

国海六个月滚动持有债券型 集合资产管理计划 清算报告

管理人：国海证券股份有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2024年12月18日

清算报告公告日：2024年12月26日

一、重要提示

国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由国海金贝壳 5 号集合资产管理计划变更而来，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）机构部函〔2020〕3140 号批准。《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”或“集合计划合同”）自 2021 年 6 月 7 日起生效。本集合计划管理人为国海证券股份有限公司（以下简称“管理人”），托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“托管人”）。

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》《资产管理合同》的有关规定，本集合计划由于存续期届满，国海证券股份有限公司依据法律法规的规定及集合计划合同的约定终止《资产管理合同》并履行财产清算程序，此事项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为 2024 年 12 月 6 日。

本集合计划于 2024 年 12 月 7 日起进入清算期，由本集合计划管理人国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、上会会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于 2024 年 12 月 7 日组成集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序，并由上会会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进

行审计，上海市通力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	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划
集合计划简称	国海六个月滚动持有债券型
集合计划主代码	970027
集合计划运作方式	契约型开放式，并对每份集合计划份额设置六个月滚动运作期。
集合计划合同生效日	2021年6月7日
集合计划管理人	国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12月6日）集合计划份额总额	516,235,252.60 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现计划资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本集合计划采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，在货币市场工具、利率债、信用债等资产之间进行灵活配置，在严格控制风险的

	<p>前提下，力争实现资产的长期稳定增值。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、利率品种投资策略 3、信用品种投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、国债期货投资策略 	
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*90%+中证可转换债券指数收益率*10%	
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币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、混合型基金和混合型集合资产管理计划。	
下属集合计划份额类别简称	国海六个月滚动持有债券型 A	国海六个月滚动持有债券型 C
下属集合计划份额类别代码	970027	970028
最后运作日（2024年12月6日）下属集合计划份额总额	516,235,252.60 份	-

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：国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2024年12月6日（集合计划最后运作日）

单位：人民币元

	2024年12月6日（集合计划最后运作日）
资产：	
银行存款	372,721,716.75
结算备付金	9,677,641.92
存出保证金	22,130.04
买入返售金融资产	-19,123.29
应收清算款	200,028,684.93
资产总计	582,431,050.35
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	2,172,484.89
应付管理人报酬	57,701.19
应付托管费	4,808.43
应交税费	3,346.17
其他负债	228,493.60

负债合计	2,466,834.28
所有者权益：	
实收基金	516,235,252.60
未分配利润	63,728,963.47
所有者权益合计	579,964,216.07
负债和所有者权益总计	582,431,050.35

四、清算报表附注

1、集合计划基本情况

本集合计划由“国海金贝壳5号集合资产管理计划”变更而来，国海金贝壳5号集合资产管理计划2011年6月9日经中国证监会证监许可〔2011〕932号核准设立，自2011年7月25日起开始募集，于2011年8月26日结束募集工作，并于2011年9月1日正式成立，集合计划类型为限定性，无固定存续期。

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《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》的规定，并经中国证监会机构部函〔2020〕3140号批准，《资产管理合同》自2021年6月7日起生效，原《国海金贝壳5号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

根据国海证券股份有限公司于2024年12月6日发布的《关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同终止及集合计划财产清算的公告》，本集合计划自2024年12月7日起进入清算

程序。

2、清算原因

《资产管理合同》第十九部分“合同的变更、终止与集合计划财产的清算”约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：……3、《资产管理合同》约定的其他情形；”第四部分“集合计划的基本情况”约定：“……本集合计划存续期限为自本合同生效之日起至**2024年12月6日**。”

根据前述约定，本集合计划于**2024年12月6日**到期，管理人根据相关法律法规、《资产管理合同》等规定对本集合计划进行终止并清算。

3、清算起始日

本集合计划清算起始日为**2024年12月7日**。管理人国海证券股份有限公司、托管人中国工商银行股份有限公司、上会会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于**2024年12月7日**组成集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序，并由上会会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

4、清算报表编制基础

本集合计划的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本集合计划最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

本集合计划清算期为**2024年12月7日至2024年12月10日**，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《资产管理合同》第十九部分“合同的变更、终止与集合计划财产的清算”的约定，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

