

东海证券海盈3个月持有期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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年一月二日

报告公告日期：二〇二五年一月三日



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	7

一、重要提示

东海证券海盈3个月持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由东海证券东风9号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12月3日发布《东海证券海盈3个月持有期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《关于准予东海证券东风9号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函（2021）2931号），“东海证券东风9号集合资产管理计划”变更为“东海证券海盈3个月持有期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12月3日起《东海证券海盈3个月持有期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》”）、《东海证券海盈3个月持有期混合型集合资产管理计划托管协议》、《东海证券海盈3个月持有期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，托管人为交通银行股份有限公司。

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：“自《东海证券东风9号集合资产管理计划合同》生效至本合同终止之间的期限。本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过3年。”

截至2024年12月3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12月3日。

本集合计划于2024年12月4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、本集合计划托管人交通银行股份有限公司、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2024年12月4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，并由容诚会计师事务所（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	东海证券海盈3个月持有期混合型集合资产管理计划
集合计划简称	东海证券海盈3个月持有期
集合计划主代码	970080
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12月3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	交通银行股份有限公司
最后运作日 (2024年12月3日) 集合计划份额总额	302,140.69份
投资目标	本集合计划在严格控制风险的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、债券投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 普通债券投资策略 (2) 信用债券投资策略 (3) 可转换债券投资策略 (4) 可交换债券投资策略 (5) 债券回购杠杆策略 3、资产支持证券投资策略 4、股票投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 行业配置策略 (2) 个股选择策略 5、新股申购策略 6、期货投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 股指期货投资策略 (2) 国债期货投资策略
业绩比较基准	中债新综合指数(全价)指数收益率×85%+沪深300指数收益率×15%
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,理论上其预期收益与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：东海证券海盈3个月持有期

报告截止日：2024年12月3日（集合计划最后运作日）

单位：人民币元

资产	2024年12月3日(集合计划最后运作日)
资产：	
银行存款	296,917.65
结算备付金	7,864.57
存出保证金	117.50
交易性金融资产	0.00
其中：股票投资	0.00
其他应收款	0.00
应收清算款	0.00
资产总计	304,899.72
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	0.00
应付管理人报酬	541.44
应付托管费	101.51
应付交易费用	150.14
应付税费	101.16
负债合计	894.25
所有者权益：	
实收基金	302,140.69
未分配利润	1,864.78
所有者权益合计	304,005.47
负债和所有者权益总计	304,899.72

注：报告截止日2024年12月3日(集合计划最后运作日)，集合计划份额净值1.0062元，集合计划份额总额302,140.69份，集合计划资产净值304,005.47元。

四、清算情况

自2024年12月4日起至2024年12月6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》第二十部分“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296,917.65元（含银行存款应收利息人民币127.71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7,864.57元（含结算备付金应收利息人民币54.94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117.50元（不含利息），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。

3、负债清偿情况

(1) 本集合计划最后运作日应付管理人报酬为人民币541.44元，该款项将于实际支付时扣除。

(2) 本集合计划最后运作日应付托管费为人民币101.51元，该款项将于实际支付时扣除。

(3) 本集合计划最后运作日其他负债为人民币251.30元，包括应付交易费用、应付税费等。本集合计划最后运作日应付交易费用为人民币150.14元，该款项将于实际支付时扣除。本集合计划最后运作日应付税费为人民币101.16元，该款项将于实际支付时扣除。

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12月3日集合计划净资产	304,005.47
加：清算期间（2024年12月4日-6日）收入	
利息收入-银行存款利息收入（注1）	8.46
利息收入-结算备付金利息收入（注2）	1.05
减：清算期间（2024年12月4日-6日）赎回款和费用（注3）	10,012.95
银行汇划费	20.00
二、2024年12月6日集合计划净资产	293,982.03

注：（1）利息收入暂以当前适用的利率预估计提2024年12月6日（假定清算款划付日期为2024年12月6日）的银行存款利息。

（2）利息收入暂以当前适用的利率预估计提2024年12月6日（假定清算款划付日期为2024年12月6日）的结算备付金利息。

（3）应付赎回款为持有人于12月3日提出的赎回申请产生的应付赎回款，该笔款项已于2024年12月5日支付。

资产处置及负债清偿后，于2024年12月6日本集合计划剩余财产为人民币293,982.03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12月6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) 《东海证券海盈3个月持有期混合型集合资产管理计划清算审计报告容诚专字[2025]230Z0018号》

(2) 关于《东海证券海盈3个月持有期混合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

持有人可在营业时间内至管理人的办公场所免费查阅。

东海证券海盈3个月持有期混合型集合资产管理计划

财产清算小组

2025年1月2日

