

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划

清算报告

集合计划管理人:华创证券有限责任公司

集合计划托管人:中信银行股份有限公司

清算报告出具日:2025年7月10日

清算报告公告日:2025年7月15日

目录

§1 重要提示	2
§2 本集合计划基本情况	3
§3 财务会计报告（经审计）	4
§4 清算事项说明	5
4.1 本集合计划运作情况	5
4.2 清算原因	5
4.3 清算期间	6
4.4 清算报表编制基础	6
§5 清算情况	6
5.1 清算费用	6
5.2 资产处置情况	6
5.3 负债清偿情况	7
5.4 清算期间的清算损益情况	7
5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况	8
5.6 集合计划财产清算报告的告知安排	9
§6 备查文件	9
6.1 备查文件目录	9
6.2 存放地点	10
6.3 查阅方式	10

§1 重要提示

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“集合计划”)由华创银杏低风险套利集合资产管理计划变更而来。根据中国证监会于2018年11月28日发布实施的《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)的规定,华创银杏低风险套利集合资产管理计划根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)等相关法律法规及中国证监会的规定进行公募化改造,并将名称变更为“华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划”。自2021年12月24日起,《华创证券创享一年持有期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“资产管理合同”)生效,原《华创银杏低风险套利集合资产管理合同》同日起失效。本集合计划管理人为华创证券有限责任公司,托管人为中信银行股份有限公司。

根据《基金法》《运作办法》等法律法规规定和《资产管理合同》的有关约定,本集合计划已于2025年06月24日到期并触发资产管理合同终止事由。本集合计划管理人已在资产管理合同终止事由出现后终止《资产管理合同》并将依法履行本集合计划财产清算程序,无须召开本集合计划份额持有人大会。本集合计划管理人已于2025年06月25日在规定媒介刊登了《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同终止及基金财产清算的公告》。本集合计划的最后运作日为2025年06月24日,本集合计划自2025年06月25日进入清算程序。

由本集合计划管理人华创证券有限责任公司、本集合计划托管人中信银行股份有限公司、北京德皓国际会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市海华永泰律师事务所于2025年06月25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,并由北京德皓国际会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市海华永泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 本集合计划基本情况

集合计划名称	华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划	
集合计划简称	华创证券创享一年持有期	
集合计划主代码	970104	
集合计划运作方式	契约型开放式	
资产管理合同生效日	2021年12月24日	
集合计划管理人	华创证券有限责任公司	
集合计划托管人	中信银行股份有限公司	
最后运作日集合计划总份额	26,848,622.44份	
集合计划合同存续期	自本资产管理合同生效日起至2025年06月24日	
下属分级集合计划的简称	华创证券创享一年持有期 A	华创证券创享一年持有 期B
下属分级集合计划的交易代 码	970103	970104
投资目标	本集合计划主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制集合计划资产净值波动的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。	
投资策略	本集合计划将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在股票、债券和银行存款等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。具体策略：大类资产配置策略、债券组合管理策略、股票投资策略、国债期货投资策略。	
业绩比较基准	中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+中证500指数收益率*10%。	
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益率低于股票型集合计划和混合型集合计划，高于货币市场集合计划。	

§3 财务会计报告（经审计）

资产负债表（本集合计划最后运作日）

会计主体：华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2025年06月24日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2025年06月24日
资 产：	
货币资金	46,986,291.62
结算备付金	141,535.22
存出保证金	6,960.59
交易性金融资产	0.00
应收申购款	0.00
其他资产	0.00
资产总计	47,134,787.43
负债和净资产	最后运作日 2025年06月24日
负 债：	
卖出回购金融资产款	0.00
应付清算款	0.00
应付赎回款	2,635,816.78
应付管理人报酬	33,351.00
应付托管费	6,414.49
应付销售服务费	0.00
应付投资顾问费	0.00
应交税费	18,222.45
应付利润	0.00
递延所得税负债	0.00
其他负债	120,882.03
负债合计	2,814,686.75
净资产：	
实收资本	26,848,622.44
未分配利润	17,471,478.24
净资产合计	44,320,100.68

