

# 东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:东证融汇证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国建设银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合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计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>57</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划	
基金简称	东证融汇成长优选	
基金主代码	970073	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 08 日	
基金管理人	东证融汇证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	186,160,678.96 份	
基金合同存续期	自《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》生效日起不得超过 3 年	
下属分级基金的基金简称	东证融汇成长优选 A	东证融汇成长优选 C
下属分级基金的交易代码	970073	970074
报告期末下属分级基金的份额总额	66,148,246.05 份	120,012,432.91 份

### 2.2 基金产品说明

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、分析师预期等基本面因子，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比较基准的投资回报。1、股票投资策略，本集合计划股票投资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。

注：本报告中所述的“基金”包括按照《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》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划简称“本集合计划”。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东证融汇证券资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王钟	王小飞
	联系电话	021-80105523	021-60637103
	电子邮箱	dzrhyy@nesc.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		021-80105551	021-60637228
传真		021-80105552	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 255 号 540 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200127	100033
法定代表人		李福春	张金良

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的	www.dzronghui.com

管理人互联网网址	
基金中期报告备置地点	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）	
	东证融汇成长优选 A	东证融汇成长优选 C
本期已实现收益	-2,355,209.95	-2,296,077.38
本期利润	-6,919,784.19	-9,745,780.33
加权平均基金份额本期利润	-0.1041	-0.0890
本期加权平均净值利润率	-10.42%	-10.04%
本期基金份额净值增长率	-8.77%	-8.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-949,026.67	-15,509,342.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0143	-0.1292
期末基金资产净值	65,199,219.38	104,503,090.39
期末基金份额净值	0.9857	0.8708
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-9.49%	-12.92%

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

## 东证融汇成长优选 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.84%	1.63%	-6.21%	0.86%	-0.63%	0.77%
过去三个月	-2.30%	1.78%	-5.82%	1.03%	3.52%	0.75%
过去六个月	-8.77%	2.23%	-7.96%	1.45%	-0.81%	0.78%
过去一年	-9.53%	1.67%	-15.81%	1.15%	6.28%	0.52%
自基金合同生效起至今	-9.49%	1.40%	-26.43%	1.09%	16.94%	0.31%

注：本集合计划合同于 2021 年 11 月 08 日生效。

## 东证融汇成长优选 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.88%	1.63%	-6.21%	0.86%	-0.67%	0.77%
过去三个月	-2.40%	1.78%	-5.82%	1.03%	3.42%	0.75%
过去六个月	-8.95%	2.23%	-7.96%	1.45%	-0.99%	0.78%
过去一年	-9.88%	1.67%	-15.81%	1.15%	5.93%	0.52%
自基金合同生效起至今	-12.92%	1.41%	-28.85%	1.10%	15.93%	0.31%

注：本集合计划合同于 2021 年 11 月 08 日生效。本集合计划 C 类份额于 2021 年 11 月 25 日首次申购确认，2021 年 11 月 08 日至 2021 年 11 月 24 日期间，本集合计划 C 类份额为零。

## 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



东证融汇成长优选A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年11月08日-2024年06月30日)



东证融汇成长优选C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年11月25日-2024年06月30日)



注：（1）净值表现所取数据截至 2024 年 06 月 30 日。

（2）本集合计划合同于 2021 年 11 月 08 日生效。本集合计划 A 类份额相关数据和指标按照实际存续期（2021 年 11 月 08 日至 2024 年 06 月 30 日）计算，本集合计划 C 类份额于 2021 年 11 月 25 日首次申购确认，2021 年 11 月 08 日至 2021 年 11 月 24 日期间，本集合计划 C 类份额为零，因此本集合计划 C 类份额相关数据和指标按照实际存续期（2021 年 11 月 25 日至 2024 年 06 月 30 日）计算。

#### § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东证融汇证券资产管理有限公司（以下简称“东证融汇”）是经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准东北证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2015]1565号）批准，于2015年12月24日成立，并于2016年2月22日正式开展证券资产管理业务。东证融汇注册地上海，注册资本70000万元人民币，系东北证券股份有限公司旗下全资子公司。

