

# 华泰紫金智能量化股票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：中国银行股份有限公司

报告出具日：2023年9月19日

报告送出日：2023年9月28日

## 一、重要提示

华泰紫金智能量化股票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《关于准予华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1224号）准予募集注册，本基金于2018年2月1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”），基金托管人为中国银行股份有限公司（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》、《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，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，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，会议表决时间自2023年8月14日起至2023年9月8日17:00止，2023年9月12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《关于终止华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资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2023年9月13日刊登在《证券日报》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智能量化股票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》。

本基金的最后运作日为2023年9月13日，自2023年9月14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、基金托管人中国银行股份有限公司、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）对基金进行清算审计，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	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金	
基金简称	华泰紫金智能量化股票发起	
基金主代码	005502	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年2月1日	
清算起始日	2023年9月14日	
最后运作日基金份额总额	17,487,802.31份	
投资目标	本基金通过量化选股模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	<p>本基金是一只采取主动管理投资模式的股票基金。在投资策略上，管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，然后充分利用量化模型，先将原始行业数据进行深层次的加工、计算，建立各个行业的分析逻辑，再通过模型构造，建立起因子分析框架，然后挖掘数据形成因子，通过因子拟合趋势，进行回溯和验证，从而挖掘出不同行业的敏感因子，提取合成不同行业的观察指标，结合管理人线下的研究进行行业配置和个券选择，构建合理的投资组合。</p> <p>1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券类资产投资策略；4、中小企业私募债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、衍生品投资策略。</p>	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为股票型基金。基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金智能量化股票发起 A	华泰紫金智能量化股票发起 C

下属分级基金的交易 代码	005502	014629
-----------------	--------	--------

### 三、基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1224号）准予募集注册，《基金合同》于2018年2月1日生效，首次设立募集规模为343,068,498.19份基金份额（含利息结转份额）。自2018年2月1日至2023年9月13日期间，本基金按《基金合同》的约定正常运作。

根据基金管理人于2023年9月13日发布的《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于华泰紫金智能量化股票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》，本基金基金份额持有人大会于2023年9月12日表决通过了《关于终止华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效，本基金最后运作日为2023年9月13日，自2023年9月14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：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年9月13日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	本期末 2023年9月13日 (基金最后运作日)
<b>资 产:</b>	
货币资金	1,426,976.53
结算备付金	2,713.64
存出保证金	1,367.56
衍生金融资产	
交易性金融资产	200,673.76
买入返售金融资产	
发放贷款和垫款	
债权投资	

其他债权投资	
其他权益工具投资	
长期股权投资	
应收清算款	17,688,306.18
应收利息	
应收股利	
应收申购款	
其他资产	
资产总计	19,320,037.67
<b>负 债:</b>	
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	61,492.82
应付管理人报酬	27,405.76
应付托管费	1,739.47
应付销售服务费	2.09
应付投资顾问费	
应交税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	86,309.27
负债合计	176,949.41
<b>净资产:</b>	
实收资金	17,487,802.31
其他综合收益	
未分配利润	1,655,285.95

净资产合计	19,143,088.26
负债和净资产总计	19,320,037.67

注：本基金最后运作日 2023 年 9 月 13 日，华泰紫金智能量化股票发起 A 份额净值人民币 1.0946 元，华泰紫金智能量化股票发起 C 份额净值人民币 1.1370 元，基金份额总额 17,487,802.31 份，其中华泰紫金智能量化股票发起 A 份额 17,462,108.73 份，华泰紫金智能量化股票发起 C 份额 25,693.58 份。

### 五、清算事项说明

自 2023 年 9 月 14 日至 2023 年 9 月 18 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剩余财产中支付。

#### 2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日托管户货币资金为人民币 1,426,976.53 元（含应计利息 1,026.78 元），清算期间净流入 17,664,493.31 元（包含清算期间计提的应计利息 929.23 元），利息部分将于本季度结息日划至托管户。

(2) 本基金最后运作日上交所结算备付金本金为 0 元，应计利息为 4.26 元，该利息将于本季度结息日划至托管户；

(3) 本基金最后运作日深交所结算备付金本金为 0 元，应计利息为 4.65 元，该利息将于本季度结息日划至托管户；

(4) 本基金最后运作日期货备付金本金为 2,696.23 元，应计利息为 8.50 元，合计数 2,704.73 元将于本季度结息日划至托管户；

(5) 本基金最后运作日上交所存出保证金本金为 888.42 元，应计利息为 7.37 元，利息部分将于本季度结息日划至托管户，本金部分由留存的管理费垫付；

(6) 本基金最后运作日深交所存出保证金本金为 468.90 元，应计利息为 2.87 元，利息部分将于本季度结息日划至托管户，本金部分由留存的管理费垫付；

(7) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币 200,673.76 元，全部为股票投资。该股票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 200,517.77 元，已于清算期间划至托管户；

(8) 本基金最后运作日应收清算款为 17,688,306.18 元，已于清算期间划至托管户。

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 1,739.47 元，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 2.09 元，已于清算期间支付；

(3) 本基金最后运作日应付审计费为人民币 15,000.00 元，已于清算期间支付；

(4) 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；

(5) 本基金最后运作日应付公证费为人民币 10,000.00 元，已于清算期间支付；

(6) 本基金最后运作日应付交易佣金为 11,309.27 元，已于清算期间支付；

(7) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 61,492.82 元，已于清算期间支付；

(8) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 27,405.76 元，该款项留存在托管户垫付冻结资产（包括未到账的利息、存出保证金），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
	2023 年 9 月 14 日至 2023 年 9 月 18 日
一、清算收入	-23,269.34
1、利息收入	930.03
2、投资收益（损失以“-”填列）	-57,075.42
3、公允价值变动收益（损失以“-”填列）	32,874.65
4、其他业务收入（损失以“-”填列）	1.40
二、清算支出	80.00
1、税金及附加	
2、其他费用	80.00
三、清算净收益（净亏损以“-”列）	-23,349.34

注：其他业务收入为赎回费归基金资产部分收入，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 2023 年 9 月 13 日基金净资产	19,143,088.26

加：清算报告期间净收益	-23,349.34
减：赎回金额（含费用）	51,592.84
二、2023年9月18日基金净资产	19,068,146.08

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算结束日2023年9月18日，本基金剩余财产为人民币19,068,146.08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（2023年9月19日）至清算款项支付日前一日（2023年9月27日）的银行存款产生的利息归基金份额持有人所有，故本基金最终剩余清算总资产为人民币19,069,817.87元，该款项将于2023年9月28日由基金托管户划出。

清算过程中，冻结资产（包括未到账的利息和存出保证金）由基金管理人留存管理费进行垫付，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，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）《华泰紫金智能量化股票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〈华泰紫金智能量化股票型发起式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、基金托管人住所。

#### 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。

华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2023年9月28日