

# 华泰保兴吉年利定期开放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：中国银行股份有限公司

报告出具日期：2026年3月25日

报告公告日期：2026年3月31日

## § 1 重要提示

华泰保兴吉年利定期开放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(2018)1718号《关于准予华泰保兴尊悦债券型证券投资基金变更注册的批复》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《华泰保兴吉年利定期开放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2018年12月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,008,450.04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《华泰保兴吉年利定期开放混合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》,本基金第二十二个开放期为2026年2月6日至2026年3月13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。

本基金的最后运作日为2026年3月13日,并于2026年3月14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3月14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	华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	华泰保兴吉年利
基金主代码	006642
基金运作方式	契约型定期开放式

基金合同生效日	2018年12月25日
最后运作日(2026年3月13日) 基金份额总额	5,147,070.37份
投资目标	通过对股票、固定收益证券和现金等大类资产适度配置，灵活运用多种投资策略，把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资策略包括： （一）封闭期投资策略 本基金遵循经济周期性波动规律，通过定性与定量分析，动态把握不同资产类别在不同时期的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，追求股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置。在严格控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 （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，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*70%+中债总指数（全价）收益率*30%
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〔2018〕1718号《关于准予华泰保兴尊悦债券型证券投资基金变更注册的批复》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2018年12月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为210,008,450.04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《华泰保兴吉年利定期开放混合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》，本基金第二十二个开放期为2026年2月6日至2026年3月13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3月13日。基金管理人将自2026年3月14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：华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026年3月13日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2026年3月13日
<b>资产：</b>	
货币资金	6,032,167.15
结算备付金	922.10
存出保证金	307,675.52
交易性金融资产	712,987.72
其中：股票投资	712,987.72
资产总计	7,053,752.49
负债和净资产	最后运作日 2026年3月13日
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	1,572.71
应付托管费	224.66
其他负债	1,176,529.86
负债合计	1,178,327.23
<b>净资产：</b>	
实收基金	5,147,070.37
未分配利润	728,354.89
净资产合计	5,875,425.26
负债和净资产总计	7,053,752.49

注：

- 1、报告截止日2026年3月13日（最后运作日），基金份额净值1.1415元，基金份额总额5,147,070.37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3月14日至2026年3月17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6,032,167.15元，为存放于托管账户的活期存款5,983,046.58元，应计银行存款利息49,120.57元。上述银行存款利息已于2026年3月21日划入托管账户。

2、本基金最后运作日结算备付金为922.10元，其中应计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利息507.22元；应计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利息414.88元。上述结算备付金利息已于2026年3月23日划入托管账户。

3、本基金最后运作日存出保证金为307,675.52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112,763.37元，应计存出保证金利息32.26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194,754.70元，应计存出保证金利息125.19元。上述存出保证金利息已于2026年3月23日划入托管账户。

4、本基金最后运作日交易性金融资产为712,987.72元，为处于限售期的股票投资，上述资产将于解除限售后及时进行变现。

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	最后运作日账面价值（元）
1	001233	海安集团	202	13,208.78
2	001280	中国铀业	1,199	100,548.14
3	001285	瑞立科密	78	4,095.00
4	001369	双欣材料	517	7,336.23
5	001386	马可波罗	835	18,344.95
6	001396	誉帆科技	69	2,772.42
7	301449	天溯计量	112	7,160.16
8	301563	云汉芯城	110	15,976.40
9	301584	建发致新	447	12,873.60
10	301638	南网数字	1,285	38,331.55
11	301656	联合动力	1,895	47,829.80

12	301667	纳百川	151	9,043.39
13	301668	昊创瑞通	165	9,043.65
14	301687	新广益	195	9,475.05
15	601026	道生天合	451	9,885.92
16	603092	德力佳	82	5,929.42
17	603175	超颖电子	169	13,072.15
18	603248	锡华科技	260	5,410.60
19	603334	丰倍生物	88	4,613.84
20	603352	至信股份	112	3,532.48
21	603376	大明电子	111	3,970.47
22	603418	友升股份	76	4,145.04
23	688727	恒坤新材	512	24,325.12
24	688783	西安奕材	4,588	103,138.24
25	688790	昂瑞微	213	22,130.70
26	688795	摩尔线程	253	132,437.91
27	688796	百奥赛图	313	22,332.55
28	688802	沐曦股份	176	62,024.16

注：流通受限股票最后运作日估值金额与实际变现金额可能存在差异，实际变现金额存在不确定性。待上述股票解除限售后，本基金管理人再向基金份额持有人分配。

### 5.3 负债清偿情况

- 1、本基金最后运作日应付管理人报酬为1,572.71元，已于2026年3月16日支付。
- 2、本基金最后运作日应付托管费为224.66元，已于2026年3月16日支付。
- 3、本基金最后运作日其他负债为1,176,529.86元，其中交易佣金为972,995.14元，已于2026年3月16日支付；审计费为59,863.28元，清算期内调减49,863.28元，实际应付审计费为10,000.00元，已于2026年3月16日支付；信息披露费为143,671.44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3月14日至2026年3月17日
<b>一、清算收益</b>	23,987.07
1. 利息收入（注1）	225.48
2. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）（注2）	23,761.59
<b>二、清算费用</b>	-39,743.28
1. 银行汇划费	120.00

2. 审计费	-49,863.28
3. 律师费	10,000.00
<b>三、清算净收益</b>	<b>63,730.35</b>

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、存出保证金的利息。

注2：公允价值变动损益系最后运作日未变现股票在清算期间产生的公允价值变动。

## 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3月13日基金净资产	5,875,425.26
加：清算期间净收益	63,730.35
减：基金净赎回转出金额	-
二、清算结束日2026年3月17日基金净资产	5,939,155.61

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。

由于本基金截至清算期结束日2026年3月17日所持限售股票尚未解禁，本基金将于未变现资产全部变现后，将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，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3月14日至本基金最后一次财产分配划出日前一日的银行存款、存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有。如前述利息和存出保证金在本基金最后一次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进行分配。

# § 6 备查文件目录

## 6.1 备查文件目录

- 1、《华泰保兴吉年利定期开放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吉年利定期开放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

华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2026年3月25日