

# 东证融汇汇享 5 号集合资产管理计划 2020 年年度报告

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：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年三月三十日

## 重要提示

本报告依据《中华人民共和国证券法》（中华人民共和国主席令第14号，以下简称《证券法》）、《中华人民共和国证券投资基金法》（中华人民共和国主席令第23号，以下简称《基金法》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发[2018]106号，以下简称《指导意见》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第151号]，以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31号，以下简称《运作管理规定》）及其他有关规定由集合资产管理计划管理人编制。

管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

管理人、托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

集合资产管理计划托管人宁波银行股份有限公司复核了本报告中的投资表现、投资组合报告、财务会计报告等内容，认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中准会计师事务所（特殊普通合伙）出具了本集合计划2020年度审计报告。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期间：2020年1月1日至2020年12月31日。

## 一、集合资产管理计划概况

- 名称: 东证融汇汇享5号集合资产管理计划
- 类型: 集合资产管理计划
- 成立日: 2019年12月20日
- 报告期末份额总额: 52,347,249.45份
- 存续期: 10年
- 投资目标: 在充分考虑集合计划投资安全的基础上,以宏观经济和资产配置研究为导向,在有效控制风险的前提下,为集合计划份额持有人获取稳定的投资收益。
- 投资策略: 1、债券等固定收益类投资策略  
集合计划的固定收益类投资品种主要有政府债券、企业债等中国证监会认可的金融工具。在适度保持本集合计划流动性的基础上获得稳定的收益。  
管理人对宏观经济和未来市场利率水平的分析,动态调整投资组合的平均久期;在此基础上,通过对债券市场收益率期限结构进行分析,对不同期限的债券进行配置;对于不同期限不同类型的债券,将根据信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素选择投资品种;在确定投资品种后,通过对债券市场收益率期限结构的分析,确定各债券品种的配置比例。
- 2、可转换债券投资策略  
先分别计算纯债部分理论价值与含权部分的理论价值,从而得到可转债的理论价值,然后结合正股基本面因素、市场可转债溢价率因素判断其价值。选择具有良好盈利能力和成长前景的上市公司的可转债,并进行重点投资。基于资金安全性的考虑,本集合计划也关注转债的纯债券价值和转股溢价的平衡,选择有一定债券价值支撑、转股溢价适中的品种。
- 3、基金投资策略  
本计划对各类证券投资基金进行精选,积极主动选取具有核心竞

争优势的证券投资基金。

#### 4、现金类管理工具投资策略

本集合计划将投资于现金、银行存款（包括银行定期存款、协议存款、同业存款）、货币市场基金、债券逆回购、到期日在1年内（含1年）的政府债券、到期日在1年内（含1年）的央行票据等高流动性短期金融产品来保障资产的安全性和流动性。

#### 5、国债期货投资策略

本集合计划投资国债期货仅限于对冲所投资的固定收益类资产现货价值，以套期保值为目的，以更好的实现本集合计划的投资目标。

管理人：东证融汇证券资产管理有限公司  
托管人：宁波银行股份有限公司  
注册登记机构：东证融汇证券资产管理有限公司

## 二、管理人履职报告

### （一）履职报告

报告期内，管理人根据《东证融汇汇享5号集合资产管理计划资产管理合同》履行管理人职责，以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用委托资产。管理人对本资管计划配备了具有专业能力的人员进行运作管理，以专业化的经营方式管理和运作委托资产；为委托人建立业务台账，按照《证券投资基金会计核算业务指引》等相关规则进行会计核算，与托管人定期对账，及时准确办理委托资产的清算交收，并编制产品财务会计报告；妥善保存受托财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

### （二）投资经理简介

余冠蓉女士，兰州大学经济学学士，佩斯大学投资管理学硕士，2014年开始从事证券行业相关工作，有丰富的固收类投资组合管理经验，擅长深挖主体信用并有效搭配杠杆与久期，为组合赚取最大收益。2014年6月至2015年6月，在财通证券资产管理有限公司固定收益部担任产品经理，2015年8月至2017年9月在财通证券资管资产管理有限公司担任投资经理助理，2017年10月至2019

