

# 海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划 清算报告

管理人：上海海通证券资产管理有限公司

托管人：交通银行股份有限公司

清算报告出具日：2025年08月11日

清算报告公告日：2025年08月14日

## 一、重要提示

海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由海通海蓝内需价值优选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〔2021〕1856号批准。《海通红利优选一年持有期混合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》”）自2021年7月27日起生效。本集合计划管理人为上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”），托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“托管人”）。

根据《资产管理合同》“第五部分 集合计划的存续”中的约定：“本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至2025年7月26日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。如本集合计划到期后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合计划份额持有人大会。”

本集合计划《资产管理合同》自2021年7月27日起生效，存续期至2025年7月26日。存续期届满后，本集合计划应当终止，并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2025年7月26日。

本集合计划于2025年7月27日起进入清算期，由本集合计划管理人上海海通证券资产管理有限公司、本集合计划托管人交通银行股份有限公司、立信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2025年7月27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，并由立信会计师事务所（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

1. 集合计划名称：海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划
2. 集合计划简称：海通红利优选
3. 集合计划主代码：850006
4. 集合计划运作方式：契约型开放式
5. 集合计划合同生效日：2021年7月27日
6. 集合计划管理人：上海海通证券资产管理有限公司
7. 集合计划托管人：交通银行股份有限公司
8. 最后运作日（2025年7月26日）集合计划份额总额：26,933,343.44份
9. 最后运作日（2025年7月26日）集合计划资产净值：18,394,198.44元

## 三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2025年7月26日

单位：人民币元

项目	2025年7月26日 (最后运作日)
资产：	
货币资金	11,591,755.12
结算备付金	46,293.42
存出保证金	15,232.45
交易性金融资产	286,000.00
应收清算款	8,106,364.18
应收股利	34,393.11
资产总计	<b>20,080,038.28</b>
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	1,638,210.77
应付管理人报酬	11,495.76
应付托管费	1,724.37
应付销售服务费	256.10
应付税费	29,738.23
其他负债	4,414.61
负债合计	<b>1,685,839.84</b>
所有者权益：	
实收基金	26,933,343.44
未分配利润	-8,539,145.00
所有者权益合计	<b>18,394,198.44</b>
负债和所有者权益总计	<b>20,080,038.28</b>

注： 报告截止日2025年7月26日，集合计划份额总额26,933,343.44份，其中海通红利优选A份额净值（暂估业绩报酬前）0.6835元，份额总额8,027,293.29份，资产净值（暂估业绩报酬前）5,486,323.37元，相关暂估业绩报酬余额489.04元，资产净值（暂估业绩报酬后）5,485,834.33元。海通红利优选B份额净值（暂估业绩报酬前）0.6835元，份额总额17,869,067.48份，资产净值（暂估业绩报酬前）12,213,324.51元，相关暂估业绩报酬余额0.00元，资产净值（暂估业绩报酬后）12,213,324.51元。海通红利优选C份额净值（暂估业绩报酬前）0.6698元，份额总额1,036,982.67份，资产净值（暂估业绩报酬前）694,550.56元，相关暂估业绩报酬余额1,717.17元，资产净值（暂估业绩报酬后）692,833.39元。暂估业绩报酬为假设本集合计划于本报告期末按照当日的集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据集合计划份额持有人持有的集合计划份额（包括未到期份额）至该日持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该暂估业绩报酬余额是各集合计划份额持有人于期末时点的暂估业绩报酬的合计，各集合计划份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

## 四、清算事项说明

### 1、集合计划基本情况

本集合计划变更自原大集合“海通海蓝内需价值优选集合资产管理计划”（以下简称“原集合计划”）。原集合计划为非限定性集合资产管理计划，于2010年11月11日经中国证监会证监许可（2010）1589号核准设立，自2010年12月28日起开始募集并于2011年1月28日结束募集，于2011年2月10日成立。本集合计划于2021年6月17日经中国证监会《关于准予海通海蓝内需价值优选集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]1856号）批准，《资产管理合同》于2021年7月27日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自《资产管理合同》变更生效日起存续期至2025年7月26日。本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，托管人为交通银行股份有限公司。

