

华泰保兴尊享三个月定期开放债券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：中国工商银行股份有限公司

报告出具日期：2026年9月11日

报告公告日期：2026年9月17日

§ 1 重要提示

华泰保兴尊享三个月定期开放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(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2019〕183号《关于准予华泰保兴尊享三个月定期开放债券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《华泰保兴尊享三个月定期开放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”)负责公开募集。经向中国证监会备案,《基金合同》于2019年9月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,034,000.18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。本基金为契约型定期开放基金,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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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:

“本基金自基金合同生效之日起满三年后,在任一开放期的最后一个开放日日终(登记机构完成最后一个开放日申购、赎回业务申请的确认以后),如基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当终止《基金合同》,并按照《基金合同》约定程序进行清算,无需召开基金份额持有人大会进行表决。”

根据基金管理人于2026年8月15日发布的《华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告》,本基金第二十三个开放期为2026年8月17日至2026年8月21日。截至本次开放期最后一个开放日日终(登记机构完成最后一个开放日申购、赎回业务申请的确认以后),本基金基金资产净值低于5000万元,已触发《基金合同》终止情形。根据《基金合同》有关约定,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。

本基金最后运作日为2026年8月24日,自2026年8月25日起,本基金进入清算程序。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8月25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	华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	华泰保兴尊享定开
基金主代码	007767
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2019年9月2日
最后运作日(2026年8月24日) 基金份额总额	39,835,842.84份
投资目标	在严格控制风险和保持资金流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。 (一) 封闭期投资策略 本基金通过对宏观经济运行状态、国家财政政策和货币政策、国家产业政策及资本市场资金环境的深入分析,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定基金资产在各类资产之间的配置比例。本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下,灵活运用久期策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用债策略、个券挖掘策略及杠杆策略等多种投资策略,实施积极主动的组合管理,并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测,对债券组合进行动态调整。 (二) 开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,重点考虑债券的安全性和流动性,确保组合债券有较高的变现能力,并严格控制基金组合的杠杆比例。 同时,基金管理人将密切关注基金的申购赎回情况,对投资组合的现金比例进行结构化管理。通过回购的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,有效分配基金的现金流,保持本基金在开放期的充分流动性。
业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率*60%+中证可转换债券指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金、高于货币市场基金。

§ 3 基金运作情况说明

本基金经中国证监会证监许可〔2019〕183号《关于准予华泰保兴尊享三个月定期开放债券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2019年9月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,034,000.18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。本基金为契约型定期开放基金，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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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：

“本基金自基金合同生效之日起满三年后，在任一开放期的最后一个开放日日终（登记机构完成最后一个开放日申购、赎回业务申请的确认以后），如基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当终止《基金合同》，并按照《基金合同》约定程序进行清算，无需召开基金份额持有人大会进行表决。”

根据基金管理人于2026年8月15日发布的《华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告》，本基金第二十三个开放期为2026年8月17日至2026年8月21日。截至本次开放期最后一个开放日日终（登记机构完成最后一个开放日申购、赎回业务申请的确认以后），本基金基金资产净值低于5000万元，已触发《基金合同》终止情形。根据《基金合同》有关约定，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。

本基金最后运作日为2026年8月24日。基金财产清算小组自2026年8月25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：华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026年8月24日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2026年8月24日
资产：	
货币资金	359,581.18
结算备付金	926,049.79

存出保证金	20,805.16
交易性金融资产	40,053,440.34
其中：债券投资	40,053,440.34
应收清算款	27,387,966.74
资产总计	68,747,843.21
负债和净资产	最后运作日 2026年8月24日
负债：	
应付赎回款	22,926,000.00
应付管理人报酬	18,709.12
应付托管费	3,118.19
应交税费	1,274.29
其他负债	115,478.76
负债合计	23,064,580.36
净资产：	
实收基金	39,835,842.84
未分配利润	5,847,420.01
净资产合计	45,683,262.85
负债和净资产总计	68,747,843.21

注：1、报告截止日2026年8月24日（最后运作日），基金份额净值1.1468元，基金份额总额39,835,842.84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8月25日至2026年8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359,581.18元，为存放于托管账户的活期存款358,790.16元，应计银行存款利息791.02元。上述银行存款利息将于2026年9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926,049.79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873,024.43元,应计结算备付金利息488.67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52,399.62元,应计结算备付金利息137.07元。上述结算备付金利息将于2026年9月21日后划入托管账户。

3、本基金最后运作日存出保证金为20,805.16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17,938.75元,应计存出保证金利息11.38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2,853.19元,应计存出保证金利息1.84元。上述存出保证金利息将于2026年9月21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40,053,440.34元,已于清算期内全部变现。

5、本基金最后运作日应收清算款为27,387,966.74元,已于2026年8月25日划入托管账户。

5.3 负债清偿情况

1、本基金最后运作日应付赎回款为22,926,000.00元,已于2026年8月26日支付。

2、本基金最后运作日应付管理人报酬为18,709.12元,已于2026年8月31日支付。

3、本基金最后运作日应付托管费为3,118.19元,已于2026年8月31日支付。

4、本基金最后运作日应交税费为1,274.29元,清算期内计提17.42元,已于2026年8月31日支付。

5、本基金最后运作日其他负债为115,478.76元,其中应付审计费为32,329.64元,清算期内调减22,329.64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;应付银行间交易手续费和账户维护费为5,559.40元,清算期内调增640.60元,实际应付银行间交易手续费和账户维护费为6,200.00元,已于2026年8月31日支付;应付信息披露费为77,589.72元,将于收到发票后支付。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8月25日至2026年8月27日
一、清算收益	115,965.93
1. 利息收入(注1)	1,141.81
2. 投资收益(损失以“-”填列)(注2)	-512,470.08
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)(注3)	627,294.20
二、清算费用	-11,487.17
1. 税金及附加	1.87

2. 审计费	-22,329.64
3. 律师费	10,000.00
4. 银行间账户维护费	640.60
5. 银行汇划费	200.00
三、清算净收益	127,453.10

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债券投资收益。

注3：公允价值变动损益为最后运作日未变现债券在清算期间产生的公允价值变动，以及清算期间处置持有债券投资时，将原计入该债券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8月24日基金净资产	45,683,262.85
加：清算期间净收益	127,453.10
减：基金净赎回转出金额	0.00
二、清算结束日2026年8月27日基金净资产	45,810,715.95

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、缴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8月25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、《华泰保兴尊享三个月定期开放债券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尊享三个月定期开放债券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

华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2026年9月11日