

华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金

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12月25日

报告送出日：2024年12月31日

一、重要提示

华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]363号）批准募集，《华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》或“基金合同”）于2019年8月29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《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，“……《基金合同》生效三年后持续存续的，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60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至2024年7月25日，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会上海监管局提交了终止基金合同的解决方案，并以通讯方式召开基金份额持有人大会，于2024年12月17日表决通过了《关于终止华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据2024年12月18日发布的《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于华泰紫金丰利中短债债券型发起式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》，本基金自2024年12月19日起进入基金财产清算程序。

本基金的最后运作日为2024年12月18日，自2024年12月19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、德勤华永会计师事务所（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，并由德勤华永会计师事务所（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	华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金
基金简称	华泰紫金丰利中短债发起
基金主代码	007821
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年8月29日
清算起始日	2024年12月19日
最后运作日(2024年12月18日)基金份额总额	16,244,062.17份
投资目标	通过基金管理人以对短期融资券和超级短期融资券为主的债券的深入研究和对市场环境的判断,选择具有投资价值的债券,严格控制风险,力争实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法,进行前瞻性的决策。一方面,本基金将分析和预测众多的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等),并关注国家财政、税收、货币、汇率政策和其它证券市场政策等。</p> <p>另一方面,本基金将对中短期债券市场收益率曲线和信用利差的变化进行深入细致分析,从而得出对市场走势和波动特征判断。在此基础上,确定资产在不同行业、不同品种的债券之间的配置比例。</p> <p>2、固定收益类品种投资策略</p> <p>本基金灵活应用各种期限结构策略、买入持有策略、信用策略、互换策略、息差策略,在合理管理并控制信用风险的前提下选择有投资价值的个券,最大化组合收益。</p>
业绩比较基准	中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。

风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	华泰紫金丰利中短债发起 A	华泰紫金丰利中短债发起 C	华泰紫金丰利中短债发起 D
下属分级基金的交易代码	007821	007822	021058
最后运作日(2024 年 12 月 18 日)下属分级基金的份额总额	10,470,730.69 份	5,773,331.48 份	-

三、基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]363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 2019 年 8 月 29 日正式生效，生效日的基金份额总额为 1,042,896,035.71 份，其中认购利息折合 141,108.14 份。

自 2019 年 8 月 29 日至 2024 年 12 月 18 日期间，本基金按基金合同正常运作。

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，“……《基金合同》生效三年后持续存续的，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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

截至 2024 年 7 月 25 日，本基金已连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会上海监管局提交了终止基金合同的解决方案，并以通讯方式召开基金份额持有人大会，于 2024 年 12 月 17 日表决通过了《关于终止华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。根据 2024 年 12 月 18 日发布的《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于华泰紫金丰利中短债债券型发起式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》，本基金自 2024 年 12 月 19 日起进入基金财产清算程序。

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：华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年12月18日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2024年12月18日 (基金最后运作日)
资产：	
货币资金	17,918,428.62
结算备付金	159,198.53
存出保证金	2,253.71
应收申购款	10,011.00
资产总计	18,089,891.86
负债：	
应付赎回款	129,308.97
应付管理人报酬	2,966.52
应付托管费	988.84
应付销售服务费	1,342.22
应交税费	32.27
其他负债	40,598.32
负债合计	175,237.14
净资产：	
实收基金	16,244,062.17
未分配利润	1,670,592.55
净资产合计	17,914,654.72
负债和净资产总计	18,089,891.86

注：报告截止日2024年12月18日（基金最后运作日），基金总份额16,244,062.17

份，其中A类基金份额净值1.1111元，A类基金份额10,470,730.69份；C类基金份额净值

1.0878 元，C 类基金份额 5,773,331.48 份；D 类基金份额净值 1.1111 元，D 类基金份额 0 份。

五、清算事项说明

自 2024 年 12 月 19 日至 2024 年 12 月 23 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。本基金的清算费用由基金财产承担（符合中国证监会相关规定可由管理人承担的除外）。

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 17,918,428.62 元（含应计利息 966.55 元）；清算结束日货币资金余额为人民币 15,826,628.54 元（含应计利息 461.69 元）；

（2）本基金最后运作日和清算结束日结算备付金余额分别为人民币 159,198.53 元（含应计利息 898.84 元）、人民币 158,321.05 元（含应计利息 21.36 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下季度结息时收回；

（3）本基金最后运作日和清算结束日存出保证金余额分别为人民币 2,253.71 元（含应计利息 8.93 元）、人民币 2,245.08 元（含应计利息 0.30 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结算保证金应计利息预计于下季度结息时收回；

（4）本基金最后运作日应收申购款为人民币 10,011.00 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 129,308.97 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 2,966.52 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 988.84 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 1,342.22 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 32.27 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 40,598.32 元，包括应付银行手续费、银行间交易费、预提信息披露费。其中：

- 1) 应付银行手续费为人民币 304.09 元，该款项于 2025 年 1 月初由银行自动扣除；
- 2) 银行间交易费为人民币 1,715.00 元，该款项于 2025 年 1 月初支付；
- 3) 预提信息披露费为人民币 38,579.23 元，该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 12 月 19 日至 2024 年 12 月 23 日 (清算期间)
一、清算收入	833.95
利息收入	824.44
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	9.51
二、清算费用	298.60
其他费用	298.60
三、清算收益	535.35
减：所得税费用	-
四、清算净收益（净亏损以“-”号填列）	535.35

注：其他业务收入为赎回费收入（归基金资产）；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 12 月 18 日基金净资产	17,914,654.72

加：清算报告期间净收益（净亏损以“-”号填列）	535.35
加：申购金额	32,919.90
减：赎回金额（含费用）	1,963,149.39
二、清算结束日 2024 年 12 月 23 日基金净资产	15,984,960.58

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算期结束日2024年12月23日，本基金剩余财产为15,984,960.58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12月24日)至清算款项支付日前一日(2024年12月30日)的归属于基金份额持有人的银行存款、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登记机构的记录为准，该款项将于2024年12月31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应计利息、存出保证金本金及应计利息、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）《华泰紫金丰利中短债债券型发起式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〈华泰紫金丰利中短债债券型发起式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。

华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2024年12月25日