

东证融汇成长优选混合型集合资产管理 计划清算报告

管理人：东证融汇证券资产管理有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二五年五月十四日

报告公告日期：二〇二五年五月十六日

一、重要提示

东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由东北证券3号主题投资集合资产管理计划变更而来。根据中国证券监督管理委员会(以下简称“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》(证监会公告[2018]39号)规定,中国证监会已批准东北证券3号主题投资集合资产管理计划变更为本集合计划。经中国证监会批准,自2021年11月8日起,“东北证券3号主题投资集合资产管理计划”正式变更为“东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划”。本集合计划为大集合产品,系管理人依据《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》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划。本集合计划管理人为东证融汇证券资产管理有限公司,托管人为中国建设银行股份有限公司。

《东证融汇成长优选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》”)中关于集合计划存续期限约定,“本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续至2025年5月13日。本集合计划自2025年5月13日后,按照中国证监会相关规定执行。2025年5月13日后,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”。东证融汇证券资产管理有限公司依据法律法规的规定及《资产管理合同》的约定履行财产清算程序并终止《资产管理合同》,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2025年5月13日。

本集合计划于2025年5月14日进入清算程序,由本集合计划管理人东证融汇证券资产管理有限公司、集合计划托管人中国建设银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所组成集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序,并由安永华明会计师事务所(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	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划
--------	---------------------

集合计划简称	东证融汇成长优选	
集合计划主代码	970073	
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 11 月 08 日	
集合计划管理人	东证融汇证券资产管理有限公司	
集合计划托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属各类份额的简称	东证融汇成长优选 A	东证融汇成长优选 C
下属各类份额的交易代码	970073	970074
最后运作日（2025 年 5 月 13 日）集合计划份额总额	32,545,241.74 份	
最后运作日（2025 年 5 月 13 日）下属各类份额总额	22,582,185.84 份	9,963,055.90 份
投资目标	本集合计划通过优选具有高成长性的股票，严格控制组合风险，力争实现稳定超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本集合计划采用多因子量化模型，以成长因子为主，辅之以估值、盈利质量、分析师预期等基本因子，优选具有高成长性的股票构成投资组合，此外通过量化手段严格控制组合风险，力争实现稳定超越业绩基准的投资回报。1、股票投资策略，本集合计划股票组合的构建包括多因子模型和组合优化模型两个部分；2、债券投资策略，基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、同业存单，投资的目的是保证集合资产流动性，有效利用集合计划资产，提高集合计划资产的投资收益，此外，将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合；3、现金类资产投资策略，在控制风险的前提下，通过对政策调控和资金面的精确把握，结合股票和债券资产的动态配置，并充分考虑集合计划资产的流动性要求，获得现金类资产的稳定收益，同时为集合计划的动态资产配置提供有效的缓冲；4、金融衍生品投资策略，本集合计划将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货、国债期货等金融衍生品的投资，股票期权为本集合计划辅助性投资工具；5、资产支持证券等品种投资策略，资产支持证券定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本集合计划将深入分析上述基本面因素，并辅助数量化定价模型，评估其内在价值。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*90%+银行活期存款利率（税后）*10%	
风险收益特征	本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票型集合计划。	

三、集合计划最后运作日财务会计报告（经审计）

资产负债表

会计主体：东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划

报告截止日：2025年5月13日（集合计划最后运作日）

单位：人民币元

	最后运作日 2025年5月13日
资 产：	
货币资金	62,294,772.26
结算备付金	2,101,722.24
存出保证金	50,613.07
资产总计	64,447,107.57
负 债：	
应付赎回款	20,256,150.82
应付管理人报酬	63,221.44
应付托管费	10,536.91
应付销售服务费	9,606.68
应交税费	110,218.06
其他负债	210,347.86
负债合计	20,660,081.77
净资产：	
实收基金	32,545,241.74
未分配利润	11,241,784.06
净资产合计	43,787,025.80
负债和净资产总计	64,447,107.57

注：截至集合计划最后运作日2025年5月13日，集合计划A类份额单位净值1.3966元，份额总额22,582,185.84份；集合计划C类份额单位净值1.2294元，份额总额9,963,055.90份。集合计划份额总额合计为32,545,241.74份。