截至清算期结束日（**2024年12月10日**），各项资产处置情况如下：

（1）本集合计划最后运作日的银行存款余额为人民币**372,721,716.75元**（含银行存款应收利息人民币**40,173.29元**）；

（2）本集合计划最后运作日的结算备付金余额为人民币**9,677,641.92元**（含结算备付金应收利息人民币**35,947.48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。待实际划付清算款时，由管理人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**22,130.04**元（含存出保证金应收利息人民币**51.14**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的应收证券清算款为人民币**200,028,684.93**元，该款项已于**2024**年**12**月**9**日回款至托管户。

(5) 本集合计划最后运作日买入返售金融资产**-19,123.29**元，全部为应计买入返售利息。清算期间计提逆回购收益**19,123.29**元。清算结束日买入返售金融资产为零元。

3、负债清偿情况

截至清算期结束日（**2024**年**12**月**10**日），各项负债清偿情况如下：

(1) 本集合计划最后运作日应付赎回款为人民币**2,172,484.89**元，该款项已于**2024**年**12**月**9**日支付。

(1) 本集合计划最后运作日应付管理人报酬为人民币**57,701.19**元，该款项于清算结束日尚未支付。

(2) 本集合计划最后运作日应付托管费为人民币**4,808.43**元，该款项于清算结束日尚未支付。

(3) 本集合计划最后运作日应付应交税费为人民币**3,346.17**元，截至本集合计划清算结束日增至**3,969.98**元，该款项于清算结束日尚未支付。

(4) 本集合计划最后运作日其他负债为人民币 228,493.60 元，其中应付交易费用为人民币 79,422.04 元，预提审计费为人民币 37,267.89 元，预提信息披露费为人民币 111,803.67 元，上述费用于清算结束日尚未支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 12 月 6 日集合计划净资产	579,964,216.07
加：清算期间（2024 年 12 月 7 日至 12 月 10 日）收入	
利息收入-银行存款利息收入（注 1）	18,199.44
利息收入-结算备付金利息收入（注 2）	2,318.90
利息收入-存出保证金利息收入（注 3）	3.96
利息收入-买入返售	19,123.29
减：清算期间（2024 年 12 月 7 日至 12 月 10 日）赎回款和费用	
应付赎回款（注 5）	1,531,354.34
律师费（注 6）	10,000.00
应付税费（注 7）	623.81
二、2024 年 12 月 10 日集合计划净资产	578,461,883.51

注：（1）利息收入以当前适用的利率计提至**2024年12月10日**的银行存款利息，根据清算款实际划付日期，该金额也将相应调整。

（2）利息收入以当前适用的利率计提至**2024年12月10日**的结算备付金利息，根据清算款实际划付日期，该金额也将相应调整。

（3）利息收入以当前适用的利率计提至**2024年12月10日**的存出保证金利息，根据清算款实际划付日期，该金额也将相应调整。

（4）本集合计划最后运作日为**2024年12月6日**，**2024年12月7日至2024年12月10日**为清算期，以上清算期资产状况包含**2024年12月7日至2024年12月10日**期间的利息收入。

（5）应付赎回款为持有人于**2024年12月6日**提出的赎回申请产生的应付赎回款，该款项已于**2024年12月10日**支付。

（6）律师费为本集合计划清算出具法律意见书的律师费，该款项于清算结束日尚未支付。

（7）应付税费为本集合计划**2024年12月7日至2024年12月8日**买入返售利息收入所产生的增值税，该款项于清算结束日尚未支付。

5、资产处置及负债清偿后的剩余财产分配情况

资产处置及负债清偿后，截至清算结束日**2024年12月10日**本集合计划剩余财产为人民币**578,461,883.51元**，根据《资产管理合同》约定，依据本集合计划财产清算的分配方案，按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12月10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集合计划份额持有人所有。为保护集合计划份额持有人利益，加快清盘速度，管理人将以自有资金先行垫付该款项（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。管理人垫付资金到账起孳生的利息归管理人所有。

6、清算报告的告知安排

本清算报告已经托管人复核，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集合计划份额持有人公告。

六、备查文件

1、备查文件目录

(1) 《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划审计报告》

(2) 上海市通力律师事务所关于《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划清算报告》的法律意见

2、存放地点

管理人的办公场所。

3、查阅方式

持有人可登录管理人网站查阅，或在营业时间内至管理人的办公场所免费查阅。

国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划财产清算小组

2024年12月18日