本集合计划根据申购/赎回规则、申购费用、赎回费用、销售服务费、业绩报酬收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别。

**A类份额：**在投资人申购时收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费的份额。

**B类份额：**原集合计划份额自《资产管理合同》生效之日起全部自动转换为B类份额。《资产管理合同》生效后，在本集合计划存续期间，管理人仅办理B类份额的赎回业务，不办理申购业务，红利再投资份额除外。对B类份额不设置最短持有期限，根据《资产管理合同》在每个开放日办理赎回业务。

**C类份额：**从本类别集合计划资产中计提销售服务费而不收取申购费用，投资人赎回时根据持有期限收取赎回费用的份额。

本集合计划A类份额和C类份额设置最短持有期限。A类份额和C类份额持有人持有的每份份额最短持有期限为一年，在最短持有期限内该类集合计划份额不可赎回或转换转出。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本集合计划根据法律法规的规定参与融资业务。在法律法规允许的情况下并履行适当程序后，本集合计划可以参与融券业务和转融通证券出借业务。在法律法规允许的情况下，本集合计划可以投资各类期权品种。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。

本集合计划的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占集合计划资产的60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%），投资于本集合计划界定的红利优选相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一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。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

本集合计划的业绩比较基准为中证红利指数收益率×50%+中证港股通高股息指数收益率×20%+中证全债指数收益率×30%。

## 2、清算原因

根据《资产管理合同》“第五部分 集合计划的存续”中的约定：“本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至2025年7月26日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执

行。如本集合计划到期后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合计划份额持有人大会。”

本集合计划《资产管理合同》自2021年7月27日起生效，存续期至2025年7月26日。存续期届满后，本集合计划应当终止，并无需召开集合计划份额持有人大会。终止后本集合计划进入清算程序。

### 3、清算开始日

根据《海通红利优选一年持有期混合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2025年7月27日起进入清算期，故本集合计划清算开始日为2025年7月27日。

### 4、清算财务报表的编制基础

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、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。

## 五、清算情况

自2025年7月27日至2025年8月11日止的本次清算期间，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，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：

### 1、资产处置情况

(1) 本集合计划最后运作日货币资金为人民币11,591,755.12元，其中存放于托管账户人民币11,590,529.07元，应计银行存款利息人民币1,226.05元。上述应计银行存款利息将于2025年8月11日后划入托管账户。

(2) 本集合计划最后运作日结算备付金为人民币46,293.42元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币28,696.26元，应计结算备付金利息人民币11.27元；其中存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的结算备付金人民币17,482.15元，应计结算备付金利息人民币9.69元；应计港股通备付金利息人民币94.05元。上述款项中，结算备付金人民币7,325.02元已于2025年8月8日划入托管账户，剩余款项及应计结算备付金利息将于2025年8月11日后划入托管账户。

(3) 本集合计划最后运作日存出保证金为人民币15,232.45元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金人民币6,520.30元，应计存出保证金利息人民币2.27

元；其中存放于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的存出保证金人民币8,706.49元，应计存出保证金利息人民币2.99元；应计沪港通风控资金利息人民币0.40元。上述款项中存出保证金本金已于2025年8月4日划入托管账户，应计存出保证金利息将于2025年8月11日后划入托管账户。

(4) 本集合计划最后运作日交易性金融资产为人民币286,000.00元，已于清算期间全部处置变现。

(5) 本集合计划最后运作日港股通应收股利为人民币34,393.11元。部分港股通应收股利已于清算期间到账。前述港股通应收股利在本次清算期期末余额为人民币24,563.40元，该款项将于2025年8月11日后划入托管账户。

(6) 本集合计划最后运作日应收清算款为人民币8,106,364.18元，该款项已于清算期间划入托管账户。

## 2、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1,638,210.77元，该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11,495.76元，其中应付管理费为人民币11,495.75元，应付业绩报酬为人民币0.01元，该款项已于清算期间支付。