年3月在财通证券资产管理有限公司担任投资经理。2019年4月至2020年8月在红塔证券股份有限公司固定收益部担任投资经理。于2020年9月加入东证融汇证券资产管理有限公司，现任职东证融汇固定收益总部副总经理、投资经理。截至报告期末，余冠蓉女士担任东北证券固定收益融通宝1号、2号、5号集合资产管理计划、东证融汇固定收益融通宝9号、12号集合资产管理计划、东北证券融达9号、10号集合资产管理计划、东证融汇融达11号、31号、32号集合资产管理计划、东证融汇汇享1号、2号、3号、5号、21号、22号、23号、24号、26号、28号、29号、30号、32号、34号、35号、36号、37号、39号、60号、61号集合资产管理计划、东证融汇汇赢1号、2号、3号、5号、7号、8号集合资产管理计划、东证融汇汇聚1号集合资产管理计划、东证融汇融泰6号、11号单一资产管理计划和东证融汇融泰24号固定收益单一资产管理计划投资经理。

李雯君女士，中国科学技术大学金融学和理学双学士，2010年开始从事金融行业相关工作，具有丰富的固定收益市场研究经验。2010年9月至2012年11月，在上海银叶投资有限公司任职投资助理，负责债券研究、交易工作。2012年12月至2017年5月，在上海恒基浦业资产管理有限公司担任债券投资经理，从事债券投资、研究以及组合管理工作。2017年6月加入东证融汇证券资产管理有限公司。截至报告期末，李雯君女士担任东北证券固定收益融通宝1号、2号、5号集合资产管理计划、东证融汇固定收益融通宝9号、12号集合资产管理计划、东北证券融达9号、10号集合资产管理计划、东证融汇融达11号、31号、32号集合资产管理计划、东证融汇汇享1号、2号、3号、5号、21号、22号、23号、24号、26号、28号、29号、30号、32号、34号、35号、36号、37号、39号、60号、61号集合资产管理计划、东证融汇汇赢1号、2号、3号、5号、7号、8号集合资产管理计划、东证融汇汇聚1号集合资产管理计划、东证融汇融泰6号、11号单一资产管理计划和东证融汇融泰24号固定收益单一资产管理计划投资经理。

### （三）投资经理工作报告

#### 1、市场及投资回顾

2020年债券市场收益率先下后上，全年整体上行且利率波动较大。全年来看，

期限利差缩窄，收益率曲线平坦化上行。

2020年初受疫情因素影响，债市走出快牛行情。年初新冠疫情爆发造成社会经济全面停滞，全球范围内货币政策大放水，避险资产价格上涨，叠加资金面极度宽松，利率快速下行，收益率曲线走出牛陡态势，1年期和10年期国债收益率大幅下行。进入5月，流动性收紧，收益率“V”形反转。随着国内疫情逐步得到控制，基本面呈现企稳态势，但市场对货币政策保持宽松仍抱有期待。5月初货币政策边际收紧，超出市场预期，债券市场调整剧烈，短端上行幅度更大，收益率曲线转为熊平。股市7月初快速上涨，风险偏好提高进一步对债市形成压制，10年期国债收益率回调到了2.97%，接近春节前的水平。

三季度，债市持续承压。随着基本面数据持续修复，货币市场利率围绕政策利率波动。受银行压缩结构性存款等因素影响，银行负债端压力增大，缺乏长期资金，存单发行利率持续保持高位，债券市场收益率继续震荡上行，长短端利率均调整至年初水平以上，其中短端债券收益率上行幅度更大。

临近年末，受信用风险事件冲击和政策维稳影响，收益率先上后下。11月中旬，永煤突然违约超出市场预期，信用担忧的情绪快速扩散，期间10年期国债收益率达到了3.35%的年内最高水平。随后央行超额投放流动性，临近年底隔夜资金利率再次回到极低的水平，存单利率从高点回落，债券收益率曲线陡峭化下行，10年期国债收益率回到了年初的水平。

