

东证融汇汇享 37 号集合资产管理计划 季度报告

(2024 年度第一季度)

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：广发银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年四月二十九日

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37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203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[2023]2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（或称为“集合计划”、“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广发银行股份有限公司复核了本报告中的财务指标、投资组合报告等内容，认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期间：2024年1月1日至2024年3月31日。

一、集合资产管理计划概况

- 名称：东证融汇汇享37号集合资产管理计划
- 类型：集合资产管理计划
- 成立日：2019年11月27日
- 报告期末份额总额：121,350,781.40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：广发银行股份有限公司
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 37 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计划资产。管理人对本集合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计划资产；为投资者建立业务台账，按照《资产管理产品相关会计处理规定》、《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，及时准确办理计划资产的清算交收，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。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，现任职公司固定收益总部总经理、投资经理。已取得基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，无兼职工作，未曾被监管机构采取行政监管措施、行政处罚。截至报告期末，余冠蓉女士主要担任公司部分固定收益类资产管理计划的投资经理。

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，现任职公司固定收益总部投资经理。已取得基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，无兼职工作，未曾被监管机构采取行政监管措施、行政处罚。截至报告期末，李雯君女士主要担任公司部分固定收益类资产管理计划的投资经理。

刘新华先生，英国斯旺西大学金融管理硕士，2016年开始从事证券行业相关工作，拥有多年固定收益领域投资、研究和交易经验，擅长把握宏观经济走势和微观信用风险。2016年2月至2017年11月在粤开证券股份有限公司担任债券交易员，2017年11月至2021年3月在浙江浙商证券资产管理有限公司担任债券交易员，于2021年4月加入东证融汇证券资产管理有限公司，目前担任公司固定收益总部投资经理。已取得基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，无兼职工作，未曾被监管机构采取行政监管措施、行政处罚。截至报告期末，刘新华先生主要担任公司部分固定收益类资产管理计划的投资经理。

赵正诚先生，美国约翰霍普金斯大学金融学硕士，2017年开始从事证券行业相关工作，具有丰富的固定收益市场研究经验。2017年12月至2022年2月在西部利得基金管理有限公司担任债券交易员，于2022年3月加入东证融汇证券资产管理有限公司，担任固定收益总部投资助理，现任职公司固定收益总部投资经理。已取得基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，无兼职工作，未曾被监管机构采取行政监管措施、行政处罚。截至报告期末，赵正诚先生

主要担任公司部分固定收益类资产管理计划的投资经理。

（三）投资经理工作报告

1、市场及投资回顾

2024 年一季度债券市场整体偏强运行，在宽松的货币环境和偏弱的经济基本面双重逻辑的主导下，延续着 2023 年“债牛”的行情。

海外方面：去年四季度起，海外激进的降息预期明显消退，10 年美债利率最低跌破 3.8% 关口。而一季度美国经济依然具有韧性，通胀回落并不顺畅，因此海外的宽松预期再次发生摇摆，美指和美债整体呈现宽幅震荡。

国内宏观方面：1-2 月经济数据整体不弱但结构分化特征依然明显，其中工业生产表现强劲，需求端方面，投资好于预期，尤其是制造业和基建投资增速较好，但房地产投资仍显低迷，消费增速略有下滑，地产相关消费偏弱。3 月 PMI 超预期回升且重回荣枯线上方，一方面有季节性因素的影响，另一方面设备更新政策利好及出口较好等均带动制造业景气度回暖，这和 1-2 月经济数据中制造业投资表现亮眼也能相互印证。整体来看，逆周期政策积极发力对经济起到了较好的托底作用，经济开局稳中有升，但地产和消费链条显示出经济内生动能相对不足，经济复苏的弹性和持续性仍需关注。

