

华泰紫金沪深 300 指数增强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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告出具日：2025年12月1日

报告送出日：2025年12月5日

一、重要提示

华泰紫金沪深300指数增强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《关于准予华泰紫金沪深300指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2022]1511号)批准募集,《华泰紫金沪深300指数增强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2022年11月17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”),基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(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”的约定:

“基金合同生效之日起三年后的对应日,若基金资产净值低于2亿元,基金合同自动终止,且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的,从其规定。”

本基金基金合同生效日为2022年11月17日,基金合同生效之日起三年后的对应日为2025年11月17日。截至2025年11月17日日终,本基金资产净值低于2亿元,已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2025年11月17日,自2025年11月18日起进入清算程序,由本基金管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司、基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司、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	华泰紫金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金
基金简称	华泰紫金沪深 300 指数增强发起
基金主代码	016867
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 17 日
清算起始日	2025 年 11 月 18 日
最后运作日(2025 年 11 月 17 日)基金份额总额	10,774,513.81 份
投资目标	本基金通过量化投资方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8% 的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	<p>1、股票投资策略本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，指数化投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出调整，力争控制本基金与业绩比较基准之间的跟踪偏离度。</p> <p>2、存托凭证投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>4、可转债和可交债投资策略</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>6、衍生品投资策略</p> <p>7、融资、转融通证券出借业务投资策略</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率（税后） \times 5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数增强基金，跟踪沪深 300 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	华泰紫金沪深 300 指数增强发起 A	华泰紫金沪深 300 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	016867	016868
最后运作日(2025年 11 月 17 日)下属分级基金的份额总额	10,427,956.98 份	346,556.83 份

三、基金运作情况

本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予华泰紫金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2022]1511 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 2022 年 11 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,126,263.19 份，其中认购利息折合 368.78 份。

自 2022 年 11 月 17 日至 2025 年 11 月 17 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”的约定：“基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。”

根据《基金合同》以及基金管理人于 2025 年 11 月 18 日发布的《华泰紫金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金基金合同生效日为 2022 年 11 月 17 日，基金合同生效之日起三年后的对应日为 2025 年 11 月 17 日。截至 2025 年 11 月 17 日日终，本基金资产净值低于 2 亿元，已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 2025 年 11 月 17 日，自 2025 年 11 月 18 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：华泰紫金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 11 月 17 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	本期末 2025年11月17日 (基金最后运作日)
资产:	
货币资金	654,907.77
结算备付金	97,311.16
存出保证金	8,405.79
交易性股票投资	61,535.00
交易性债券投资	100,824.49
应收证券清算款	12,626,323.22
资产总计	13,549,307.43
负债和所有者权益	
负债:	
应付赎回款	23,764.96
应付管理人报酬	5,490.90
应付托管费	1,029.54
应付销售服务费	111.85
其他负债	28,992.95
负债合计	59,390.20
所有者权益:	
实收基金	10,774,513.81
未分配利润	2,715,403.42
净资产合计	13,489,917.23
负债和净资产总计	13,549,307.43

注: 报告截止日 2025年11月17日(基金最后运作日), 基金总份额 10,774,513.81份, 其中 A类基金份额 10,427,956.98份, A类基金份额净值 1.2525元; C类基金份额 346,556.83份, C类基金份额净值 1.2377元。

五、清算事项说明

自 2025年11月18日至 2025年11月21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、本基金最后运作日和清算结束日货币资金余额分别为人民币 654,907.77 元(含应计利息 730.99 元)和人民币 13,290,129.54 元(含应计利息 1,795.19 元)；
- 2、本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 97,311.16 元(含应计利息 70.46 元)：其中人民币 87,421.38 元(含应计利息 54.80 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；其中人民币 9,889.78 元(含应计利息 15.66 元)为存放于期货公司的清算备付金本金及应计利息，该款项已于清算期间全额划至托管户；清算结束日结算备付金余额为人民币 87,424.78 元(含应计利息 58.20 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 8,405.79 元(含应计利息 4.64 元)、人民币 8,406.11 元(含应计利息 4.96 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下季度结息时收回；
- 4、本基金最后运作日交易性股票投资为人民币 61,535.00 元，截至 2025 年 11 月 19 日已全部变现；
- 5、本基金最后运作日交易性债券投资为人民币 100,824.49 元，截至 2025 年 11 月 18 日已全部变现；
- 6、本基金最后运作日应收证券清算款余额为人民币 12,626,323.22 元，该款项已于清算期间全额划至托管户。

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 23,764.96 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 5,490.90 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1,029.54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111.85元，该款项已于清算期间支付；
 5、本基金最后运作日其他负债为28,992.95元，包括应付交易费、预提清算律师费、预提清算审计费。其中：

- 1) 应付交易费为人民币8,992.95元，为应付佣金，该款项已于清算期间支付；
 2) 预提清算审计费为人民币10,000.00元，该款项已于清算期间支付；
 3) 预提清算律师费为人民币10,000.00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	2025年11月18日至2025年11月21日 (清算期间)
一、清算收入	-6,868.82
利息收入	1,068.22
投资收益（损失以“-”填列）	-278.63
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-7,658.41
其他业务收入	-
二、清算支出	-
税金及附加	-
其他费用	-
三、清算收益	-6,868.82
减：所得税费用	-
四、清算净收益（净亏损以“-”号填列）	-6,868.82

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2025年11月17日基金净资产	13,489,917.23
加：清算报告期间净收益	-6,868.82
减：2025年11月18日赎回转出确认金额	97,087.98
二、清算结束日2025年11月21日基金净资产	13,385,960.43

资产处置及负债清偿后，截止本基金清算期结束日（2025年11月21日），本基金剩余财产为13,385,960.43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（2025年11月22日）至清算款项支付日前一日（2025年12月4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，清算款项将于2025年12月5日由基金托管户划出。

为加快清盘速度，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、《华泰紫金沪深300指数增强型发起式证券投资基金的清算审计报告》；
- 2、《上海市通力律师事务所关于<华泰紫金沪深300指数增强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。

华泰紫金沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2025年12月1日