信用债方面，2020年信用债市场跟随利率债波动，经历了收益率下行后上行的过程。信用利差与利率走势有所背离，利差先走扩后有所压缩。年初在疫情影响下流动性极度宽松，利率债下行速度明显快于信用债收益率，企业生产和盈利显著受到不利影响，导致信用利差被动走扩。5月以来，流动性边际收紧但仍然维持宽松，投资者对信用债配置增强，信用利差开始收窄。11月以来，华晨和永煤相继违约，打破国企信仰，导致市场信用风险偏好下降，信用利差再度走阔，尤其是低等级信用债利差上行幅度较大。信用违约方面，2020年，违约债券总规模继续攀升，其中，地方国企和央企的违约规模较去年显著提升，两者合计占今年总违约规模的约51%。

操作上,在 2020 年运作期内,本计划在优选个券的前提下,继续坚持短久期的防御型策略,并通过波段交易,博取资本利得收益。

## 2、市场展望及投资策略

当前较为乐观的流动性预期可能回归中性,反向交易可能更为合理。2020 年市场对流动性的预期出现了 3 次预期差,主要的原因在于市场对于流动性的预期往往是当下流动性的线性外推并容易自我强化。11 月下旬以来,央行超量续作 MLF,维稳资金面,市场对于流动性的预期趋于乐观。但从央行 3 季度货币政策执行报告和中央经济工作会议的表述来看,货币政策基调整体偏稳,“不急转弯”并不意味着维持宽松。拉长时间来说,资金利率大概率回到政策利率附近,届时市场仍可能出现流动性的预期差,反向交易可能更为合理。2021 年一季度拟在本计划账户加入国债期货的操作,应对流动性可能逐渐收紧对资产的冲击,让账户更加多维,增强稳定性。

考虑到稳定宏观杠杆率、经济结构转型的需要,以及中长期经济增长中枢和利率中枢大概率下台阶,债市资金向股市搬家是中长期大趋势。国常会调高险资配权益资产的比重,证监会提出“促进居民储蓄向投资转化,助力扩大内需”等政策也进一步巩固了这一趋势。在极端情况下债市资金可能加速流向股市,进而冲击债市。届时信用违约事件仍有可能扰动利率债市场,2021 年社融增速大概率下行,信用逐步收缩的背景下,弱资质信用主体的风险可能逐步暴露。若出现超预期的信用违约事件冲击,仍有可能出现非银机构借钱难度上升、负债端不稳的情况,进而导致流动性较好的利率债遭到抛售。

2021 年拟调整持仓债券久期,留波动较小短债作为底层资产,继续保持低杠杆抵御或有的流动性冲击。静待政策信号,债券市场回暖的预期后,拟逐步增加杠杆,致力提升账户收益。

## 3、国债期货投资情况

报告期内,本计划基于谨慎原则运用国债期货对投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险、提高投资效率,从而更好地实现本计划的投资目标。截止期末,本计划未参与国债期货投资,亦无国债期货持仓头寸。报告期内国债期货

投资符合既定的投资目的，国债期货投资对集合资产管理计划总体风险影响较小。

### 三、投资表现

本集合计划在 2019 年 12 月 20 日成立。截止 2020 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 1.0005 元，累计单位净值 1.0600 元。报告期内单位净值增长率 6.14%。

### 四、投资组合报告

#### (一) 期末资产组合情况

项目名称	项目市值(元)	占总资产比例(%)
银行存款	498,929.81	0.87
债券投资	55,670,387.48	97.02
应收利息	1,208,116.31	2.11
合计	57,377,433.60	100.00