公司紧密围绕客户需求，并结合国内外资产管理业务发展现状和券商资产管理业务发展趋势，形成了财富管理全产业链产品体系，投资范围覆盖了固定收益类、固收+类、权益类、混合类、现金管理、场外衍生品等各种类型，涵盖了场内外各类投资标的，运作期限灵活，能够满足投资者多层次、多样化的资产配置需求。

根据中国证监会于2018年11月28日颁布的《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》的规定，并经中国证监会的批准，截至报告期末，东证融汇已有5只大集合产品完成合同变更并参照公募基金持续运作，分别为：东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划、东证融汇鑫享30天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划、东证融汇禧悦90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划、东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏江	本集合计划的投资经理	2021-11-08	-	6年	上海财经大学金融工程硕士，2015年开始从事金融行业相关工作，具有8年量化投研工作经验，其中6年量化投资经验。曾任通联数据股份公司量化研究员，负责多因子模型、风险模型的研发，曾任财通证券资产管理有限公司投资经理助理，负责指数增强类策略的开发与“固收+”产品的实盘管理。现任东证融汇证券资产管理有限公司公募投资

					管理部投资经理。
--	--	--	--	--	----------

注：“任职日期”和“离任日期”均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的涵义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》以及行业协会的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、本集合计划资产管理合同及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，为本集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害本集合计划持有人利益的行为，本集合计划投资组合符合有关法规及合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东证融汇证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等有关规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，未发现本集合计划存在有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，本集合计划秉持既定的投资思路，投资运作以量化模型为主、主观分析为辅，在行业配置上注重均衡，通过组合投资方式尽可能规避个股黑天鹅风险，报告期内本投资组合策略运行良好。

2024 年上半年，权益市场整体呈震荡下行走势，期间遭遇了较大的行情波动与较为“极端”的市场风格，本集合计划也经历了自 2021 年成立以来最大的一次超额回撤压力，好在市场情绪逐步回归理性，本集合计划年初以来的超额收益也得到了一定修复。

复盘上半年，市场偏好的投资策略莫过于“买大卖小”，市值因子走出了少有的收益单调性，市值 1000 亿以上股票的收益中位数、正收益概率普遍高于市值 100 亿以下

的股票。按时间先后顺序，今年以来小微盘股经历了三次较大幅度回调，其一是春节前后市场结构性调整导致了小微盘股的流动性进一步收紧；其二是4月中旬新“国九条”发布后，市场对小微盘的规避心理影响；其三是受6月上旬“ST退市”“年报问询函频发”等报道发酵影响。与此同时，监管第一时间发文与市场沟通、避免市场误解，在一定程度上防止了短期大幅调整进而可能带来的市场流动性风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东证融汇成长优选 A 基金份额净值为 0.9857 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.77%，同期业绩比较基准收益率为-7.96%；截至报告期末东证融汇成长优选 C 基金份额净值为 0.8708 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.95%，同期业绩比较基准收益率为-7.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们依然觉得有诸多的不确定性，而其中国经济走势与国际地缘形势依然是两个主要影响因素，相对确定的是我们预计政策面在呵护市场方面将更有针对性和及时性。

市场风格方面，上半年市值因子的强势带来了与之关联的诸如估值、红利等因子也表现不俗。当下，我们依然坚持一季报中的观点，对企业投资价值的评判不能用简单的“大小”，而应该是理性视角下的“好坏”，尽管当前市场依然将高股息、低估值、蓝筹股作为主要方向，这种偏防守属性的思路固然有其优势，但市场终究会走出“阴霾”迎来“曙光”，大寒之后必有大暑，极端趋同也有望迎来“意外反转”，只是我们暂时不确定是何时。

我们将继续坚持理性投资，不断打磨模型挖掘更多有高成长潜力的企业，不以“大小”论成败，通过组合投资的方式努力为投资者带来长期相对稳健的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本集合计划管理人设有估值委员会，估值委员会负责对投资品种的估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制。估值委员会成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或产品估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划投资经理可参与估值原则和方法的讨论，提出建议和意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本集合计划估值与核算服务机构已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本集合计划未进行利润分配，符合相关法律法规规定及本集合计划合同的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或集合计划资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本集合计划的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、集合计划合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本集合计划托管人按照国家有关规定、集合计划合同、托管协议和其他有关规定，对本集合计划的集合计划资产净值计算、集合计划费用开支等方面进行了认真的复核，对本集合计划的投资运作方面进行了监督，未发现集合计划管理人有损害集合计划份额持有人利益的行为。

