

# 华泰保兴科睿一年持有期混合型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：恒丰银行股份有限公司

报告出具日期：2026年6月10日

报告公告日期：2026年6月16日

## § 1 重要提示

华泰保兴科睿一年持有期混合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(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2023〕443号《关于准予华泰保兴科睿一年持有期混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由华泰保兴基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴科睿一年持有期混合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”)负责公开募集。经向中国证监会备案,《基金合同》于2023年5月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为112,153,021.37份基金份额,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司,基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

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》和《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”约定:

《基金合同》生效之日起满三年后的对应日(年度对日指某一特定日期在后续日历年中的对应日期,若该对应日期不存在或为非工作日,则顺延至下一工作日),若基金资产净值低于2亿元,本《基金合同》自动终止并按其约定程序进行清算,无需召开基金份额持有人大会审议,且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续本《基金合同》期限。如届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化,上述终止规定被取消、更改或补充的,则本基金按照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

本基金《基金合同》自2023年5月23日起生效,《基金合同》生效之日起满三年后的对应日为2026年5月25日。截至2026年5月25日日终,本基金的基金资产净值低于2亿元,已触发《基金合同》终止的上述情形。根据《基金合同》的约定,基金管理人依据基金财产清算程序对本基金进行财产清算并终止《基金合同》,无需召开基金份额持有人大会进行表决。

本基金的最后运作日为2026年5月25日,并于2026年5月26日进入清算程序。本基金的基金管理人、基金托管人、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所于2026年5月26日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,上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

## § 2 基金概况

基金名称	华泰保兴科睿一年持有期混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华泰保兴科睿一年持有混合发起	
基金主代码	018250	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年5月23日	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴科睿一年持有混合发起A	华泰保兴科睿一年持有混合发起C
下属分级基金的交易代码	018250	018251
最后运作日(2026年5月25日)	11,105,269.95份	1,465,428.71份
下属分级基金的份额总额		
投资目标	本基金在控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现组合资产长期稳健的增值。	
投资策略	本基金根据资本市场实际情况,力争通过大类资产配置、在基金合同约定的投资比例范围内动态调整权益资产仓位来降低组合波动性。同时,以专业的研究分析为根本,挖掘市场中有潜力的投资标的和被低估的投资品种,获得基金的长期稳定增值。本基金主要投资策略包括:大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略。	
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率*85%+沪深300指数收益率*15%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。	

### § 3 基金运作情况说明

本基金经中国证监会证监许可(2023)443号《关于准予华泰保兴科睿一年持有期混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由华泰保兴基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案,《基金合同》于2023年5月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为112,153,021.37份基金份额,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司,基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

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》和《基金合同》“第五部分 基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”约定:

《基金合同》生效之日起满三年后的对应日(年度对日指某一特定日期在后续日历年中

的对应日期，若该对应日期不存在或为非工作日，则顺延至下一工作日），若基金资产净值低于2亿元，本《基金合同》自动终止并按其约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续本《基金合同》期限。如届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充的，则本基金按照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。

本基金《基金合同》自2023年5月23日起生效，《基金合同》生效之日起满三年后的对应日为2026年5月25日。截至2026年5月25日日终，本基金的基金资产净值低于2亿元，已触发《基金合同》终止的上述情形。根据《基金合同》的约定，基金管理人依据基金财产清算程序对本基金进行财产清算并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会进行表决。

本基金的最后运作日为2026年5月25日，并于2026年5月26日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

自基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

## § 4 财务报告

基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：华泰保兴科睿一年持有期混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026年5月25日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2026年5月25日
<b>资产：</b>	
货币资金	10,508,625.28
结算备付金	54,551.78
存出保证金	15,623.65
交易性金融资产	1,288,778.00
其中：股票投资	1,288,778.00
资产总计	11,867,578.71
负债和净资产	最后运作日 2026年5月25日
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	4,994.86
应付托管费	832.48
应付销售服务费	289.04
应交税费	5.19
其他负债	20,691.28
负债合计	26,812.85

<b>净资产：</b>	
实收基金	12, 570, 698. 66
未分配利润	-729, 932. 80
净资产合计	11, 840, 765. 86
负债和净资产总计	11, 867, 578. 71

注：1、报告截止日2026年5月25日（最后运作日），华泰保兴科睿一年持有混合发起A基金份额净值0.9429元，基金份额总额11,105,269.95份；华泰保兴科睿一年持有混合发起C基金份额净值0.9343元，基金份额总额1,465,428.71份。华泰保兴科睿一年持有混合发起份额总额合计为12,570,698.66份。