负债和净资产总计	47,134,787.43
----------	---------------

注：本集合计划最后运作日为2025年06月24日，集合计划份额净值44,320,100.68元，集合计划份额总额26,848,622.44份，其中华创证券创享一年持有期A类集合计划份额净值40,849,563.68元，A类集合计划份额总额23,619,567.59份；华创证券创享一年持有期B类集合计划份额净值3,470,537.00元，B类集合计划份额总额3,229,054.85份。

§4 清算事项说明

4.1 本集合计划运作情况

本集合计划资产管理合同于2021年12月24日正式生效，自本资产管理合同生效日起存续期至2025年06月24日，资产管理合同生效日本集合计划份额总数为215,451,132.07份，有效户数为1791户。

根据《基金法》《运作办法》等法律法规规定和《资产管理合同》的有关约定，本集合计划已于2025年06月24日到期并触发资产管理合同终止事由。本集合计划管理人已在资产管理合同终止事由出现后终止《资产管理合同》并依法履行本集合计划财产清算程序，无须召开本集合计划份额持有人大会。

自本集合计划资产管理合同生效日至最后运作日，本集合计划按《资产管理合同》约定正常运作。自2025年06月25日进入清算程序。

4.2 清算原因

根据《资产管理合同》第五部分“集合计划的存续”项下约定：“本集合计划自本资产管理合同生效日起存续期至2025年06月24日”。《资产管理合同》第二十部分“资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算”中“二、《资产管理合同》的终止事由”项下约定：“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：……4、《资产管理合同》期限届满而未延期；……”本集合计划资产管理合同到期日为2025年06月24日，已触发本集合计划资产管理合同终止情形。本集合计划将根据《资产管理合同》约定进入本集合计划财产清算程序，无需召开本集合计划份额持有人大会。

根据本集合计划管理人于2025年06月25日发布的《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同终止及基金财产清算的公告》，本集

合计划的最后运作日为 2025 年 06 月 24 日,自 2025 年 06 月 25 日进入清算程序。

4.3 清算期间

本集合计划的清算期间为 2025 年 06 月 25 日(清算开始日)起至 2025 年 7 月 3 日(清算结束日)止。

4.4 清算报表编制基础

本集合计划的清算财务报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定编制的。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,本清算财务报表并无比较期间的相关数据列示。管理人编制本清算财务报表是为了本集合计划财产清算小组报送本集合计划全体持有人以及中国证监会使用,不适用于其他用途。

§5 清算情况

自2025年06月25日至2025年7月3日止清算期间,本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,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

清算费用是指本集合计划财产清算小组在进行本集合计划清算过程中发生的所有合理费用。按照《资产管理合同》的规定,清算费用由本集合计划财产清算小组优先从本集合计划财产中支付。

考虑到本集合计划的实际情况,从保护集合计划份额持有人利益的角度出发,本集合计划清算期间的律师费将由管理人承担,其他清算费用从集合计划财产中支付。

5.2 资产处置情况

1、本集合计划最后运作日银行存款为人民币46,986,291.62元,其中包括活期存款为人民币46,985,798.40元,应计活期存款利息为人民币493.22元;

2、本集合计划最后运作日结算备付金为人民币141,535.22元，其中上海、深圳证券交易所结算备付金分别为人民币138,240.16元、3,289.58元，其应计利息人民币5.48元。2025年7月将新增结算备付金为人民币296,624.18元；

3、本集合计划最后运作日存出保证金为人民币6,960.59元，其中上海、深圳证券交易所结算备付金分别为人民币4,502.02元、2,458.33元，其应计利息人民币0.24元。清算期间新增的存出保证金为人民币3,884.86元。

5.3 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2,635,816.78元，清算期间应付赎回款为人民币1,801,292.98元，该两笔款项已于清算期间支付；