报告期内，本集合计划利润分配情况符合法律法规和集合计划合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

## 6.1 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：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,461,788.56	6,892,540.63
结算备付金		981,591.80	1,833,502.74
存出保证金		1,368,776.23	1,071,459.02
交易性金融资产	6.4.7.2	157,766,982.20	231,871,393.76
其中：股票投资		148,944,532.31	219,498,187.18
基金投资		-	-
债券投资		8,822,449.89	12,373,206.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,212,235.61	2,090,000.78
应收股利		-	-
应收申购款		8,842,005.37	148,369.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		175,633,379.77	243,907,266.75

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,717,650.30	1,023,036.77
应付赎回款		755,156.10	624,385.94
应付管理人报酬		152,210.13	194,100.67
应付托管费		25,368.33	32,350.12
应付销售服务费		29,185.21	41,039.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	52,519.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	251,499.93	236,679.09
负债合计		5,931,070.00	2,204,112.38
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	186,160,678.96	243,285,151.01
未分配利润	6.4.7.8	-16,458,369.19	-1,581,996.64
净资产合计		169,702,309.77	241,703,154.37
负债和净资产总计		175,633,379.77	243,907,266.75

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，本计划份额总额 186,160,678.96 份。其中 A 类份额净值 0.9857 元，A 类份额总额 66,148,246.05 份；C 类份额净值 0.8708 元，C 类份额总额 120,012,432.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-15,301,025.64	4,168,792.77
1. 利息收入		28,685.71	12,014.25
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,685.71	12,014.25
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,857,569.18	3,760,853.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,606,361.35	3,510,209.22
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	85,209.30	26,180.15
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-125,784.62	-60,849.65
股利收益	6.4.7.16	789,367.49	405,099.42
其他投资收益		-	-119,785.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-12,014,277.19	346,917.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	542,135.02	49,007.67



减：二、营业总支出		1,364,538.88	473,180.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	970,594.72	330,275.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	161,765.74	55,045.90
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	191,760.76	29,677.72
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	14,374.40
8. 其他费用	6.4.7.20	40,417.66	43,807.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,665,564.52	3,695,612.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,665,564.52	3,695,612.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-16,665,564.52	3,695,612.45

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	243,285,151.01	-1,581,996.64	241,703,154.37
二、本期期初净资产	243,285,151.01	-1,581,996.64	241,703,154.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-57,124,472.05	-14,876,372.55	-72,000,844.60
（一）、综合收益总额	-	-16,665,564.52	-16,665,564.52
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-57,124,472.05	1,789,191.97	-55,335,280.08
其中：1. 基金申购款	142,091,991.44	-14,114,994.51	127,976,996.93

2. 基金赎回款	-199,216,463.49	15,904,186.48	-183,312,277.01
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	186,160,678.96	-16,458,369.19	169,702,309.77
项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	49,492,627.77	-686,736.66	48,805,891.11
二、本期期初净资产	49,492,627.77	-686,736.66	48,805,891.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,310,210.87	3,566,280.54	5,876,491.41
(一)、综合收益总额	-	3,695,612.45	3,695,612.45
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	2,310,210.87	-129,331.91	2,180,878.96
其中：1. 基金申购款	27,289,855.78	-878,175.06	26,411,680.72
2. 基金赎回款	-24,979,644.91	748,843.15	-24,230,801.76
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	51,802,838.64	2,879,543.88	54,682,382.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王钟

陶丽

邵辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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”）原为东北证券 3 号主题投资集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）。原集合计划于 2010 年 10 月 11 日获中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1382 号文核准，于 2010 年 11 月 10 日起开始募集并于 2010 年 12 月 10 日结束募集，于 2010 年 12 月 16 日成立。

原集合计划在募集期间收到客户有效净参与资金为人民币 2,834,728,696.46 元，折合认购份额 2,834,728,696.46 份；认购资金产生的利息金额为人民币 446,964.38 元，

折合集合计划份额 446,964.38 份；以上实收资金共计人民币 2,835,175,660.84 元，折合 2,835,175,660.84 份集合计划份额。上述出资业经中准会计师事务所（特殊普通合伙）审验。原集合计划的管理人为东北证券股份有限公司（以下简称“东北证券”），后变更为东证融汇证券资产管理有限公司（以下简称“东证融汇”），托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