注：本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差

#### (二) 期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

注：本集合计划报告期末未持有股票。

#### (三) 期末市值占集合计划资产净值前五名债券明细

序号	代码	债券名称	数量	市值(元)	占净值比例(%)
1	150920	18 兴化 01	130,000.00	13,129,350.00	25.07
2	167017	20 尧投 01	120,000.00	12,000,000.00	22.91
3	177373	20 渭南债	90,000.00	9,000,000.00	17.18
4	162078	19 海兴 02	70,000.00	7,104,510.00	13.57
5	118631	16 浙太湖	40,000.00	4,006,285.48	7.65

#### (四) 期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

注：本集合计划报告期末未持有基金。

#### (五) 期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

注：本集合计划报告期末未持有权证。

#### (六) 投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未到受到公开谴责、处罚。

## 五、集合计划财务报表

(一) 本报告期末集合计划资产负债表

单位：元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
<b>资 产：</b>		<b>负 债：</b>	
银行存款	498,929.81	短期借款	0.00
结算备付金	0.00	交易性金融负债	0.00
存出保证金	0.00	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	55,670,387.48	卖出回购金融资产款	4,900,000.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	55,670,387.48	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付赎回费	0.00
权证投资	0.00	应付管理人报酬	74,626.66
资产支持证券投资	0.00	应付托管费	3,731.35
衍生金融工具	0.00	应付投资咨询费	0.00
买入返售金融资产	0.00	应付交易费用	0.00
应收证券清算款	0.00	应交税费	10,252.20
应收利息	1,208,116.31	应付利息	2,134.53
应收股利	0.00	应付利润	0.00
应收申购款	0.00	其他负债	13,000.00
其他资产	0.00	<b>负债合计</b>	<b>5,003,744.74</b>
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	52,347,249.45
		未分配利润	26,439.41
		<b>持有人权益合计</b>	<b>52,373,688.86</b>
<b>资产合计</b>	<b>57,377,433.60</b>	<b>负债及持有人权益总计</b>	<b>57,377,433.60</b>

(二) 本报告期末集合计划经营利润表

单位：元

序号	项目	本年累计数
1	一、收入	2,370,919.97
2	1、利息收入	2,361,358.95
3	其中：存款利息收入	4,087.63
4	债券利息收入	2,354,404.49
5	资产支持证券利息收入	0.00
6	买入返售证券收入	2,866.83
7	2、投资收益	9,561.02
8	其中：股票投资收益	0.00

9	债券投资收益	4,410.00
10	基金投资收益	0.00
11	权证投资收益	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00
13	衍生工具收益	0.00
14	其他投资收益	0.00
15	股利收益	7,809.08
16	投资收益增值税抵减	-2,658.06
17	3、公允价值变动收益	0.00
18	4、其他收入	0.00
19	二、费用	263,907.22
20	1、管理人报酬	188,551.71
21	2、托管费	9,427.58
22	3、增值税及附加	8,805.14
23	4、销售服务费	0.00
24	5、交易费用	160.86
25	6、利息支出	43,961.93
26	其中：卖出回购金融资产支出	43,961.93
27	7、其他费用	13,000.00
28	三、利润总和	2,107,012.75

## 六、运用杠杆情况

截至本报告期末，本集合计划无分级安排，本集合计划总资产占净资产的比例为109.55%。

## 七、费用的计提基准、计提方式和支付方式

### （一）管理费

本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为0.5%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / 365$$

H 为每日应支付的管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

管理人的管理费每日计提，逐日累计，每季度支付一次，由托管人于每季度初前5个工作日内或本集合计划终止日后5个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## （二）托管费

本集合计划应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为【0.025】%。计算方法如下：

$$H = E \times 【0.025】\% / 365$$

H 为每日应支付的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计提，逐日累计，本集合计划每季度支付一次，由托管人于每季度初前5个工作日内或本集合计划终止日后5个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## （三）证券交易费用

本集合计划应按规定比例支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、结算费等费用。

本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定。在每季度首日起10个工作日内支付给提供交易单元的券商。

