

东海证券股份有限公司

—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

天职业字[2024]47033号

目 录

清算报告	1
清算报表	3
清算事项说明	7



清算报告

天职业字[2024]47033号

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组：

我们审计了后附的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“本计划”或“集合计划”）清算报表，包括2024年7月25日的清算资产负债表及清算财产表以及2024年7月22日至2024年7月25日的清算损益表及债务清偿表。

一、集合计划管理人对清算报表的责任

按照国家颁布的企业会计准则和企业清算的规定编制清算报表是集合计划管理人—东海证券有限公司的责任。这种责任包括设计、实施和维护与清算报表相关的内部控制，以使清算报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们按照中国注册会计师审计准则计划和执行审计工作，以合理确信这些清算财务报表是否不存在重大错报。审计工作包括在抽查的基础上检查支持这些清算财务报表金额和披露的证据，评价集合计划清算组在编制这些清算财务报表时采用的会计政策和作出的重大会计估计，以及评价这些清算会计报表的整体反映。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，集合计划清算报表已经按照国家颁布的企业会计准则和企业清算的规定编制，在所有重大方面公允地反映了集合计划2024年7月25日的清算资产负债表及清算财产表以及2024年7月22日至2024年7月25日的清算损益表及债务清偿表。

[以下无正文]



清算报告（续）

天职业字[2024]47033号

[此页无正文]



中国注册会计师：



中国注册会计师：



东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划

清算财产表

2024年7月25日

金额单位：人民币元

项目	清算结束日	预计可变现金额
普通财产：		
银行存款	4,688,994.25	4,688,994.25
结算备付金	22,807.60	22,807.60
存出保证金	3,324.41	3,324.41
交易性金融资产		
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
应收证券清算款		
应收利息		
应收股利		
应收申购款		
其他资产		
清算财产总计	4,715,126.26	4,715,126.26



东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划

清算损益表

2024年7月22日至2024年7月25日

金额单位：人民币元

项目	本期数
一、清算收益（清算损失以“-”号表示）	
1、存款利息收入	93.45
2、赎回收入	
3、汇兑损益	
4、投资收益	-1,914,538.43
5、公允价值变动	1,575,072.93
6、其他业务收入	43.47
清算收入小计	-339,328.58
二、清算支出	
1、托管费	
2、管理人报酬	
3、清算费用	-23,122.99
其中：其他费用	-23,122.99
清算支出小计	-23,122.99
三、本期清算净收益（清算损失以“-”号表示）	-316,205.59
四、从持有人权益转入	17,441,875.12
五、累计清算净收益（清算净损失以“-”号表示）	17,125,669.53



东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划

债务清偿表

2024年7月22日至2024年7月25日

金额单位：人民币元

项目	清算开始日	本期增加	本期减少	清算结束日	本期以现金清偿
普通债务：					
应付赎回款	5,936,314.76	12,446,113.23	18,382,427.99		
应付管理人报酬	15,006.34			15,006.34	
应付交易费用	2,124.97	6,003.85		8,128.82	
应付托管费	2,501.07			2,501.07	
其他负债	33,445.85		23,445.85	10,000.00	
债务合计	5,989,392.99	12,452,117.08	18,405,873.84	35,636.23	



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7月22日-2024年7月25日

清算事项说明

（除另有说明外，以人民币元为货币单位）

一、东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划简介

（一）基本情况

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“本计划”或“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，东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划由东海证券季季盈集合资产管理计划转型变更而来。2013年5月31日，中国证券业协会对东海证券季季盈集合资产管理计划予以备案，并出具《关于东海证券有限责任公司发起设立东海证券季季盈集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕500号）。

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。

东海证券季季盈集合资产管理计划（筹）设立时募集资金到位情况经公证天业会计师事务所（特殊普通合伙）审验，由其出具《验资报告》（苏公C〔2013〕B039号）。根据验资报告及持有人份额明细表显示：本计划的募集资金账户确认的净参与金额为人民币720,337,000.00元。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（含公司债、企业债、国债、金融债、央行票据、中期票据、短期融资券、可转换公司债券、可分离交易债券、可交换债券）、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货等各类金融工具、银行存款及其他中国证监会允许投资的金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。集

合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 0%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（二）清算原因

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。

（三）清算期间

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》、《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》和《集合计划合同》的有关规定，本集合计划于 2024 年 7 月 19 日触发了《集合计划合同》规定的终止情形，将本集合计划的最后运作日定为 2024 年 7 月 22 日。

2024 年 7 月 23 日至 2024 年 7 月 25 日为本集合计划清算期间，最后运作日为 2024 年 7 月 22 日，清算结束日为 2024 年 7 月 25 日。

二、清算报表编制基础

本计划的会计报表按照会计准则、《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》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的集合资产管理业务实务操作的有关规定编制。