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，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

经中国证监会批准，自 2021 年 11 月 08 日起，“东北证券 3 号主题投资集合资产管理计划”正式更名为“东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划”，《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》生效，原《东北证券 3 号主题投资集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。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。

根据《东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划招募说明书》，本集合计划根据申购费用与销售服务费收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的集合计划份额，称为 A 类份额；从本类别集合计划资产中计提销售服务费、不收取申购费用的集合计划份额，称为 C 类份额。本集合计划 A 类、C 类份额分别设置代码。由于集合计划费用的不同，本集合计划 A 类份额和 C 类份额将分别计算集合计划份额净值，计算公式为计算日各类别集合计划资产净值除以计算日发售在外的该类别集合计划份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本集合计划的投资范围为国内依法发行的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（含国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货等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。此外，如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*90%+银行活期存款利率（税后）\*10%。

本集合计划为混合型集合资产管理计划，自本集合计划合同生效日起存续期不超过 3 年。本集合计划自资产管理合同生效日起 3 年内，按照中国证监会有关规定执行。东证融汇是本集合计划的管理人，建设银行是本集合计划的托管人，东证融汇及其他符合条件的代销机构是本集合计划的销售机构。

本财务报表由本集合计划的管理人东证融汇于 2024 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本集合计划 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日间经营成果和净资产变动情况及 2024 年 6 月 30 日的财务状况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

集合计划目前比照公开募集证券投资基金所依据的相关财税法规和实务操作及其他相关国内财税法规计提和缴纳税款,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对集合计划从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，从基金分配中取得的收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 集合计划卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(4) 集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	5,461,788.56
等于：本金	5,460,982.65
加：应计利息	805.91
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,461,788.56

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
----	----------------------

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	158,404,230.29	-	148,944,532.31	-9,459,697.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	101,659.89	8,822,449.89	-9,930.67
	银行间市场	-	-	-
	合计	101,659.89	8,822,449.89	-9,930.67
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	167,134,950.96	101,659.89	157,766,982.20	-9,469,628.65

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,902,564.45	-	-	-
--股指期货	10,902,564.45	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,902,564.45	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2409	中证 500 股指期货 2409 合约	4	3,900,160.00	-195,644.45
IC2412	中证 500 股指期货 2412 合约	7	6,767,320.00	-39,440.00
合计				-235,084.45
减：可抵销期货暂收款				-235,084.45

净额				0.00
----	--	--	--	------

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	220,172.27
其中：交易所市场	220,172.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	31,327.66
合计	251,499.93

#### 6.4.7.7 实收基金

东证融汇成长优选 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	72,774,169.05	72,774,169.05
本期申购	22,537,471.59	22,537,471.59
本期赎回 (以“-”号填列)	-29,163,394.59	-29,163,394.59
本期末	66,148,246.05	66,148,246.05

## 东证融汇成长优选 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	170,510,981.96	170,510,981.96
本期申购	119,554,519.85	119,554,519.85
本期赎回 (以“-”号填列)	-170,053,068.90	-170,053,068.90
本期末	120,012,432.91	120,012,432.91

注：申购含红利再投份额、转换转入份额；赎回含转换转出份额。

## 6.4.7.8 未分配利润

## 东证融汇成长优选 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	37,148,064.84	-31,295,768.03	5,852,296.81
本期期初	37,148,064.84	-31,295,768.03	5,852,296.81
本期利润	-2,355,209.95	-4,564,574.24	-6,919,784.19
本期基金份额交易产生的变动数	-3,068,380.16	3,186,840.87	118,460.71
其中：基金申购款	10,409,437.43	-10,580,631.82	-171,194.39
基金赎回款	-13,477,817.59	13,767,472.69	289,655.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,724,474.73	-32,673,501.40	-949,026.67

## 东证融汇成长优选 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-302,191.56	-7,132,101.89	-7,434,293.45
本期期初	-302,191.56	-7,132,101.89	-7,434,293.45
本期利润	-2,296,077.38	-7,449,702.95	-9,745,780.33
本期基金份额交易产生的变动数	-1,108,740.93	2,779,472.19	1,670,731.26
其中：基金申购款	-7,201,948.07	-6,741,852.05	-13,943,800.12
基金赎回款	6,093,207.14	9,521,324.24	15,614,531.38
本期已分配利润	-	-	-



