

华泰柏瑞基金管理有限公司
华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证
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：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2025 年 3 月 14 日

清算报告公告日：2025 年 3 月 19 日

华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金

清算报告

一、重要提示

华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2021 年 11 月 4 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]3499 号）的注册，进行募集。《华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债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 2022 年 5 月 24 日正式生效。基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。”截至 2025 年 1 月 21 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 1 月 22 日刊登了《华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债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》。本基金最后一个运作日为 2025 年 2 月 12 日，自 2025 年 2 月 13 日起，本基金进入基金资产清算程序，停止办理申购、赎回、转换及定期定额投资业务且不再恢复。自 2025 年 2 月 13 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、基金托管人交通银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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	华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债 A	华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债 C
基金主代码	014252	
下属分级基金的代码	014252	014253
基金运作方式	契约型开放式（基金管理人在开放日办理基金份额的申购，但对于每份基金份额，基金管理人仅在该基金份额的每个运作期到期日为基金份额持有人办理赎回）	
基金合同生效日	2022 年 5 月 24 日	
最后运作日 (2025 年 2 月 12 日) 基金份额总额	9,987,193.68 份	
投资目标	本基金在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求基金资产的稳健增值。	
投资策略	1、类属资产配置策略 本基金以宏观经济趋势以及货币政策研究导向，重点关注 GDP 增速、通货膨胀水平、利率变化趋势以及货币供应量等宏观经济指标，研判宏观经济运行所处的经济周期及其演进趋势；同时，积极关注财政政策、货币政策、汇率政策、产业政策和证券市场政策等的变化，分析其不同类别资产的市场影响方向与程度，进而比较各大类资产的风险收益特性，综合考虑各证券市场的资金供求状况、流动性水平以及走势的相关性，在基金合同约定比例的范围内，动态调整基金大类资产的配置比例，从而优化资产组合的风险收益水平。	

	2、债券投资策略 本基金主要投资于短期债券，将在对宏观经济走势、利率变化趋势、收益率曲线形态变化和发债主体基本面分析的基础上，综合运用久期管理策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、信用债券投资策略等主动投资策略，选择合适的时机和品种构建债券组合。 3、杠杆投资策略 杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%。 4、资产支持证券投资策略 本基金将深入研究资产支持证券的发行条款、市场利率、支持资产的构成及质量、支持资产的现金流变动情况以及提前偿还率水平等因素，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，通过信用分析和流动性管理，辅以量化模型分析，精选那些经风险调整后收益率较高的品种进行投资，力求获得长期稳定的投资收益。 5、国债期货投资策略 本基金根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，投资国债期货。 6、信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理的原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。
业绩比较基准	中债综合财富(1 年以下)指数收益率*90%+一年期定期

	存款基准利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

三、基金运作情况

华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2021 年 11 月 4 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2021]3499 号）的注册，进行募集。《华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债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 2022 年 5 月 24 日正式生效。基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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，本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止，而无需召开基金份额持有人大会。”截至 2025 年 1 月 21 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 1 月 22 日刊登了《华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债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》。本基金最后一个运作日为 2025 年 2 月 12 日，自 2025 年 2 月 13 日起，本基金进入基金资产清算程序，停止办理申购、赎回、转换及定期定额投资业务且不再恢复。自 2025 年 2 月 13 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、基金托管人交通银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（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：华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 2 月 12 日

单位：人民币元

资产	本期末 2025 年 2 月 12 日 (基金最后运作日)
资产：	
货币资金	591,773.01
结算备付金	-
存出保证金	0.35
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
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	10,207,919.18
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	37,200.00
资产总计	10,836,892.54

负债和净资产	本期末 2025 年 2 月 12 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	154,167.17
应付管理人报酬	1,684.88
应付托管费	421.22
应付销售服务费	1,139.65
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	22,770.85
负债合计	180,183.77
净资产：	-
实收基金	9,987,193.68
其他综合收益	-
未分配利润	669,515.09
净资产合计	10,656,708.77
负债和净资产总计	10,836,892.54

注：报告截止日 2025 年 2 月 12 日，基金份额总额 9,987,193.68 份，其中华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债 A 类基金份额净值 1.0697 元，基金份额 5,474,215.69 份；华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债 C 类基金份额净值 1.0638 元，基金份额 4,512,977.99 份。

财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师施翊洲、张晓阳签字出具了安永华明（2025）专字第 70025451_B04 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

自 2025 年 2 月 13 日至 2025 年 3 月 11 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 本基金最后运作日银行存款为人民币 591,773.01 元，其中托管户存款为人民币 591,142.74 元，应计银行存款利息为人民币 630.27 元。由于银行尚未结息，清算款划出日前一日的应计银行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 本基金最后运作日存出保证金为人民币 0.35 元，全部存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司。由于银行尚未结息，该部分利息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 本基金最后运作日证券清算款为人民币 10,207,919.18 元，截至 2025 年 2 月 13 日已全部划入基金托管户。

1.4 本基金最后运作日其他资产为人民币 37,200.00 元，为公司垫付银行间固定费用款项，上述款项已于 2025 年 3 月 7 日划入基金托管户。

2、负债清偿情况

2.1 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,684.88 元，已于 2025 年 2 月 14 日支付。

2.2 本基金最后运作日应付托管费为人民币 421.22 元，已于 2025 年 2 月 14 日支付。

2.3 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,139.65 元，已于 2025 年 2 月 14 日支付。

2.4 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 154,167.17 元，已于 2025 年 2 月 13 日支付。

2.5 本基金最后运作日其他负债为人民币 22,770.85 元。其中应付中央国债登记结算有限责任公司债券结算服务费和回购结算服务费分别为人民币 600.00

元和人民币 2,280.00 元，该款项已于 2025 年 2 月 17 日支付；应付回购交易手续费为人民币 23.55 元，该款项已于 2025 年 2 月 14 日支付；应付债券交易手续费为人民币 100.00 元，该款项已于 2025 年 2 月 14 日支付；预提律师费为人民币 10,000.00 元，已于 2025 年 2 月 19 日支付；预提审计费为人民币 1,767.30 元，截至 2025 年 3 月 11 日尚未支付；预提银行间账户维护费为人民币 7,000.00 元，截至 2025 年 3 月 11 日，该款项已支付 6,200.00 元，剩余 800.00 元已冲回；预提划款手续费为人民币 1,000.00 元，截至 2025 年 3 月 11 日，该款项已支付 65.00 元，剩余 935.00 元未支付。

3、清算费用

按照《华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券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 2 月 13 日至 2025 年 3 月 11 日
一、营业总收入	5,715.80
1.利息收入	5,715.80
其中：存款利息收入	5,715.80
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）	-
其中：股票投资收益	-
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	-
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）	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、营业总支出	-800.00
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	-800.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	6,515.80
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,515.80
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	6,515.80

注：1、利息收入系自 2025 年 2 月 13 日至 2025 年 3 月 11 日止清算期间计提的银行存款利息收入。

2、其他费用系 2025 年 3 月 7 日冲回的预提银行间账户维护费 800.00 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 2 月 12 日基金净资产	10,656,708.77
加：清算期间净收益	6,515.80
减：确认赎回对净值的影响	50,213.93
二、2025 年 3 月 11 日基金资产净值	10,613,010.64

截至本次清算期结束日2025年3月11日，本基金剩余财产为10,613,010.64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2月13日至清算款划出日前一日的银行存款、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) 华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金清算审计报告
- (2) 《华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券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。

华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金
基金财产清算小组

清算报告出具日：2025 年 3 月 14 日