2、本集合计划最后运作日应付管理人报酬为人民币33,351.00元，该款项已于2025年7月3日支付；

3、本集合计划最后运作日应付托管费为人民币6,414.49元，该款项已于2025年7月3日支付；

4、本集合计划最后运作日应交税费为人民币18,222.45元，该款项已于2025年7月3日支付；

5、本集合计划最后运作日其他负债为人民币120,882.03元，分别为：应付2024年年报审计费25,000.00元，预提清算审计费人民币25,000.00元，应付交易佣金为人民币26,925.87元，预提银行间交易费用800.00元，预提上交所账户维护费及查询服务费人民币4,800.00元，预提信息披露费38,356.16元。其中应付2024年年报审计费已于2025年7月3日支付，应付交易佣金已于2025年7月3日支付，预提银行间交易费用及上交所账户维护费已于2025年6月27日及2025年6月30日支付，预提信息披露费、清算审计费将于清算结束后支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2025年06月25日至2025年7月3日止清算期间
一、清算期间收入	
1、利息收入	3,751.94
其中存款利息收入	3,738.97

2、投资收益（损失以“-”填列）	-
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-
二、清算期间费用	
1、利息支出	-
2、其他费用	1,395.18
三、清算期间利润总额	
减：所得税费用	-
四、清算期间净收益	2,356.76

1、本集合计划清算期间利息收入，包括以当前适用的利率计提的清算开始日至清算结束日止期间的银行存款利息，上海/深圳证券交易所结算备付金利息收入，上海/深圳证券交易所存出保证金利息收入；

2、本集合计划清算期间投资收益，包括清算期间卖出债券产生的投资收益和清算期间债券利息收入；

3、本集合计划清算期间公允价值变动损益，系清算期间卖出债券时转出的公允价值变动累计金额；

4、本集合计划清算期间利息支出，系清算期间产生的卖出回购利息支出；

5、本集合计划清算期间其他费用，系清算期间产生的银行汇划费、中登TA服务费。其中银行汇划费为人民币242.72元，包括预估银行汇划费为人民币65元，将于清算结束日后支付；中登TA服务费为人民币1,152.46元，包括预估中登TA清算服务费为人民币126.83元，将于清算结束日后支付。其他费用可能与实际支付金额存在略微差异，差额由本集合计划管理人承担。

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2025年06月24日集合计划净资产	44,320,100.68
加：清算期间净收益	2,356.76
减：集合计划赎回金额（于清算期间确认的最后运作日赎回申请）	1,801,292.98
二、清算结束日2025年7月3日集合计划净资产	42,521,164.46

1、2025年06月25日(清算开始日)至2025年7月3日(清算结束日)期间净收益为人民币2,356.76元。

2、于清算结束日2025年7月3日,本集合计划净资产为人民币42,521,164.46元。根据本集合计划的资产管理合同约定,依据本集合计划财产清算的分配方案,将本集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除本集合计划财产清算费用(由本集合计划管理人承担的部分除外)、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后,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。因利息收入等变动原因,最终支付的清算资金以登记机构的记录为准。

3、清算结束日2025年7月3日后至清算款划出日前一日的银行存款应计利息、结算备付金应计利息及存出保证金应计利息归本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,本集合计划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,差额由本集合计划管理人承担),供清盘分配使用。本集合计划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集合计划管理人。

4、为保护集合计划份额持有人利益,加快清盘速度,本集合计划管理人将以自有资金先行垫付结算备付金及存出保证金,供清盘分配使用。本集合计划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集合计划管理人。

5.6 集合计划财产清算报告的告知安排

本清算报告已经本集合计划托管人复核,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本集合计划份额持有人公告。清算报告公告后,本集合计划管理人将遵照法律法规、《资产管理合同》等规定及时进行剩余财产分配。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

1、《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划清算审计报告(德皓核字[2025]00001380号)》;

2、《上海市海华永泰律师事务所关于〈华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划清算报告〉之法律意见》。

6.2 存放地点

北京市西城区锦什坊街26号恒奥中心C座3A华创证券

6.3 查阅方式

备查文件存放在本集合计划管理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划

财产清算小组

2025年7月10日