## （四）集合计划注册登记费用（如有）

注册与过户登记人收取的TA系统月度服务费、登记结算费相关费用在支付当期列支。

## （五）其他费用

与集合计划相关的审计费、银行结算费用、银行账户维护费、开户费等集合计划运营过程中发生的相关费用、在存续期间发生的信息披露费用、律师费以及如果国家有关规定调整可以列入的其他费用，在集合计划费用中按有关规定列支。

在存续期间发生的审计费用，在合理期间内按直线法在每个自然日内平均摊销；

银行结算费用在实际收取时计入当期费用；

开户费、银行账户维护费、在存续期间发生的集合计划信息披露费用、律师费在发生时一次计入集合计划费用。

与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，必须在该会计期间内按直线法摊销。

#### （六）管理人的业绩报酬

##### 1、管理人收取业绩报酬的原则

（1）按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；

（2）在符合业绩报酬计提条件时，在计划分红日、投资者退出日和计划终止日计提业绩报酬，上述时间节点记为业绩报酬计提日；如不符合业绩报酬计提条件，计划分红日仍记为业绩报酬计提日，管理人计提的业绩报酬为零；

（3）在计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；

（4）在投资者退出和计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

（5）在投资者退出和计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额和计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该部分参与份额视为一笔参与份额进行核算。

（6）管理人提取业绩报酬频率不超过每 6 个月一次，因投资者退出本集合计划，管理人按照合同约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率限制。

##### 2、业绩报酬的计提方法

以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，申购参与份额的业绩报酬计提日为申购参与当日，下同。）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{A - B}{C \times D} \times 100\%$$

业绩报酬计提日为计划分红日、投资者退出日或计划终止日；

A=业绩报酬计提日的累计单位净值；若本次业绩报酬计提日之前或当日发生了份额折算，则 A 为复权后的业绩报酬计提日的累计单位净值。

B=上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；若上一个业绩报酬计提日之前或

当日发生了份额折算，则 B 为复权后的上一个业绩报酬计提日的累计单位净值。

C=上一个业绩报酬计提日的单位净值；若上一个业绩报酬计提日之前或当日发生了份额折算，则 C 为复权后的单位净值。

D=上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限。

R=年化收益率，以四舍五入的方法保留至小数点后四位。

若投资者该笔份额参与期间的年化收益率（R）低于或等于该笔委托资产对应的业绩报酬计提基准（K），则不计提业绩报酬。

若投资者该笔份额参与期间的年化收益率（R）高于该笔委托资产对应的业绩报酬计提基准（K），则按超额收益的 60%计提比例计算业绩报酬。

每个封闭期开始之前，管理人通过指定官网公告本集合计划当期（含该封闭期和该封闭期结束后的开放期）的业绩报酬计提基准（年化）。

此时业绩报酬计算公式：

$$E=(R-K) \times 60\% \times (F/365) \times P2 \times M$$

注：E 表示每笔参与份额应计提的业绩报酬，M 表示投资者每笔参与在上一个业绩报酬计提日对应的集合计划份额，若上一个业绩报酬计提日之前或当日发生了折算，则 M 为复权后上一个业绩报酬计提日对应的集合计划份额。

P2 表示上一个业绩报酬计提日的单位净值，若上一个业绩报酬计提日之前或当日发生了折算，则 P2 为复权后的单位净值。

F 表示上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的持有天数。

3、本集合计划的业绩报酬计提基准参照当期债券市场利率水平、货币市场基金平均收益率及集合计划费率确定

当期债券市场利率水平：根据集合计划投资范围、投资限制、投资策略及当期市场主要债券及其他固定收益品种的利率水平，通过研究分析确定。

货币市场基金平均收益率：根据集合计划开放当月主要货币市场基金平均七天年化收益率确定。

集合计划费率：根据集合计划托管费、管理费、审计费用等集合计划合同中约定的费用以及从集合计划资产中缴纳的税费估算。

该业绩报酬计提基准仅作为业绩报酬计算的基准，供投资者的参考，不作为实际收益分配的依据，管理人未对本集合计划的收益作出任何承诺或保证。

如果今后市场中有其他代表性更强的业绩报酬计提基准,或者有更科学客观的权重比例适用于本集合计划时,本集合计划管理人可以依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩报酬计提基准进行相应调整。

