

东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划

清算报告

集合计划管理人：东海证券股份有限公司

集合计划托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月三十日

报告公告日期：二〇二四年七月三十一日

目录

一、重要提示.....	3
二、集合计划概况.....	4
三、财务会计报告.....	5
四、清算情况.....	6
五、备查文件.....	8

一、重要提示

东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划转型变更而来。本集合计划的管理人东海证券股份有限公司于2021年7月19日发布《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划合同生效公告》（以下简称“《公告》”）。根据《公告》，经中国证监会《关于准予东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2021〕956号），“东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划”变更为“东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划”。合同变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。自2021年7月19日起《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《集合计划合同》”）、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》正式生效。本集合计划管理人为东海证券股份有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《集合计划合同》“第四部分 集合计划的基本情况”中“六、集合计划存续期限”的约定：“本集合计划存续期限自《东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划合同》生效至本合同终止之间的期限。中国证监会另有规定的，按规定执行。”

根据中国证监会发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39号）“六、未取得公募基金管理资格的证券公司应按照以下流程，完成大集合产品的规范验收及产品合同变更申请：（二）取得确认函后，证券公司就该大集合产品向中国证监会提交合同变更申请，合同期限原则上不得超过3年”。因此本集合计划合同期限原则上不得超过3年。

截至2024年7月19日，本集合计划合同期限满3年，触发《集合计划合同》终止情形，《集合计划合同》应当终止，且无需召开集合计划份额持有人大会。本集合计划的最后运作日定为2024年7月22日。

本集合计划于2024年7月23日起进入清算期，由本集合计划管理人东海证券股份有限公司、本集合计划托管人中国工商银行股份有限公司、天职国际会计师事务所

所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2024年7月23日组成本集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序，并由天职国际会计师事务所（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。

二、集合计划概况

集合计划名称	东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划
集合计划简称	东海海睿致远
集合计划主代码	970048
集合计划运作方式	契约型开放式
集合计划合同生效日	2021年7月19日
集合计划管理人	东海证券股份有限公司
集合计划托管人	中国工商银行股份有限公司
最后运作日 (2024年7月22日)	27,803,226.04份
集合计划份额总额	
投资目标	本集合计划在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求集合计划资产的长期增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、行业配置策略</p> <p>2、个股精选策略</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>(四) 资产支持证券投资策略</p> <p>(五) 期货投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p> <p>2、国债期货投资策略</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本集合计划是一只混合型集合资产管理计划，理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

三、财务会计报告

集合计划最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：东海海睿致远

报告截止日：2024年7月22日（集合计划最后运作日）

单位：人民币元

资产	2024年7月22日(集合计划最后运作日)
资产：	
银行存款	10,303,820.61
结算备付金	22,804.54
存出保证金	3,323.96
交易性金融资产	13,101,319.00
其中：股票投资	13,101,319.00
其他应收款	
应收清算款	
资产总计	23,431,268.11
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	5,936,314.76
应付管理人报酬	15,006.34
应付托管费	2,501.07
应付销售服务费	
其他负债	35,570.82
负债合计	5,989,392.99
所有者权益：	
实收基金	27,803,226.04
未分配利润	-10,361,350.92
所有者权益合计	17,441,875.12
负债和所有者权益总计	23,431,268.11

注：报告截止日2024年7月22日(集合计划最后运作日)，集合计划份额净值0.6273元,集合计划份额总额27,803,226.04份，集合计划资产净值17,441,875.12元。

四、清算情况

自2024年7月23日起至2024年7月25日止的清算期间，集合计划财产清算小组对本集合计划的资产、负债进行清算，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《集合计划合同》第十九部分“集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算”的规定，清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本集合计划最后运作日的银行存款余额为人民币10,303,820.61元（含银行存款应收利息人民币2,597.75元），该部分款项由托管人负责保管；

(2) 本集合计划最后运作日的结算备付金余额为人民币22,804.54元（含结算备付金应收利息人民币17.17元），款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。其他款项待实际划付清算款时，由管理人东海证券股份有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，待回款后再返还给管理人；