(3) 本集合计划最后运作日应付托管费为人民币1,724.37元，该款项已于2025年8月1日支付。

(4) 本集合计划最后运作日应付销售服务费为人民币256.10元，该款项已于2025年8月1日支付。

(5) 本集合计划最后运作日应付税费为人民币29,738.23元，该款项已于2025年8月1日支付。

(6) 本集合计划最后运作日其他负债为人民币4,414.61元，其中应付交易费用人民币4,394.61元，预提汇款费人民币20.00元，部分费用已于清算期间支付。截至清算结束日其他负债为人民币15.00元，其中预提汇款费人民币15.00元。

## 3、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2025年7月27日(清算开始日)至2025年8月11日(清算结束日)止期间
一、收入	-19,236.37
1、利息收入(注1)	2,754.13
2、投资收益(损失以“-”填列)(注2)	37,401.53
3、公允价值变动损益(损失以“-”填列)(注3)	-59,392.22
4、其他收入(损失以“-”填列)(注4)	0.19
减：二、费用	139.64
1、管理人报酬(注5)	4.33
2、税金及附加(注6)	135.31
三、利润总额	-19,376.01
四、净收益	-19,376.01

注 1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2025年7月27日至2025年8月11日止清算期间的利息收入，其中银行存款利息人民币2,746.08元、结算备付金利息人民币6.92元和存出保证金利息人民币1.13元。上述款项将于2025年8月11日之后划入托管账户。

注 2：投资收益系清算期间股利收益和卖出股票事项所致。其中，股利收益为人民币-5.36元，卖出股票差价收入(卖出股票成交金额减去所卖出股票的初始投资成本)为人民币38,715.00元，因卖出股票而支付的增值税人民币1,127.62元以及卖出股票产生的交易费用人民币180.49元作为投资收益的扣减项。

注 3：公允价值变动损益系清算期间处置交易性金融资产事项所致，为原计入交易性金融资产的公允价值变动转出至投资收益的金额。

注 4：其他收入系集合计划赎回费归入集合计划资产的收入。

注 5：管理人报酬系最后运作日前一工作日(2025年7月25日)申请赎回，于申请日后顺延一个工作日(2025年7月28日)确认赎回收取的业绩报酬人民币4.33元。

注 6：税金及附加系清算期间因卖出股票产生的附加税费，其中城市维护建设税人民币78.93元、教育费附加人民币33.83元和地方教育附加人民币22.55元。

#### 4、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	2025年7月27日(清算开始日)至2025年8月11日(清算结束日)止期间

一、2025年7月26日(最后运作日)集合计划净资产	18,394,198.44
加：清算期间净收益(净损失以“-”号填列)	-19,376.01
确认赎回导致的净资产变动(赎回以“-”号填列)	-289,253.15
二、2025年8月11日(清算结束日)集合计划净资产	18,085,569.28

根据本集合计划的《资产管理合同》及《海通红利优选一年持有期混合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》，将依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，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。

最后运作日后确认的赎回导致的净资产变动金额为人民币289,253.15元，由在最后运作日前一工作日(2025年7月25日)申请赎回的款项人民币289,253.15元构成，于申请日后顺延一个工作日(2025年7月28日)确认赎回。

资产处置及负债清偿后，本集合计划截至2025年8月11日止的剩余财产为人民币18,085,569.28元。

截至2025年8月11日止，经集合计划管理人以及集合计划托管人确认，本集合计划托管账户银行存款(不含应计利息)余额共计人民币18,018,066.65元。

自清算期结束日次日(2025年8月12日)至清算款划出前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息和港股通应收股利亦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，集合计划管理人将先行垫付尚未收回的结算备付金及其应计利息、应计存出保证金利息、应计银行存款利息和港股通应收股利供清盘分配使用，集合计划管理人垫付资金到账日起孳生的利息归集合计划管理人所有。

## 5、集合计划财产清算报告的告知安排

本清算报告已经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，报中国证监会备案后向集合计划份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

- (1) 《海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划清算审计报告》；
- (2) 上海市通力律师事务所关于《海通红利优选一年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

集合计划管理人的办公场所。

### 3、查阅方式

投资者可在营业时间内至集合计划管理人的办公场所免费查阅。

海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划集合计划财产清算小组

2025年08月11日