四、清算说明

本集合计划清算期为2025年5月14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“资产管理合同的变更、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货币资金为人民币62,294,772.26元，其中存放于托管账户人民币62,282,745.02元，应计银行存款利息人民币12,027.24元。截至2025年5月14日，货币资金为人民币42,039,461.97元，其中存放于托管账户人民币42,026,594.20元，应计银行存款利息人民币12,867.77元。

(2) 本集合计划最后运作日的结算备付金为人民币2,101,722.24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839,707.24元，应计结算备付金利息人民币230.93元；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1,261,515.13元，应计结算备付金利息人民币268.94元。截至2025年5月14日，结算备付金为人民币2,101,742.66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839,707.24元，应计结算备付金利息人民币239.09元；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1,261,515.13元，应计结算备付金利息人民币281.20元。

(3) 本集合计划最后运作日的存出保证金为人民币50,613.07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19,210.58元，应计存出保证金利息人民币11.20元；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31,372.79元，应计存出保证金利息人民币18.50元。截至2025年5月14日，存出保证金为人民币50,613.57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19,210.58元，应计存出保证金利息人民币11.39元；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31,372.79元，应计存出保证金利息人民币18.81元。

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 20,256,150.82 元，该款项已于2025年5月14日完成支付。

（2）本集合计划最后运作日应付管理人报酬为人民币 63,221.44 元，该款项将于2025年5月14日后支付。

（3）本集合计划最后运作日应付托管费为人民币10,536.91 元，该款项将于2025年5月14日后支付。

（4）本集合计划最后运作日应付销售服务费为人民币9,606.68元，该款项将于2025年5月14日后支付。

（5）本集合计划最后运作日应交税费为人民币110,218.06元，该款项将于2025年5月14日后支付。

（6）本集合计划最后运作日其他负债为人民币210,347.86元，包括应付交易费用、预提审计费、预提信息披露费。本集合计划最后运作日应付交易费用为人民币188,213.40元，该款项将于2025年5月14日后支付；本集合计划最后运作日预提审计费为人民币4,737.46元，该款项将于2025年5月14日后支付；本集合计划最后运作日预提信息披露费为人民币17,397.00元，该款项将于2025年5月14日后支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元	
项目	2025年5月14日
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	861.45
清算收益小计	861.45
二、清算费用	
清算费用小计	0.00
三、清算净收益（净损失以“-”号填列）	861.45

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的2025年5月14日的利息收入，其中银行存款利息人民币840.53元、结算备付金利息人民币20.42元和存出保证金利息人民币0.50元。上述利息将于下一结息日之后划入托管账户。经集合计划管理人确认，如截至划付清算款前一日仍有未变现的资产（银行存款利息、结算备付金及其利息、存出保证金及其利息），将由集合计划管理人以自有资金先行垫付，垫付资金将于划付清算款前划入本集合计划托管账户。

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5月13日集合计划净资产	43,787,025.80
加：清算期间净收益（净损失以“-”号填列）	861.45
减：集合计划净赎回转出金额 （于2025年5月14日确认的投资者赎回转出申请）	4,923,442.10
二、2025年5月14日集合计划净资产	38,864,445.15

截至2025年5月14日，应付赎回款为人民币4,923,442.10元，该款项将于2025年5月14日后支付。

资产处置及负债清偿后，截至2025年5月14日本集合计划总资产为人民币44,191,818.20元，净资产为人民币38,864,445.15元，根据本集合计划的《资产管理合同》约定，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。

2025年5月14日至清算款实际划出日前一日的收益归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，管理人东证融汇证券资产管理有限公司将以自有资金先行垫付该笔款项，实际结息金额与垫付金额的尾差由管理人承担，管理人垫付资金到账日起孳生的利息归管理人所有。

截至2025年5月14日，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42,026,594.20元。

6、财产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本集合计划份额持有人公告。清算报告公告后，管理人将遵照法律法规、《资产管理合同》等规定及时分配。

五、备查文件

1、备查文件目录

(1) 《东证融汇成长优选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《东证融汇成长优选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

上海市浦东新区杨高南路729号陆家嘴世纪金融广场1号楼37层。

3、查阅方式

投资者可到管理人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。

东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划集合计划财产清算小组

二〇二五年五月十四日