(3) 本集合计划最后运作日的存出保证金余额为人民币3,323.96元（含存出保证金应收利息人民币5.57元），该款项由中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司收取并保管。待实际划付清算款时，由管理人东海证券股份有限公司以自有资金先行垫付，供清盘分配使用，待回款后再返还给管理人；

(4) 本集合计划最后运作日持有的交易性金融资产全部为股票投资，股票市值为人民币13,101,319.00元，该金额为各只股票的最后运作日估值金额之和。股票投资于2024年7月25日全部变现。

3、负债清偿情况

(1) 本集合计划最后运作日应付赎回款为人民币5,936,314.76元，该款项于2024年7月23日支付。

(2) 本集合计划最后运作日应付管理人报酬为人民币15,006.34元，该款项将于实际支付时扣除。

(3) 本集合计划最后运作日应付托管费为人民币2,501.07元，该款项将于实

际支付时扣除。

(4) 本集合计划最后运作日其他负债为人民币35,570.82元,包括应付交易费用、预提审计费和预提信息披露费等。本集合计划最后运作日应付交易费用为人民币2,124.97元,该款项将于实际支付时扣除。本集合计划最后运作日预提审计费为人民币5,573.28元,该款项在清盘期间有调整,最终确定审计费为人民币10,000.00元,该款项将于实际支付时扣除;本集合计划最后运作日预提信息披露费为人民币27,868.44元,该款项在清盘期间有调整,最终确定无需支付信息披露费。

4、清算期间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2024年7月22日集合计划净资产	17,441,875.12
加:清算期间(2024年7月23日-25日)收入	-339,328.58
股票变现收入	-339,465.50
利息收入-银行存款利息收入(注1)	89.94
利息收入-结算备付金利息收入(注2)	3.06
利息收入-存出保证金利息收入(注3)	0.45
其他业务收入	43.47
减:清算期间(2024年7月23日-25日)赎回款和费用(注5)	12,446,136.03
银行汇划费	318.73
信息披露费(注6)	-27,868.44
审计费(注7)	4,426.72
赎回费归管理人	43.47
二、2024年7月25日集合计划净资产	4,679,490.03

注:(1)利息收入暂以当前适用的利率预估计提2024年7月25号(假定清算款划付日期为2024年7月25日)的银行存款利息,若清算款实际划付日期变更,该金额也将相应调整。

(2)利息收入暂以当前适用的利率预估计提2024年7月25号(假定清算款划付日期为2024年7月25日)的结算备付金利息,若清算款实际划付日期变更,该金额

也将相应调整。

(3) 利息收入暂以当前适用的利率预估计提2024年7月25号（假定清算款划付日期为2024年7月25日）的存出保证金利息，若清算款实际划付日期变更，该金额也将相应调整。

(4) 本集合计划最后运作日为2024年7月22日，2024年7月23日至7月25日为清算期，以上清算期资产状况包含2024年7月23日至7月25日的利息收入。

(5) 应付赎回款为持有人于7月22日提出的赎回申请产生的应付赎回款，该笔款项将于2024年7月24日支付。

(6) 本次集合计划清盘无需支付信息披露费，故将账面原本计提的费用冲回。

(7) 审计费为本集合计划最后运作日预提2024年年度审计费与清盘期间确定的清盘审计费之间，进行的差额调整。

资产处置及负债清偿后，于2024年7月25日本集合计划剩余财产为人民币4,679,490.03元，根据本集合计划的《集合计划合同》约定，依据集合计划财产清算的分配方案，按本集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

2024年7月25日至清算款实际划出日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金等产生的利息属份额持有人所有。为保护集合计划份额持有人利益，加快清盘速度，管理人东海证券股份有限公司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），供清盘分配使用。待结息日回款后再返还管理人。

5、财产清算报告的告知安排

本清算报告已经托管人复核其中财务数据，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本集合计划份额持有人公告。

五、备查文件

1、备查文件目录

(1) 《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划2024年1月1日至2024年7月22日(集合计划最后运作日)止期间的财务报表及审计报告》

(2) 关于东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划清算事宜之法律意见

2、存放地点

管理人的办公场所。

3、查阅方式

持有人可在营业时间内至管理人的办公场所免费查阅。

东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划

财产清算小组

2024年7月 30 日