

长江证券超越理财量化精选集合资产管理计划清算报告

一、计划介绍

长江证券超越理财量化精选集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）成立于2012年3月22日，根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》、《长江证券超越理财量化精选集合资产管理计划资产管理合同》等相关规定，为维护委托人利益，管理人于2021年7月30日终止本集合计划并进行了第一次清算。截至2023年7月3日，本集合计划完成部分变现，经本集合计划管理人长江证券（上海）资产管理有限公司（以下简称我公司）和托管人交通银行股份有限公司协商一致，决定以2023年7月3日为基准日进行清算。

二、清算方案

依据本集合计划资产管理合同的有关约定，管理人长江证券（上海）资产管理有限公司会同托管人交通银行股份有限公司、中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）设立本集合计划清算小组。清算小组按照本集合计划资产管理合同约定的清算程序进行清算，清算收入归本集合计划所有，清算费用由本集合计划承担。

清算小组于2023年7月3日前对本集合计划持有的资产进行了评估和变现，并对各项负债进行了确认和清偿，最终确定了本集合计划剩余资产。本次清算非最终清算，本集合计划中仍存在未变现资产，后续将根据实际情况再次进行清算。清算小组将按照本集合计划剩余资产值及



各持有人的份额比例，确认各持有人分配金额，并以货币的形式分配给本集合计划持有人。

三、清算情况

截至 2023 年 7 月 3 日，本集合计划的资产、负债、实收资本及资产净值情况如下：

1. 资产

- (1) 活期存款 662,796.07 元；
- (2) 债券投资 1,049,055.00 元；
- (3) 应收利息 48.38 元；

2. 负债

- (1) 其他应付款-16 胜通 01 暂收款 401,559.28 元；
- (2) 预提审计费用 6,000.00 元；

3. 实收资本

集合计划持有人总份额 2,721,624.33 份。

4. 资产净值

集合计划资产净值 1,304,340.17 元。

5. 单位净值

集合计划单位净值 0.4793 元。

四、剩余资产分配

本集合计划清算期末剩余净资产 1,304,340.17 元，其中可分配资产

656,796.07 元，预留 56,829.21 元应对可能发生的应付款项，故本集合计划分配资金共计 599,966.86 元，由本集合计划清算小组于 2023 年 7 月 10 日 17 时前通过本集合计划交通银行托管户划付至销售机构的指定收款账户。

资产管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司



(印鉴)

2023年7月6日

产管理有限公司
章