本期末	-3,707,009.87	-11,802,332.65	-15,509,342.52
-----	---------------	----------------	----------------

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	18,198.39
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,875.96
其他	611.36
合计	28,685.71

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	869,151,472.32
减：卖出股票成本总额	872,801,419.00
减：交易费用	956,414.67
买卖股票差价收入	-4,606,361.35

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	85,563.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-353.93
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	85,209.30

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,970,626.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,707,399.12
减：应计利息总额	259,210.43
减：交易费用	4,370.81
买卖债券差价收入	-353.93

**6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本集合计划本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入**

本集合计划本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.13 资产支持证券投资收益**

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本集合计划本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-124,667.31
减：交易费用	1,117.31
合计	-125,784.62

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	789,367.49
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	789,367.49

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-11,903,304.44
——股票投资	-11,887,454.56
——债券投资	-15,849.88
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-163,492.69
——权证投资	-
————期货投资	-163,492.69
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-52,519.94
合计	-12,014,277.19

注：公允价值变动收益含应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税的暂估附加税。

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	542,135.02
合计	542,135.02

注：本集合计划的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入集合计划资产。

## 6.4.7.19 信用减值损失

本集合计划本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	6,464.64
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行汇划费	90.00
账户维护费	9,000.00
合计	40,417.66

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本集合计划无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本集合计划本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建设银行	集合计划托管人、集合计划销售机构
东证融汇	集合计划管理人、集合计划销售机构
东北证券	集合计划管理人的控股股东、集合计划销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

东北证券	1,683,188,365.00	100.00%	452,322,845.44	100.00%
------	------------------	---------	----------------	---------

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月 30日		上年度可比期间2023年01月01日 至2023年06月30日	
	成交金额	占当期债券成交总 额的比例	成交金额	占当期债券成交总 额的比例
东北证券	21,854,235.00	100.00%	4,228,968.41	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总 额的比例
东北证券	418,279.48	100.00%	220,172.27	100.00%
关联方名称	上年度可比期间2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总 额的比例
东北证券	105,796.94	100.00%	57,814.60	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本集合计划的集合计划管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费等净额列示。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	970,594.72	330,275.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	435,641.04	136,046.50
应支付基金管理人的净管理费	534,953.68	194,228.62

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	161,765.74	55,045.90

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.2% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
-------------	---------------------------------------

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东证融汇成长优选 A	东证融汇成长优选 C	合计
东北证券	-	174,595.18	174,595.18
建设银行	-	42.30	42.30
合计	-	174,637.48	174,637.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东证融汇成长优选 A	东证融汇成长优选 C	合计
东北证券	-	10,174.69	10,174.69
建设银行	-	1.09	1.09
东证融汇	-	5,183.64	5,183.64
合计	-	15,359.42	15,359.42

注：销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.4%。C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

##### 东证融汇成长优选 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 11 月 08 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,274,732.56	6,469,738.55
报告期间申购/买入总份额	7,215,834.18	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总 份额	-	-

报告期末持有的基金份额	16,490,566.74	6,469,738.55
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.93%	17.23%

注：（1）本集合计划管理人投资本集合计划的适用费率符合本集合计划招募说明书和相关公告的规定。

（2）申购总份额含红利再投、转换入份额；赎回总份额含转换出份额。

（3）分级集合计划占集合计划总份额比例的计算中，对下属分级集合计划，比例的分母采用各自级别的份额。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本集合计划本报告期末除集合计划管理人之外无其他关联方投资本集合计划的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	5,461,788.56	18,198.39	1,831,297.55	9,395.84

注：本集合计划上述银行存款由本集合计划托管人建设银行保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期及上年度可比期间内没有须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券



金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688691	灿芯半导体股份	2024年04月02日	6个月	网下新股限售	19.86	49.38	167	3,316.62	8,246.46	-
301591	肯特股份	2024年02月20日	6个月	网下新股限售	19.43	36.92	127	2,467.61	4,688.84	-
688530	欧莱新材	2024年04月29日	6个月	网下新股限售	9.60	18.96	232	2,227.20	4,398.72	-
301588	美新科技	2024年03月06日	6个月	网下新股限售	14.50	21.25	127	1,841.50	2,698.75	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本集合计划从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，无质押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本集合计划从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，无质押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