政策方面：一季度宽货币继续发力，2 月初降准、2 月 LPR 进行了非对称降息、部分中小银行下调存款利率。3 月 5 日-3 月 11 日举行“两会”，会议提出了 2024 年经济社会发展总体要求、宏观政策取向和政府工作重点任务。其中：GDP 增速 5.0%、赤字率 3% 及一万亿特别国债等基本符合预期；积极的财政政策适度加力，同时明确提及货币政策“后续仍然有降准空间”。政府工作报告传递的信息与此前市场预期基本一致，GDP 目标增速设置稳健，兼顾了短期和长期的需求和目标，政策层面稳中有进，一方面托底思路明确，另一方面继续强调高质量发展，没有超预期的强刺激。

市场方面，利率债收益率震荡下行，长端强于短端，曲线扁平化。受到市场对经济复苏节奏的一致预期，配合降准、调降 LPR 等宽松的货币环境，以及年初机构配置力量较为强劲、权益市场走势偏弱等影响，一季度以来利率债收益率整体下行。而临近一季度末，受特别国债发行、权益市场情绪抬头、以及汇率走弱等影响，利率表现为震荡下行。截至 3 月 29 日，10Y 国债收益率为 2.32%，10Y

国开债收益率为 2.40%。

信用债方面，资金面宽松推高加杠杆意愿，机构欠配推进收益率下行，“资产荒”行情延续。近年来财政赤字增量基本由中央财政负担，并通过大规模转移支付等来支持地方保民生等，地方财政压力减轻，并有利于防范地方政府债务风险。考虑到化债的历史任务，城投债供给或持续收缩，且信仰进一步得到加持，进而推进信用利差和期限利差进一步压缩。截至 3 月 29 日，3YAA+企业债收益率为 2.61%，3Y 城投债收益率为 2.64%。

一季度投资策略方面，在“资产荒”背景下，谨慎采取信用下沉策略，债券收益率持续下行，杠杆策略仍有优势。我们重点配置带有票息保护的资产，适度控制资产久期；策略性资产以中高评级或强担保为主要标的，博取期限利差保护下的骑乘收益。同时，通过仓位管理，控制组合整体久期，组合加权久期控制在 2 年以内，及时兑现资本利得。通过票息为主和交易增厚的策略，增强组合抗估值波动的能力。同时，深入调研个券资质，重视通过担保加持信用安全边际，增厚组合收益。

2、市场展望及投资策略

展望二季度债券市场，首先需要关注基本面的持续性，高配数据显示经济复苏略好于预期，但持续性有待观察，情绪转化仍需要数据的支持；其次是关注万亿国债供给压力，考虑到目前地方债发行偏慢，以及早发行早使用的原则，4 月超长国债的供给或将起量，届时需要关注供给的扰动和货币政策的相应配合情况；三是 4 月的政治局会议，整体看政策转向概率不大，或仍是之前政策基调的延续，考虑到目前市场绝对点位偏低，市场对政策行情的博弈或将放大收益率的波动。

利率债方面，一季度延续下行，10Y 国债从年初下行超 20BP，曲线进一步平坦化。短端资金利率、存单利率仍是掣肘长端进一步下行的因素，长债下行空间打开仍需要等待存款利率的新一轮调降。从盘面看目前做多情绪仍在，空头的连续性较差。进入二季度后，随着美国降息预期的强化，央行可能有意识地放贬人民币，国内货币政策整体偏松但空间和力度预计会相对较弱。短期内维持利率品窄幅震荡的观点，并关注通胀和汇率的变化情况。

信用债方面，一季度各期限、各品种收益率持续下行，但是信用利差和期限利差已压缩到历史底部区域。尽管在信用资产荒的大背景下，收益率难有大幅度

的反转，但是极致的利差条件下，不宜过度追求久期收益，需严格防止久期过度错配带来的利率波动风险。

投资策略方面，资产荒行情延续和机构整体风险偏好中枢的下移，债券收益率持续向下，杠杆策略的优势延续。二季度国债很可能迎来更大的供给压力，但对债市影响的关键在于央行数量端工具取向。目前央行态度依然维持中性偏宽松，货币政策有充足的政策空间，后续仍可期待降准、降息等政策工具。需要注意的是，部分交易型机构在当前点位的止盈动机或已逐步增强，有可能和特别国债集中供给形成共振，给债市带来较大扰动。后续我们仍将重点关注带有票息保护的资产，通过仓位管理，控制组合整体久期，组合加权久期拟控制在2年以内，及时兑现资本利得。策略性资产以中高评级或强担保为主要关注标的，以博取期限利差保护下的骑乘收益。与此同时，未来一段时间将择机提高AAA评级的总体持仓占比，适度调整中低等级信用债持仓，不断优化不同评级之间的动态占比，增强组合抗估值波动的能力，进一步提高产品流动性和收益稳定性的平衡，确保在面对未来可能的债市调整中有及时变现的能力和先发制人的优势。

