

中信期货信安1号集合资产管理计划

清算报告

尊敬的委托人：

我公司发起设立的“中信期货信安1号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”），根据《中信期货信安1号集合资产管理计划资产管理合同》的约定，本资产管理计划于2023年12月15日开放日结束后不再满足继续存续的条件，故管理人决定于2023年12月18日提前终止本计划并进入清算程序。我公司成立清算小组对本计划进行了清算。现将有关情况报告如下：

一、基本情况

（一）委托人：本计划项下全部委托人

（二）管理人：中信期货有限公司

（三）托管人：中信银行股份有限公司

（四）本计划成立日：2020年01月21日

（五）本计划终止日：2023年12月18日

（六）本计划资金：成立时初始委托资金为17,180,244.51元，本计划存续期间确认申购14,510,903.71份，确认赎回30,788,505.95份，剩余902,642.27份。

二、清算情况

1. 清算开始日：2023年12月18日

2. 清算截止日：2023年12月19日

3. 截至清算开始日总资产：1,002,722.16元

4. 截至清算开始日总负债：1,189.22元

5. 截至清算开始日资产净值：1,001,532.94 元

6. 截至清算开始日单位净值：1.1096

7. 截至清算开始日累计单位净值：1.1096

三、本计划资产管理情况

(一) 现金资产：

截至 2023 年 12 月 18 日，本计划项下现金资产 1,002,663.27 元。其中托管户现金余额为 992,834.51 元，证券账户现金余额为 9,828.76 元(其中有 300.00 元为港股通账户冻结款)，期货账户现金余额为 0 元。

根据资产管理合同及相关文件的约定，截至终止日本计划承担的费用情况如下：

1、资产管理人的管理费：合计为人民币 138,641.12 元，已支付 137,560.1 元，尚未支付 1,081.02 元。

2、资产托管人的托管费：合计为人民币 13,864.05 元，已支付 13,755.96 元，尚未支付 108.09 元。

3、应缴增值税及附加：合计为人民币 0.11 元。

(二) 委托资产清算及剩余财产返还情况

根据资产管理合同约定，本计划终止后，委托资产清算及剩余财产返还情况如下：

本次清算可返还委托人的财产总额=现金类资产-尚未支付的管理费-尚未支付的托管费-应缴增值税及附加-港股通账户冻结款-预留汇划费= 1,002,663.27 元-1,081.02 元-108.09 元-0.11 元-300.00 元-50.00 元=1,001,124.05 元。

依据合同约定，管理人于本计划终止日计算管理人业绩报酬，业绩报酬（如有）将从投资者本次清算返款总额中扣除。



本计划港股通账户冻结款、剩余的预留汇划费及未到账的应收利息结息后归委托人，待销户时资产托管人根据资产管理人出具的划款指令划付，由资产管理人分配给委托人，金额以实际分配金额为准。

(三) 本项下已无未变现资产，不需要二次清算。

四、本资产管理计划兑付情况

资产管理人将在资产管理合同约定的时间内向资产托管人出具划款指令，将委托人的剩余财产以转账方式划入委托人指定的银行账户内，金额以实际划付金额为准。根据本资产管理合同约定，资产管理人将配合托管人完成证券账户、银行账户等销户工作。

管理人：

中信期货有限公司

2023年12月20日

托管人：

中信银行股份有限公司

2023年12月20日