管理人构建了由董事会及下设的专业决策机构、经理层、风险管理部门及风险管理相关职能部门、各业务部门和岗位构成的风险管理体系，并明确了管理人监事在全面风险管理中的职责。

董事会下设公募投资决策委员会，对董事会负责，在授权范围以会议的形式对相关事宜进行集体讨论和决策，发挥专业决策和风险控制作用。监事承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。经理层对全面风险管理承担主要责任，遵循风险管理总体目标，执行风险管理政策。管理人风险管理部门在首席风险官领导下负责推动和落实公司全面风险管理工作。风险管理相关职能部门按职能分工分别履行相应的风险管理职能。各业务部门负责全面识别、评估、应对与报告其相关业务的各类风险。各岗位负责自觉执行各项风险管理制度和流程。

管理人采取定性与定量相结合的方法，根据风险发生的可能性及其影响程度对识别的风险进行评估。管理人根据风险评估和监控预警的结果，权衡风险与收益，选择与公司风险偏好相适应的风险应对策略，建立合理、有效的应对机制；对于难以通过计量进行评估和预警的风险，管理人通过建立制度、标准化业务流程和信息系统等对相关风险进行有效管理和控制。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者本集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。管理人通过严格的证券库制度和分散化投资方式防范信用风险。于 2024 年 6 月 30 日，本集合计划未持有除国债以外的债券(2023 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,710,859.33	12,373,206.58
合计	8,710,859.33	12,373,206.58

注：未评级债券为剩余期限在一年以内的国债。债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

本集合计划流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另

一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额。

管理人采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范投资品种的流动性风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持本集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。管理人在产品合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障本集合计划持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

管理人在本集合计划运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现能力较好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指本集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险。管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 4年 06 月 30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币	5,461,788.56	-	-	-	-	-	5,461,788.56

资金							
结算备付金	559,291.45	-	-	-	-	422,300.35	981,591.80
存出保证金	1,368,776.23	-	-	-	-	-	1,368,776.23
交易性金融资产	-	-	8,822,449.89	-	-	148,944,532.31	157,766,982.20
应收清算款	-	-	-	-	-	1,212,235.61	1,212,235.61
应收申购款	-	-	-	-	-	8,842,005.37	8,842,005.37
资产总计	7,389,856.24	-	8,822,449.89	-	-	159,421,073.64	175,633,379.77
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	4,717,650.30	4,717,650.30
应付赎回	-	-	-	-	-	755,156.10	755,156.10

款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	152,210.13	152,210.13
应付托管费	-	-	-	-	-	25,368.33	25,368.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	29,185.21	29,185.21
其他负债	-	-	-	-	-	251,499.93	251,499.93
负债总计	-	-	-	-	-	5,931,070.00	5,931,070.00
利率敏感度缺口	7,389,856.24	-	8,822,449.89	-	-	153,490,003.64	169,702,309.77
上年度末 2023 年 12 月 31	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日							
资产							
货币资金	6,892,540.63	-	-	-	-	-	6,892,540.63
结算备付金	588,617.88	-	-	-	-	1,244,884.86	1,833,502.74
存出保证金	1,071,459.02	-	-	-	-	-	1,071,459.02
交易性金融资产	-	-	12,373,206.58	-	-	219,498,187.18	231,871,393.76
应收清算款	-	-	-	-	-	2,090,000.78	2,090,000.78
应收申购款	-	-	-	-	-	148,369.82	148,369.82
资产总计	8,552,617.53	-	12,373,206.58	-	-	222,981,442.64	243,907,266.75
负债							
应付清算	-	-	-	-	-	1,023,036.77	1,023,036.77

款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	624,385.94	624,385.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	194,100.67	194,100.67
应付托管费	-	-	-	-	-	32,350.12	32,350.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	41,039.85	41,039.85
应交税费	-	-	-	-	-	52,519.94	52,519.94
其他负债	-	-	-	-	-	236,679.09	236,679.09
负债总计	-	-	-	-	-	2,204,112.38	2,204,112.38
利率敏感度缺口	8,552,617.53	-	12,373,206.58	-	-	220,777,330.26	241,703,154.37