3、国债期货交易情况

报告期内，本计划基于谨慎原则运用期货对投资组合进行管理。报告期内，本计划未参与国债期货交易，截至本报告期末，亦无国债期货持仓头寸。

三、投资表现

本集合计划在2019年11月27日成立。截至2024年3月31日，本集合计划单位净值1.0259元，累计单位净值1.2550元。报告期内单位净值增长率1.69%。

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	648,949.85	0.37
存出保证金	1,681.17	0.00
以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资	175,116,947.44	99.63
合计	175,767,578.46	100.00

注：1、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。

2、债券包括资产支持证券。

(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	032281022	22 慈湖高新 PPN001	200,000.00	20,906,770.49	16.79
2	182705	22 开经 01	200,000.00	20,742,657.53	16.66
3	032300525	23 海州湾 PPN001	200,000.00	20,480,699.45	16.45
4	112304020	23 中国银行 CD020	200,000.00	19,875,005.57	15.97
5	032380569	23 宁乡国资 PPN002	100,000.00	10,706,169.40	8.60

(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) 投资组合报告附注

截至本报告期末，本集合资产管理计划持仓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，在本报告期内也未受到证监会、证券交易所的公开谴责、处罚。

五、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141.19%。

六、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算，逐日累计，每季度支付一次，由托管人于每季度

结束后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，闰年2月29日不计算。

（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【0.05】%。计算方法如下：

$$H = E \times \text{【0.05】} \% / 365$$

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算，逐日累计，每季度支付一次，由托管人于每季度结束后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，闰年2月29日不计算。

（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。

七、收益分配情况

本报告期间，本集合计划未进行收益分配。

八、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、操作规程五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、投资研究、交易执行、市场营销、产品设计、运营保障、客户服务、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，为计划投资者谋求最大利益。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，未发生损害计划投资者利益行为。

九、重要事项提示

（一）本集合计划管理人相关事项

- 1、本集合计划管理人在本报告期内没有发生涉及资产管理业务的诉讼事项。
- 2、本报告期内，本集合计划管理人办公地址没有发生变更。
- 3、本报告期内，本集合计划的管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的行政处罚。

（二）本集合计划托管人相关事项

- 1、本集合计划托管人在本报告期内没有发生涉及托管业务的诉讼事项。
- 2、本报告期内，本集合计划托管人办公地址没有发生变更。
- 3、本报告期内，本集合计划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。

（三）本集合计划关联交易开展情况

- 1、本报告期内，本集合计划未开展重大关联交易。
- 2、本报告期内，本集合计划未开展一般关联交易。

（四）本集合计划其他相关事项

1、本报告期内，本集合计划共进行1次投资经理变更。自2024年2月19日起，增加赵正诚先生担任本集合计划投资经理，变更后由余冠蓉女士、李雯君女士、刘新华先生、赵正诚先生共同担任本集合计划投资经理。我公司已向中国证监会相关派出机构报送。

2、本报告期内，没有发生涉及本计划财产的诉讼事项。

3、本报告期末，管理人除董事、监事、从业人员及配偶和控股股东以外的其他关联方共持有本集合计划31,773,072.80份。

十、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37号集合资产管理计划资产管理合同》
- 2、《东证融汇汇享37号集合资产管理计划说明书》
- 3、《东证融汇汇享37号集合资产管理计划风险揭示书》
- 4、《东证融汇汇享37号集合资产管理计划托管协议》
- 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37层

网址：www.dzronghui.com

客户服务电话：021-80105551

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

2024年4月29日