东海消费臻选混合型发起式证券投资基金

清算报告

基金管理人： 东海基金管理有限责任公司

基金托管人： 南京银行股份有限公司

清算报告出具日：2026 年 11 月 10 日

清算报告公告日：2026 年 11 月 13 日

一、重要提示

东海消费臻选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据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]2075 号文《关于准予东海消费臻选混合型发起式证券投资基金注册的批复》，由东海基金管理有限责任公司依照《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《东海消费臻选混合型发起式证券投资基金基金合同》、《东海消费臻选混合型发起式证券投资基金招募说明书》等规定公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 10 月 17 日正式生效。本基金的基金管理人为东海基金管理有限责任公司，基金托管人为南京银行股份有限公司。

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”中的约定：“《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，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若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，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

本基金基金合同生效日为 2023 年 10 月 17 日，《基金合同》生效之日起三年后的对应日为 2026 年 10 月 17 日。截至 2026 年 10 月 17 日日终，本基金基金资产净值低于 2 亿元，触发上述基金合同终止的情形，基金合同自动终止，本基金将根据基金合同的约定进入基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人已就该事项于 2026 年 10 月 19 日刊登了《关于东海消费臻选混合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》。2026 年 10 月 17 日为本基金最后运作日，自 2026 年 10 月 18 日起，本基金进入清算程序。本基金进入清算程序后，不再办理申购、赎回、转换及定期定额投资等业务，并停止收取基金管理费、基金托管费及 C 类基金份额的销售服务费。

基金管理人东海基金管理有限责任公司、基金托管人南京银行股份有限公司、容诚会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2026 年 10 月 19 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由容诚会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

二、产品概况

基金名称	东海消费臻选混合型发起式证券投资基金
基金简称	东海消费臻选混合发起式

基金主代码	019551	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 10 月 17 日	
基金管理人	东海基金管理有限责任公司	
基金托管人	南京银行股份有限公司	
基金最后运作日（2026 年 10 月 17 日）基金份额总额	12,391,113.86 份	
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘潜在的消费主题相关投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	（一）资产配置策略；（二）消费主题的界定及投资策略；（三）股票投资策略，主要包括 1.相关子行业的配置策略 2.个股精选策略 3.存托凭证投资策略；（四）债券投资策略，主要包括 1.普通债券投资策略 2.可转换债券投资策略 3.可交换债券投资策略 4.息差策略；（五）资产支持证券投资策略；（六）金融衍生品投资策略，主要包括 1.股指期货交易策略 2.国债期货交易策略 3.股票期权投资策略。	
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率*70%+中债综合指数(全价)收益率*30%	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。	
下属分级基金的基金简称	东海消费臻选混合发起式 A	东海消费臻选混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	019551	019552
基金最后运作日（2026 年 10 月 17 日）下属分级基金的份额总额	10,057,838.88 份	2,333,274.98 份

三、基金运作情况

本基金经证监许可[2023]2075 号文《关于准予东海消费臻选混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由基金管理人依照法律法规、基金合同等规定于 2023 年 09 月 28 日至 2023 年 10 月 12 日期间向社会公开募集，基金合同于 2023 年 10 月 17 日正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 10,158,514.80 份（含募集期间有效认购份额利息结转的份额），募集有效认购总户数为 13 户。

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”中的约定：“《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，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止，且不得通过召开基

金份额持有人大会的方式延续。若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，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。”

本基金基金合同生效日为 2023 年 10 月 17 日，《基金合同》生效之日起三年后的对应日为 2026 年 10 月 17 日。截至 2026 年 10 月 17 日日终，本基金基金资产净值低于 2 亿元，触发上述基金合同终止的情形，基金合同自动终止，本基金将根据基金合同的约定进入基金财产清算程序，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人已就该事项于 2026 年 10 月 19 日刊登了《关于东海消费臻选混合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》。2026 年 10 月 17 日为本基金最后运作日，自 2026 年 10 月 18 日起，本基金进入清算程序。本基金进入清算程序后，不再办理申购、赎回、转换及定期定额投资等业务，并停止收取基金管理费、基金托管费及 C 类基金份额的销售服务费。

四、财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（已审计）

会计主体：东海消费臻选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 10 月 17 日

单位：人民币元

资产	本期末 2026 年 10 月 17 日 （基金最后运作日）
资产：	
货币资金	1,296,151.78
结算备付金	147,041.77
存出保证金	48,975.80
交易性金融资产	7,672,770.00
其中：股票投资	7,672,770.00
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-

衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
应收清算款	1,445,401.86
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	10,610,341.21
负债和净资产	**本期末 2026 年 10 月 17 日 （基金最后运作日）**
负债 ：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	34,096.60
应付管理人报酬	7,264.23
应付托管费	1,210.70
应付销售服务费	424.77
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	21,002.78
负债合计	63,999.08
净资产：	
实收基金	12,391,113.86

未分配利润	-1,844,771.73
所有者权益合计	10,546,342.13
负债和净资产总计	10,610,341.21

注：（1）报告截止日 2026 年 10 月 17 日，基金份额总额 12,391,113.86 份，其中东海消费臻选混合发起式 A 类基金份额净值为人民币 0.8530 元，基金份额 10,057,838.88 份；东海消费臻选混合发起式 C 类基金份额净值为人民币 0.8428 元，基金份额 2,333,274.98 份。（2）财务报告已经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师范少君、洪雁南签字出具了容诚专字[2026]230Z2070 号标准无保留意见的审计报告。

五、基金财产分配

自 2026 年 10 月 18 日至 2026 年 10 月 23 日止的清算期间，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。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剩余财产中支付。

5.2 资产处置情况

（1）本基金最后运作日银行存款为人民币 1,296,151.78 元，其中托管户存款为人民币 1,295,814.43 元，应计银行存款利息为人民币 337.35 元。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，本基金基金管理人将以自有资金先行垫付尚未返还的银行存款利息。

（2）本基金最后运作日存出保证金金额为人民币 48,975.80 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所存出保证金为人民币 22,457.12 元，应计利息为人民币 5.94 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司的深交所存出保证金为人民币 26,505.36 元，应计利息为人民币 7.38 元。

（3）本基金最后运作日结算备付金金额为人民币 147,041.77 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最低结算备付金为人民币 66,215.91 元，应计利息为人民币 28.56 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的最低结算备付金为人民币 80,777.89 元，应计利息为人民币 19.41 元。

（4）本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 7,672,770.00 元，全部为股票投资。2026 年 10 月 19 日至 2026 年 10 月 21 日，本基金完成持仓股票变现及对应股息红利税补

缴；其中股票卖出成交金额为人民币 7,706,446.00 元，交易费用为人民币 7,937.88 元，股息红利税补缴金额为人民币 1,589.64 元。截至 2026 年 10 月 21 日，上述变现金额已全部划回托管账户。

5.3 负债清偿情况

（1）本基金最后运作日应付赎回款为人民币 34,096.60 元，该款项已于 2026 年 10 月 19 日及 10 月 20 日支付。

（2）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 7,264.23 元，该款项已于 2026 年 10 月 20 日支付。

（3）本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,210.70 元，该款项已于 2026 年 10 月 20 日支付。

（4）本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 424.77 元，该款项已于 2026 年 10 月 20 日支付。

（5）本基金最后运作日其他负债为人民币 21,002.78 元，其中：应付佣金为人民币 5,440.58 元，该款项已于 2026 年 10 月 22 日支付；预提律师费用为人民币 10,000.00 元，将于取得律师费发票后支付；预提审计费为人民币 5,562.20 元，将于取得审计费发票后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	最后运作日后一日至清算结束日（2026 年 10 月 18 日至 2026 年 10 月 23 日）
一、清算收益	**30,601.80**
1.利息收入（注 1）	453.32
2.投资收益（损失以“-”填列）（注 2）	53,509.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）（注 3）	-23,360.75
4.其他收入	-
二、清算费用	**-**
三、清算净收益	**30,601.80**

注1：利息收入系自2026年10月18日至2026年10月23日止清算期间计提的银行存款利息收入、存出保证金利息收入，共计人民币453.32元。

注2：投资收益系清算期间的卖出股票差价收入及交易费用。

注3：公允价值变动损益系清算期间处置交易性金融资产所致，为原计入交易性金融资产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 10 月 17 日基金净资产	10,546,342.13
加：清算期间净收益（净损失以“-”填列）	30,601.80
减：基金净赎回金额（于 2026 年 10 月 19 日确认的投资者赎回或转换转出申请）	40,735.68
二、清算结束日 2026 年 10 月 23 日基金净资产	10,536,208.25

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日2026年10月23日，本基金剩余财产为人民币10,536,208.25元。

根据本基金《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基金份额比例进行分配。

自本基金清算起始日2026年10月18日至清算款划出前一日的银行存款等产生的利息归基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，本基金基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异，将由基金管理人承担），供清盘分配使用。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及剩余财产分配安排

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》等规定及时进行基金剩余财产分配。

六、备查文件

6.1 备查文件目录

1. 《东海消费臻选混合型发起式证券投资基金清算审计报告》

2. 《关于<东海消费臻选混合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

基金管理人和基金托管人的办公场所。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

东海消费臻选混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

清算报告出具日：2026 年 11 月 10 日