（一）费用的确认和计量

1、费用种类

本计划存续期内，作为成本列支由本计划承担的相关费用包括管理人的管理费、托管人的托管费、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、审计费、律师费和诉讼费以及仲裁费等、集合计划份额持有人大会费用、集合计划的证券/期货交易费用、集合计划的银行汇划费用、集合计划的开户

费用、账户维护费用、按照国家有关规定和《集合计划合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

2、费用标准

(1) 管理费：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的集合计划管理费；E 为前一日的集合计划资产净值）

(2) 托管人的托管费：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的集合计划托管费；E 为前一日的集合计划资产净值）

(3) 《集合计划合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用：根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

(4) 《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、审计费、律师费和诉讼费以及仲裁费等：根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

(5) 集合计划份额持有人大会费用：根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

(6) 集合计划的证券/期货交易费用：根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

(7) 集合计划的银行汇划费用：根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

(8) 集合计划的开户费用、账户维护费用：根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

(二) 不列入集合计划费用的项目

不列入集合计划费用的项目：管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划财产的损失、《集合计划合同》生效前的相关费用根据《东海证券飞龙 2 号-朱雀集合资产管理计划合同》约定执行、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目不列入集合计划费用。

(三) 本计划的税收

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。集合计划财产投资的相关税收，由集合计划份额持有人承担，管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

（四）收益分配

1、集合计划利润的构成

集合计划利润指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

2、集合计划可供分配利润

集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、集合计划收益分配原则

（1）在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

（2）本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

（3）集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）每一集合计划份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4、收益分配方案

收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

5、收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。

6、集合计划收益分配中发生的费用

集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，集合计划登记机构可将集合计划份额持有人的现金红利自动转为集合计划份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

7、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

三、清算情况

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》、《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》和《集合计划合同》的有关规定，本集合计划于2024年7月19日触发了《集合计划合同》规定的终止情形，将本集合计划的最后运作日定为2024年7月22日，并于2024年7月23日开始清算，清算期间为2024年7月23日至2024年7月25日。截至2024年7月25日，具体清算情况如下：

（一）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）；清算结束日的银行存款余额为人民币4,688,994.25元（含银行存款应收利息人民币2,687.69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）；清算结束日结算备付金金额为人民币22,807.60元（含结算备付金应收利息人民币20.23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）；清算结束日的存出保证金金额为人民币3,324.41元（含存出保证金应收利息人民币6.02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；股票投资于清算结束日（2024年7月25日）全部变现。

（二）负债处置情况

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，该款项于实际支付时扣除。

4、本集合计划最后运作日应付交易费用为人民币2,124.97元，该款项于实际支付时扣除。

5、本集合计划最后运作日其他负债为人民币33,445.85元，包括预提审计费、预提信

息披露费和应付赎回费等。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。

（三）持有人权益情况

持有人权益最后运作日为 17,441,875.12 元，清算结束日为 4,679,490.03 元。

（四）清算损益情况

项目	本期数
一、清算收益（清算损失以“-”号表示）	
1. 存款利息收入	93.45
2. 赎回收入	
3. 汇兑损益	
4. 投资收益	-1,914,538.43
5. 公允价值变动	1,575,072.93
6. 其他业务收入	43.47
清算收入小计	<u>-339,328.58</u>
二、清算支出	
1. 托管费	
2. 管理人报酬	
3. 清算费用	-23,122.99
其中：其他费用	-23,122.99
清算支出小计	<u>-23,122.99</u>
三、本期清算净收益（清算损失以“-”号表示）	<u>-316,205.59</u>
四、从持有人权益转入	17,441,875.12
五、累计清算净收益（清算净损失以“-”号表示）	<u>17,125,669.53</u>

四、清算结束日的资产负债及剩余财产分配情况

截至计划清算结束日，本计划资产总额为 4,715,126.26 元，其中：活期存款为人民币 4,686,306.56 元，应收活期存款利息为人民币 2,687.69 元；应收结算备付金为人民币 22,787.37 元，应收结算备付金利息为人民币 20.23 元；应收存出保证金为人民币 3,318.39 元，应收存出保证金利息为人民币 6.02 元。

本计划的资产支付日，全体集合计划份额持有人实收资本份额为 7,962,353.33 份，全部可分配资产为人民币 4,679,490.03 元，每单位实收资本可分配清算资产为 0.58770188 元（保留至小数点后八位）。

清算后，托管人根据本计划合同的约定，管理人将全部可分配清算资产按全体集合计划份额持有人份额的占比分配给份额持有人。份额持有人清算的可分配资产人民币4,679,490.03元，将于本计划资产支付日由托管人根据管理人的指令划付指定账户。

五、其他重要事项

本计划无其他重要事项。