

华泰紫金零钱宝货币市场基金

清算报告

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告出具日：2022年3月25日

报告送出日：2022年3月31日

一、重要提示

华泰紫金零钱宝货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金零钱宝货币市场基金注册的批复》（证监许可[2017]907号）批准募集，本基金于2017年8月24日成立并正式运作。基金管理人为华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据市场变化，为保护基金份额持有人的利益，基金管理人经与基金托管人协商一致，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》、《华泰紫金零钱宝货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，提议终止《基金合同》。本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议表决时间为2022年2月14日至2022年3月11日，2022年3月15日在基金托管人授权代表的监督下，基金管理人对本次大会表决进行了计票，会议表决通过了《关于终止华泰紫金零钱宝货币市场基金基金合同有关事项的议案》。基金份额持有人大会的表决结果及决议生效公告详见2022年3月16日刊登在《证券时报》和基金管理人网站（<https://htamc.htsc.com.cn>）等规定媒介上的《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于华泰紫金零钱宝货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本基金的最后运作日为2022年3月16日，自2022年3月17日起进入清算期，由本基金管理人华泰证券（上海）资产管理有限公司、基金托管人招商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所（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，并由毕马威华振会计师事务所（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

基金简称	华泰紫金零钱宝货币
基金主代码	004860
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月24日
清算起始日	2022年3月17日
最后运作日基金份额总额	311,881,721.22份
投资目标	在控制投资组合风险,保持相对流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将资产配置和精选个券相结合,在动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上,精选优质个券构建投资组合,在严格控制风险的基础上,实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种,其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

三、基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金零钱宝货币市场基金注册的批复》(证监许可[2017]907号)批准募集,《基金合同》于2017年8月24日生效,首次设立募集规模为265,160,626.53份基金份额。自2017年8月24日至2022年3月16日期间,本基金按《基金合同》的约定正常运作。

根据市场变化,为保护基金份额持有人的利益,基金管理人根据《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》、《基金合同》的有关规定,本基金召开了基金份额持有人大会,会议表决通过了《关于终止华泰紫金零钱宝货币市场基金基金合同有关事项的议案》。本基金自2022年3月17日起进入清算期。

四、财务会计报告

最后运作日资产负债表(已经审计)

会计主体：华泰紫金零钱宝货币市场基金

报告截止日：2022年3月16日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2022年3月16日 (基金最后运作日)
资 产：	
银行存款	92,502,921.51
结算备付金	2,026.44
存出保证金	
交易性金融资产	119,972,431.76
买入返售金融资产	99,755,739.04
应收证券清算款	
应收利息	
资产总计	312,233,118.75
负债和所有者权益	
负 债：	
应付清算款	15,020.61
应付赎回款	
应付管理人报酬	36,378.06
应付托管费	7,275.61
应付销售服务费	3,637.82
应付利润	10,128.43
其他负债	278,957.00
负债合计	351,397.53
所有者权益：	
实收基金	311,881,721.22
未分配利润	
所有者权益合计	311,881,721.22

负债和所有者权益总计	312,233,118.75
------------	----------------

注：应付清算款为应付交易费

五、清算事项说明

自 2022 年 3 月 17 日至 2022 年 3 月 25 日止为清算期间，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、清算费用

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，根据《基金合同》约定，本基金的清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日托管户银行存款余额为人民币 78,036,242.46 元，应收利息为 58,368.67 元，清算期间净流入人民币 220,893,142.70 元，存款投资户余额为人民币 14,408,310.38 元，已于清算期间划至托管户。清算结束日托管户银行存款余额为人民币 298,929,385.16 元，应收利息为 13,198.49 元，为优先分配给基金份额持有人，应收利息部分由基金管理人以留存管理费垫付；

(2) 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 2,026.44 元，其中上海结算备付金为人民币 1,771.53 元，深圳结算备付金为人民币 254.91 元，均为结算备付金利息，该款项已于清算期间的季度结息日划至托管账户；

(3) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 119,972,431.76 元，全部为同业存单投资。该同业存单投资已于清算期间处置变现，变现产生的银行存款为人民币 120,000,000.00 元，已于清算期间划至托管账户；

(4) 本基金最后运作日持有的买入返售金融资产余额为人民币 99,755,739.04 元，该投资已于清算期间处置变现，变现产生的银行存款为人民币 99,755,739.04 元，已于清算期间划至托管账户；

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 7,275.61 元，该款项已于清算期间支付；

(2) 本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 3,627.82 元，该款项已于清算期间支付；

(3) 本基金最后运作日应付信息披露费为人民币 144,657.00 元，已于清算期间支付；

- (4) 本基金最后运作日应付审计费为人民币 60,000.00 元，已于清算期间支付；
- (5) 本基金最后运作日应付律师费为人民币 50,000.00 元，已于清算期间支付；
- (6) 本基金最后运作日应付公证费为人民币 15,000.00 元，已于清算期间支付；
- (7) 本基金最后运作日应付利润为人民币 10,128.43 元，已于清算期间结转为投资者份额，清算结束日的应付利润为人民币 2,675.87 元；
- (8) 本基金最后运作日应付清算款为人民币 15,020.61 元，该款项待清算结束后支付；
- (9) 本基金最后运作日应付账户维护费为人民币 9,300.00 元，该款项待清算结束后支付；
- (10) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 36,378.06 元，该款项留存在托管户垫付冻结资产，待清算结束后支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	清算报告期间
	2022 年 3 月 17 日至 2022 年 3 月 25 日
一、清算收入	
1、利息收入	30,338.54
2、投资收益（损失以“-”填列）	27,568.24
3、其他业务收入（损失以“-”填列）	0
清算收入小计	57,906.78
二、清算支出	
1、税金及附加	0
2、其他费用	530.99
清算支出小计	530.99
三、清算净收益（净亏损以“-”列）	57,375.79

注：其他费用为支付的银行汇划费。

5、截至本次清算期结束日的剩余财产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2022 年 3 月 16 日基金净资产	311,881,721.22

加：清算期间净收益	57,375.79
加：最后运作日尚未结转实收基金的应付利润	10,128.43
减：清算结束日尚未结转实收基金的应付利润	2,675.87
减：赎回金额（含费用）	13,067,570.46
二、2022年3月25日基金净资产	298,878,979.11

注：本基金为 T+1 日结转收益

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算结束日 2022 年 3 月 25 日，本基金剩余财产为人民币 298,878,979.11 元。根据《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。自本次清算结束日次日(2022 年 3 月 26 日)至清算款项支付日前一日(2022 年 3 月 30 日)的银行存款产生的利息共计人民币 14,531.30 元，其归基金份额持有人所有，故本基金的最终剩余清算总资产为人民币 298,896,186.28 元，该款项将于 2022 年 3 月 31 日由基金托管户划出，其中应收利息为人民币 27,729.79 元（该金额与实际结息金额可能存在尾差），将由基金管理人以留存管理费垫付供清盘分配使用，留存的管理费将于清算结束后划至基金管理人。

6、基金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券监督管理委员会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- (1) 《华泰紫金零钱宝货币市场基金清算审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈华泰紫金零钱宝货币市场基金清算报告〉的法律意见》。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

华泰紫金零钱宝货币市场基金基金财产清算小组

2022 年 3 月 31 日