注册募集。《华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）自 2023 年 3 月 14 日起生效，基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《基金合同》第五部分“基金备案”第三条约定：“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，管理人应及时通知基金托管人，基金合同终止，无需召开基金份额持有人大会审议。”截至 2025 年 7 月 24 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。根据基金合同约定，本基金管理人决定终止本基金基金合同，并对本基金基金财产进行清算，不需召开基金份额持有人大会。基金管理人已就该事项于 2025 年 7 月 25 日刊登了《华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。本基金最后运作日为 2025 年 7 月 24 日，自 2025 年 7 月 25 日起进入清算程序。自 2025 年 7 月 25 日起，停止收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。

基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司、基金托管人中国农业银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于 2025 年 7 月 25 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所(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。

四、财务会计报告

1、资产负债表（已审计）

会计主体：华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 7 月 24 日

单位：人民币元

资产	本期末 2025 年 7 月 24 日 (基金最后运作日)
资产：	
货币资金	3,444,011.38
结算备付金	88,356.19
存出保证金	7,939.84
交易性金融资产	16,417,266.30
其中：股票投资	16,417,266.30
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	13,797,611.03
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	33,755,184.74

负债和净资产	本期末 2025 年 7 月 24 日 (基金最后运作日)
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	14,208,058.47
应付管理人报酬	31,186.82
应付托管费	2,598.92
应付销售服务费	2,271.20
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	104,237.40
负债合计	14,348,352.81
净资产：	-
实收基金	17,470,653.66
其他综合收益	-
未分配利润	1,936,178.27
净资产合计	19,406,831.93
负债和净资产总计	33,755,184.74

注：报告截止日 2025 年 7 月 24 日，基金份额总额 17,470,653.66 份，其中华泰柏瑞上证 50 指数增强 A 类基金份额净值 1.1141 元，基金份额 12,086,713.79 份；华泰柏瑞上证 50 指数增强 C 类基金份额净值 1.1035 元，基金份额 5,383,939.87 份。

财务报告已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师许胡小骏、冯适签字出具了德师报(审)字(25)第 S00663 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

自 2025 年 7 月 25 日至 2025 年 7 月 31 日为止为本基金清算期间，本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 本基金最后运作日货币资金为人民币 3,444,011.38 元，其中活期存款为人民币 3,442,983.80 元，应计活期存款利息为人民币 1,027.58 元。清算结束日货币资金为人民币 17,690,992.42 元，其中活期存款为人民币 17,689,057.62 元，应计活期存款利息为人民币 1,934.80 元。清算款划出日前一日的应计活期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。

1.2 本基金最后运作日结算备付金为人民币 88,356.19 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 57,767.60 元，应计结算备付金利息为人民币 19.38 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 12,759.17 元，应计结算备付金利息为人民币 6.63 元；存放于上海东证期货有限公司的结算备付金为人民币 16,253.84 元，应计结算备付金利息为人民币 18.02 元；存放于国投安信期货有限公司的结算备付金为人民币 1,529.85 元，应计结算备付金利息为人民币 1.70 元。清算结束日结算备付金为人民币 70,557.54 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 57,767.60 元，应计结算备付金利息为人民币 23.30 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 12,759.17 元，应计结算备付金利息为人民币 7.47 元。清算款划出日前一日的该部分应计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。

1.3 本基金最后运作日存出保证金为人民币 7,939.84 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 5,358.42 元，应计存出保证金利息为人民币 1.81 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 2,578.70 元，应计存出保证金利息为人民币 0.91 元。

清算结束日存出保证金为人民币 7,940.40 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 5,358.42 元,应计存出保证金利息为人民币 2.16 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 2,578.70 元,应计存出保证金利息为人民币 1.12 元。清算款划出日前一日的该部分应计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。

1.4 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 16,417,266.30 元,已于 2025 年 7 月 31 日(清算结束日)前完成处置变现。