#### (七) 资产管理计划的税收

合同各方当事人应根据国家法律法规规定,履行纳税义务。

投资者缴纳必须由其自行缴纳的税费,管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

依据相关法律法规或税务机关的认定,本集合计划投资及运营过程中发生增值税(含附加税费)等应税行为,以管理人为纳税人或由管理人代扣代缴的,除本集合计划已列明的资产管理业务费用(如管理费、业绩报酬、托管费等)由各收费方自行缴纳外,管理人有权在集合计划资产中计提并以集合计划资产予以缴纳或代扣代缴,且无需事先征得投资者的同意。从集合计划资产中扣缴税费可能导致集合计划税费支出增加、净值和实际收益降低,从而降低投资者的收益水平。

管理人在向投资者交付相关收益或资产后税务机关要求管理人就已交付收益或资产缴纳相关税费的,投资者必须按照管理人要求进行补缴。

投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿管理人以集合计划资产缴纳或代扣代缴、投资者按照管理人要求补缴的税费。

## 八、收益分配情况

本报告期间,本集合计划收益分配金额(不含管理人业绩报酬)为1,958,279.83元。

## 九、风险管理与内部控制制度执行情况

管理人始终把合规管理、风险控制作为必须坚守的底线贯穿于公司的经营发展之中,并根据《证券法》、《基金法》、《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》等相关法律法规和监管部门要求建立了由公司章程、基本制度、管理办法、工作指引四个层级构建的证券资产管理业务内部控制制度体系,涵盖了公司治理、合规管理、风险控制、投资交易、市场营销、产品、运营、信息技术等各个方面。

本报告期内，计划管理人严格按照相关法律法规和公司内部控制制度的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，在严格控制风险的基础上，为计划委托人谋求最大利益。在本报告期内，管理人针对本计划的运作特点，通过风险监控工作以及风险预警机制，及时发现运作过程中可能出现的风险状况，提醒投资经理采取相应的风险规避措施，确保本计划合法合规、正常运行。

在本报告期内，管理人严格按照有关的法律法规、公司内部控制制度的规定和资产管理合同的约定进行投资运作，未发生损害计划委托人利益行为。

## 十、重要事项提示

### （一）本集合计划管理人及托管人相关事项

1、本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

2、本集合计划管理人及托管人办公地址没有发生变更。

3、报告期内，本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到监管部门的行政处罚。

### （二）本集合计划相关事项

1、本报告期内，本集合计划共进行 3 次投资经理变更。同时，我公司向中国证券投资基金业协会备案。

自 2020 年 3 月 9 日起，管理人增加石睿柯先生为本集合计划投资经理，变更后由李雯君女士、石睿柯先生共同担任本集合计划投资经理。

自 2020 年 9 月 11 日起，石睿柯先生不再担任本集合计划投资经理，由李雯君女士独自担任本集合计划投资经理。

自 2020 年 11 月 17 日起，管理人增加余冠蓉女士担任本集合计划投资经理，变更后由余冠蓉女士和李雯君女士共同担任本集合计划投资经理。

2、本报告期内，本集合计划未进行关联交易。

3、本报告期末，管理人其他关联方共持有本集合计划 1,999,800.02 份。

## 十一、备查文件目录及查阅方式

(一) 本集合计划备查文件目录

- 1、《东证融汇汇享5号集合资产管理计划资产管理合同》
- 2、《东证融汇汇享5号集合资产管理计划说明书》
- 3、《东证融汇汇享5号集合资产管理计划风险揭示书》
- 4、《东证融汇关于集合资产管理计划之托管协议》
- 5、管理人业务资格批件、营业执照

(二) 存放地点及查阅方式

查阅地址：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16层

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

客户服务电话：021-20361067

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东证融汇证券资产管理有限公司。

东证融汇证券资产管理有限公司

2021年3月30日