2、本基金的清算报表以非持续经营为编制基础，遵循《企业会计准则》《证券投资基金会计核算业务指引》等有关规定。

## § 5 清算事项说明

自2026年5月26日至2026年5月27日止为本基金清算报告期，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清算过程中发生的所有合理费用，按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 5.2 资产处置情况

1、本基金最后运作日货币资金为10,508,625.28元，为存放于托管账户的活期存款10,505,972.09元，应计银行存款利息2,653.19元。上述银行存款利息将于2026年6月21日后划入托管账户。

2、本基金最后运作日结算备付金为54,551.78元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金38,512.22元，应计结算备付金利息23.17元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金16,007.05元，应计结算备付金利息9.34元。上述结算备付金利息将于2026年6月22日后划入托管账户。

3、本基金最后运作日存出保证金为15,623.65元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金10,196.83元，应计存出保证金利息6.01元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金5,418.57元，应计存出保证金利息2.24元。上述存出保证金利息将于2026年6月22日后划入托管账户。

4、本基金最后运作日交易性金融资产为1,288,778.00元，已于清算期内变现。

### 5.3 负债清偿情况

- 1、本基金清算期内发生应付赎回款为9,401.01元，该款项已于2026年5月28日支付。
- 2、本基金最后运作日应付管理人报酬为4,994.86元，该款项已于2026年5月27日支付。
- 3、本基金最后运作日应付托管费为832.48元，该款项已于2026年5月27日支付。
- 4、本基金最后运作日应付销售服务费289.04元，该款项已于2026年5月27日支付。
- 5、本基金最后运作日应交税费为5.19元，该款项已于2026年5月27日支付。
- 6、本基金最后运作日其他负债为20,691.28元，其中应付佣金8,803.28元，清算期内发生交易佣金572.27元，实际应付佣金9,375.55元，该款项已于2026年5月27日支付；本基金最后运作日审计费为5,959.50元，清算期内调增4,040.50元，实际应付审计费为10,000.00元，将于收到付款通知书和发票后支付。银行间交易手续费和账户维护费为5,928.50元，清算期内调增579.00元，实际应付银行间交易手续费和账户维护费为6,507.50元，该款项已于2026年5月26日支付。清算期内计提律师费10,000.00元，将于律所出具法律意见书且收到发票后支付。

### 5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	清算期间 2026年5月26日至2026年5月27日
<b>一、清算收益</b>	-34,328.41
1. 利息收入（注1）	446.12
2. 投资收益（损失以“-”填列）（注2）	50,323.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）（注3）	-85,098.06
<b>二、清算费用</b>	14,619.50
1. 审计费	4,040.50
2. 律师费	10,000.00
3. 银行间账户维护费	579.00
<b>三、清算净收益</b>	-48,947.91

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的清算期间银行存款、结算备付金、存出保证金的利息。

注2：投资收益为清算期间的股票投资收益和交易所市场交易费用。

注3：公允价值变动损益为最后运作日未变现股票在清算期间产生的公允价值变动，以及清算期间处置持有股票投资时，将原计入该股票投资的公允价值变动转出至投资收益的金

额。

## 5.5 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2026年5月25日基金净资产	11,840,765.86
加：清算期间净收益	-48,947.91
减：基金净赎回转出金额	9,401.01
二、清算结束日2026年5月27日基金净资产	11,782,416.94

根据《基金合同》中关于基金财产清算的相关约定，基金财产清算小组将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。

本基金清算起始日2026年5月26日至本基金财产分配划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有。如前述利息、结算备付金和存出保证金在本基金财产分配划出日前尚未结清，则未结息部分（该金额可能与实际结息金额存在略微差异）和未返还的结算备付金和存出保证金将由基金管理人以自有资金垫付至托管账户。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，基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于利息结清后返还给基金管理人，基金财产清偿完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

## 5.6 基金资产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时分配。

# § 6 备查文件目录

## 6.1 备查文件目录

- 1、《华泰保兴科睿一年持有期混合型发起式证券投资基金清算审计报告》
- 2、《上海源泰律师事务所关于华泰保兴科睿一年持有期混合型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见》

## 6.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

## 6.3 查阅方式

- 1、营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅
- 2、登录基金管理人网站[www.ehuataifund.com](http://www.ehuataifund.com)查阅
- 3、拨打基金管理人客服热线电话400-632-9090（免长途话费）查询

华泰保兴科睿一年持有期混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2026年6月10日