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	10,014.48	9,694.33
	市场利率上升 25 个基点	-9,977.55	-9,662.91

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指本集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	148,944,532.31	87.77	219,498,187.18	90.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投	-	-	-	-



资				
其他		-	-	-
合计	148,944,532.31	87.77	219,498,187.18	90.81

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注 6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“中证 500 指数”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上升 5%	7,819,872.58	11,103,464.55
	中证 500 指数下降 5%	-7,819,872.58	-11,103,464.55

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外，相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	148,924,499.54	219,498,187.18
第二层次	8,822,449.89	12,373,206.58
第三层次	20,032.77	-
合计	157,766,982.20	231,871,393.76

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换事项发生的当年年初/当期期初为确认各层次之

间的转换时点。本集合计划本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	148,944,532.31	84.80
	其中：股票	148,944,532.31	84.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,822,449.89	5.02
	其中：债券	8,822,449.89	5.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,443,380.36	3.67
8	其他各项资产	11,423,017.21	6.50
9	合计	175,633,379.77	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,124,306.00	0.66
B	采矿业	1,140,782.00	0.67
C	制造业	112,785,118.25	66.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,892,854.00	2.88
E	建筑业	1,638,063.00	0.97
F	批发和零售业	2,812,626.00	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	3,988,967.40	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,085,475.46	4.18
J	金融业	3,255,387.00	1.92
K	房地产业	654,910.00	0.39
L	租赁和商务服务业	579,477.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	1,722,887.00	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,766,853.00	1.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	514,104.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	2,655,792.00	1.56
S	综合	2,326,930.20	1.37
	合计	148,944,532.31	87.77

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300973	立高食品	24,400	685,396.00	0.40
2	301188	力诺特玻	46,800	681,876.00	0.40
3	300422	博世科	142,700	679,252.00	0.40
4	300120	经纬辉开	130,800	678,852.00	0.40
5	603399	永杉锂业	109,300	676,567.00	0.40

6	002100	天康生物	97,600	676,368.00	0.40
7	301013	利和兴	63,000	672,840.00	0.40
8	605333	沪光股份	24,100	671,185.00	0.40
9	300331	苏大维格	41,700	670,536.00	0.40
10	300203	聚光科技	66,300	668,967.00	0.39
11	002534	西子洁能	66,800	668,668.00	0.39
12	300233	金城医药	44,800	668,416.00	0.39
13	300790	宇瞳光学	49,500	668,250.00	0.39
14	300940	南极光	52,400	667,576.00	0.39
15	300005	探路者	132,000	661,320.00	0.39
16	300821	东岳硅材	96,000	656,640.00	0.39
17	603629	利通电子	35,500	655,330.00	0.39
18	000042	中洲控股	165,800	654,910.00	0.39
19	603577	汇金通	94,200	653,748.00	0.39
20	002753	永东股份	112,400	653,044.00	0.38
21	603668	天马科技	57,412	651,626.20	0.38
22	002972	科安达	71,100	651,276.00	0.38
23	300463	迈克生物	57,200	650,936.00	0.38
24	300249	依米康	100,300	649,944.00	0.38
25	603681	永冠新材	50,800	647,700.00	0.38
26	002661	克明食品	86,100	643,167.00	0.38
27	603798	康普顿	76,300	642,446.00	0.38
28	600262	北方股份	39,100	642,413.00	0.38
29	002403	爱仕达	96,900	641,478.00	0.38
30	300428	立中集团	34,500	641,355.00	0.38
31	300677	英科医疗	23,800	638,078.00	0.38
32	603330	天洋新材	133,200	638,028.00	0.38
33	002799	环球印务	108,200	636,216.00	0.37
34	605018	长华集团	70,000	634,200.00	0.37
35	002365	永安药业	87,700	633,194.00	0.37
36	300170	汉得信息	103,100	633,034.00	0.37
37	603727	博迈科	48,000	631,680.00	0.37
38	300529	健帆生物	23,200	631,272.00	0.37
39	300432	富临精工	97,900	630,476.00	0.37
40	300587	天铁股份	156,000	630,240.00	0.37
41	002907	华森制药	49,900	629,738.00	0.37
42	300381	溢多利	101,800	625,052.00	0.37
43	002449	国星光电	87,700	624,424.00	0.37
44	300582	英飞特	72,700	622,312.00	0.37
45	603051	鹿山新材	28,500	622,155.00	0.37
46	300657	弘信电子	41,400	621,828.00	0.37
47	300527	中船应急	96,000	621,120.00	0.37
48	000795	英洛华	112,100	621,034.00	0.37