1.5 本基金最后运作日应收清算款为人民币 13,797,611.03 元,已于 2025 年 7 月 31 日前全部划入基金托管户。

2、负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 14,208,058.47 元,已于 2025 年 7 月 31 日(清算结束日)前支付。

2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 31,186.82 元,已于 2025 年 7 月 31 日(清算结束日)前支付。

2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币 2,598.92 元,已于 2025 年 7 月 31 日(清算结束日)前支付。

2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 2,271.20 元,已于 2025 年 7 月 31 日(清算结束日)前支付。

2.5 本基金清算结束日应付清算款为人民币 6,792.59 元,已于 2025 年 8 月 1 日前全部划出基金托管户。

2.6 本基金最后运作日其他负债为人民币 104,237.40 元,其中应付交易费用为人民币 17,947.09 元及应付赎回费为人民币 15,317.96 元,已于 2025 年 7 月 31 日(清算结束日)前支付;预提审计费为人民币 14,040.45 元,其中实际应付的审计费为人民币 10,000.00 元,已于 2025 年 7 月 31 日支付(清算结束日)支付,同时多计提的审计费人民币 4,040.45 元已冲回;预提律师费为人民币 10,000.00 元,已于 2025 年 8 月 1 日支付;预提信息披露费为人民币 44,931.90 元,已于 2025 年 8 月 7 日支付;预提清盘费用为人民币 2,000.00 元,尚未支付。

3、清算费用

按照《华泰柏瑞上证 50 指数增强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。

4、停止运作后的清算损益情况说明

单位：人民币元

项 目	最后运作日后一日至清算结束日： 2025 年 7 月 25 日至 2025 年 7 月 31 日
一、营业总收入	72,570.33
1.利息收入	915.59
其中：存款利息收入	915.59
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,429,742.88
其中：股票投资收益	2,454,525.85
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-24,782.97
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-
其他投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,358,207.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	119.71
减：二、营业总支出	-3,515.87
1. 管理人报酬	-
其中：暂估管理人报酬	-
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-

4. 投资顾问费	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 信用减值损失	-
7. 税金及附加	-
8. 其他费用	-3,515.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	76,086.20
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	76,086.20
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	76,086.20

注：1、利息收入共计人民币 915.59 元，系自清算开始日至清算结束日止期间计提的银行存款利息收入人民币 907.22 元、存出保证金利息收入人民币 0.56 元及结算备付金利息收入人民币 7.81 元。

2、投资收益共计人民币 2,429,742.88 元，其中股票投资收益为人民币 2,454,525.85 元，系自清算开始日至清算结束日止期间处置股票投资所产生的股票价差收入；股利收益为人民币-24,782.97 元，系股票对价派息人民币 9,334.22 元及卖出股票而支付的红利补税款人民币 34,117.19 元。

3、公允价值变动损益系自清算开始日至清算结束日止期间持有股票所产生的公允价值变动损失人民币 2,358,207.85 元。

4、其他收入共计人民币 119.71 元，系自清算开始日至清算结束日止期间产生的赎回费归基金资产部分人民币 117.53 元及补差费归基金资产部分人民币 2.18 元。

5、其他费用为人民币-3,515.87 元，系自清算开始日至清算结束日止期间计提并支付的汇划手续费人民币 524.58 元及冲回多计提的审计费人民币 4,040.45 元。

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 2025 年 7 月 24 日基金净资产	19,406,831.93
加：清算期间净收益	76,086.20
减：确认赎回对净值的影响	1,777,152.26
二、2025 年 7 月 31 日基金资产净值	17,705,765.87

截至本次清算期结束日2025年7月31日，本基金剩余财产为17,705,765.87元。本基金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。

本基金最后运作日后一日2025年7月25日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金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、律师事务所出具的法律意见书一并报上海证监局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) 华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金清算财务报表及审计报告
- (2) 《华泰柏瑞上证 50 指数增强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。

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。

华泰柏瑞上证 50 指数增强型证券投资基金
基金财产清算小组

清算报告出具日：2025 年 8 月 15 日