

华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金清 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：2024 年 10 月 11 日

报告送出日：2024 年 10 月 18 日

一、重要提示

华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]2417 号）批准募集，《华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》或“基金合同”）于 2020 年 2 月 26 日生效并正式运作。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《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”中的约定：“《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 50 个工作日出现前述情形的，《基金合同》终止，不需要召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2024 年 9 月 27 日日终，本基金连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，触发基金合同约定的终止条款。本基金根据《基金合同》约定终止并进入清算程序，且无需召开基金份额持有人大会。

本基金的最后运作日为 2024 年 9 月 27 日，自 2024 年 9 月 28 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

基金名称	华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金	
基金简称	华泰紫金周周购 3 月滚动债	
基金主代码	008941	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 2 月 26 日	
清算起始日	2024 年 9 月 28 日	
最后运作日(2024 年 9 月 27 日)基金份额总额	29,033,444.08 份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值,为投资者实现超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	1、资产配置策略。2、久期策略。3、类属配置策略。4、信用债投资策略。5、杠杆投资策略。6、再投资策略。7、资产支持证券的投资策略。8、国债期货投资策略。9、可转换债券投资策略。10、股票投资策略。	
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率×95%+沪深 300 指数收益率×5%	
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金周周购 3 月滚动债 A	华泰紫金周周购 3 月滚动债 C
下属分级基金的交易代码	008941	008942
最后运作日(2024 年 9 月 27 日)下属分级基金的份额总额	12,401,086.28 份	16,632,357.80 份

三、基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2019]2417 号)注册,由华泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《基金合同》负责公开募集,基金合同于 2020 年 2 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

1,019,454,422.33 份，其中认购利息折合 45,890.58 份。

自 2020 年 2 月 26 日至 2024 年 9 月 27 日期间，本基金按基金合同正常运作。

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”中的约定：“《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 50 个工作日出现前述情形的，《基金合同》终止，不需要召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

根据《基金合同》以及基金管理人于 2024 年 9 月 28 日发布的《华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，截至 2024 年 9 月 27 日日终，本基金连续 50 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，触发前述《基金合同》终止的情形。为维护基金份额持有人利益，根据基金合同约定，无需召开基金份额持有人大会，本基金合同自动终止并依法履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日为 2024 年 9 月 27 日，自 2024 年 9 月 28 日起进入清算程序。

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：华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 9 月 27 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2024 年 9 月 27 日 (基金最后运作日)
资 产：	
货币资金	22,419,306.56
结算备付金	449,421.13
存出保证金	12,992.11
买入返售金融资产	-1,225.99
应收清算款	11,769,150.57
应收申购款	10,010.00
资产总计	34,659,654.38
负 债：	
应付赎回款	4,978.96

应付管理人报酬	10,468.95
应付托管费	2,093.80
应付销售服务费	2,900.90
应交税费	430.27
其他负债	49,186.90
负债合计	70,059.78
净资产：	
实收基金	29,033,444.08
未分配利润	5,556,150.52
净资产合计	34,589,594.60
负债和净资产总计	34,659,654.38

注：报告截止日 2024 年 9 月 27 日(基金最后运作日)，基金总份额 29,033,444.08 份，其中 A 类基金份额净值 1.2009 元，A 类基金份额 12,401,086.28 份；C 类基金份额净值 1.1843 元，C 类基金份额 16,632,357.80 份。

五、清算事项说明

自 2024 年 9 月 28 日至 2024 年 10 月 9 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：

5.1 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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。根据本基金的基金合同约定，本基金的清算费用由基金财产承担。

5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日货币资金余额为人民币 22,419,306.56 元(含应计利息 498.59 元)；清算结束日货币资金余额为人民币 34,141,915.27 元(含应计利息 4,252.65 元)；

(2) 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 449,421.13 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金本金和应计利息，中国证券登记结算有限责任公司每月初第 6 个工作日对结算备付金进行调整，存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金应计利息预计于 2024 年 12 月 23 日收回；

(3) 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 12,992.11 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金本金和应计利息。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 2 个工作日对存出保证金进行调整，存放于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金

应计利息预计于 2024 年 12 月 23 日收回；

(4) 本基金最后运作日应收证券清算款余额为人民币 11,769,150.57 元，该款项已于清算期间收到；

(5) 本基金最后运作日买入返售金融资产余额为人民币-1,225.99 元，该款项已于清算期间结清；

(6) 本基金最后运作日应收申购款余额为人民币 10,010.00 元，该款项已于清算期间收到。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 4,978.96 元，该款项已于清算期间支付；

(2) 本基金最后运作日应付管理费余额为人民币 10,468.95 元，该款项已于清算期间支付；

(3) 本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 2,093.80 元，该款项已于清算期间支付；

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 2,900.90 元，该款项已于清算期间支付；

(5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 430.27 元，该款项已于清算期间支付；

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 49,186.90 元，包括应付交易费、应付银行手续费、预提律师费、预提审计费、预提账户维护费等费用。其中：

1) 应付银行手续费为人民币 579.20 元，该款项于次月初由银行自动扣除；

2) 预提律师费为人民币 10,000.00 元，该款项已于清算期间支付；

3) 预提审计费为人民币 10,000.00 元，该款项已于清算期间支付；

4) 预提账户维护费为人民币 9,300.00 元，该款项已于清算期间支付；

5) 应付交易费为人民币 19,307.70 元，其中银行间交易手续费 171.60 元按实际账单日期支付，其余应付款项已于清算期间支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

清算损益表（已经审计）

单位：人民币元

项 目	2024 年 9 月 28 日至 2024 年 10 月 9 日 (清算期间)
一、清算收入	5,193.23
利息收入	5,193.23
投资收益（损失以“-”填列）	-
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-
其他业务收入	-
二、清算费用	293.58
税金及附加	3.58
其他费用	290.00
三、清算收益	4,899.65
减：所得税费用	-
四、清算净收益（净亏损以“-”号填列）	4,899.65

注：其他费用为支付的银行汇划费。

5.5 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 2024 年 9 月 27 日基金净资产	34,589,594.60
加：清算报告期间净收益（净亏损以“-”号填列）	4,899.65
减：2024 年 9 月 27 日赎回转出确认金额	3,860.64
二、清算结束日 2024 年 10 月 9 日基金净资产	34,590,633.61

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算期结束日2024年10月9日，本基金剩余财产为34,590,633.61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各类基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日(2024年10月10日)至清算款项支付日前一日(2024年10月17日)的银行存款、结算备付金和存出保证金孳生的利息归基金份额持有人所有，最终支付清算款金额以基金管理人的记录为准，该款项将于2024年10月18日由基金托管户划出。

为维护基金份额持有人利益，加快清盘速度，清盘过程中的冻结资产（包括未到账的结算备付金本金及应计利息、存出保证金应计利息、银行存款应计利息等款项）由基金管理人自有资金先行垫付，各项利息及费用与实际结算金额的尾差由基金管理人承担，基金管理人

垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5.6 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监会备案后向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

6.1 备查文件目录

- (1) 《华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 《上海市通力律师事务所关于〈华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金清算报告〉的法律意见》。

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 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。

华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金基金财产清算小组

2024 年 10 月 11 日