49	002961	瑞达期货	56,700	620,865.00	0.37
50	002215	诺普信	83,200	619,840.00	0.37
51	002290	禾盛新材	46,500	619,380.00	0.36
52	600152	维科技术	128,900	618,720.00	0.36
53	002779	中坚科技	21,800	617,812.00	0.36
54	002267	陕天然气	81,700	617,652.00	0.36
55	300755	华致酒行	45,200	617,432.00	0.36
56	001206	依依股份	47,400	617,148.00	0.36
57	002928	华夏航空	97,100	615,614.00	0.36
58	300318	博晖创新	126,100	615,368.00	0.36
59	301062	上海艾录	60,200	614,642.00	0.36
60	000833	粤桂股份	131,240	614,203.20	0.36
61	300241	瑞丰光电	149,800	614,180.00	0.36
62	605128	上海沿浦	22,000	613,580.00	0.36
63	603733	仙鹤股份	34,900	613,542.00	0.36
64	601700	风范股份	139,300	611,527.00	0.36
65	002468	申通快递	72,700	610,680.00	0.36
66	002996	顺博合金	104,330	610,330.50	0.36
67	002876	三利谱	25,300	610,236.00	0.36
68	300673	佩蒂股份	46,500	610,080.00	0.36
69	000788	北大医药	122,200	609,778.00	0.36
70	603055	台华新材	60,100	608,813.00	0.36
71	300707	威唐工业	49,100	607,858.00	0.36
72	300380	安硕信息	39,500	606,720.00	0.36
73	002979	雷赛智能	33,300	606,060.00	0.36
74	603677	奇精机械	51,800	603,470.00	0.36
75	600420	国药现代	56,500	603,420.00	0.36
76	000735	罗牛山	139,000	601,870.00	0.35
77	603348	文灿股份	21,700	600,873.00	0.35
78	301028	东亚机械	68,400	599,868.00	0.35
79	300204	舒泰神	105,800	598,828.00	0.35
80	000710	贝瑞基因	83,400	598,812.00	0.35
81	000551	创元科技	68,500	598,005.00	0.35
82	301260	格力博	43,900	597,918.00	0.35
83	300247	融捷健康	246,000	597,780.00	0.35
84	688159	有方科技	15,789	597,771.54	0.35
85	002583	海能达	146,300	595,441.00	0.35
86	605376	博迁新材	26,300	593,591.00	0.35
87	002412	汉森制药	114,700	592,999.00	0.35
88	600299	安迪苏	61,100	592,670.00	0.35
89	300409	道氏技术	69,200	592,352.00	0.35
90	002019	亿帆医药	47,900	592,044.00	0.35
91	300054	鼎龙股份	26,100	591,948.00	0.35

92	002741	光华科技	65,800	590,884.00	0.35
93	300194	福安药业	157,700	589,798.00	0.35
94	002765	蓝黛科技	125,400	589,380.00	0.35
95	603595	东尼电子	28,600	588,874.00	0.35
96	002026	山东威达	70,900	588,470.00	0.35
97	300307	慈星股份	98,900	588,455.00	0.35
98	605188	国光连锁	75,900	588,225.00	0.35
99	603906	龙蟠科技	75,500	588,145.00	0.35
100	600819	耀皮玻璃	139,300	587,846.00	0.35
101	300872	天阳科技	44,300	586,975.00	0.35
102	603980	吉华集团	156,900	586,806.00	0.35
103	688313	仕佳光子	61,386	584,394.72	0.34
104	002286	保龄宝	106,000	584,060.00	0.34
105	688779	长远锂科	126,000	583,380.00	0.34
106	603379	三美股份	14,900	583,186.00	0.34
107	000828	东莞控股	64,700	582,947.00	0.34
108	000532	华金资本	48,300	582,498.00	0.34
109	000703	恒逸石化	82,100	582,089.00	0.34
110	300879	大叶股份	43,500	582,030.00	0.34
111	300497	富祥药业	65,000	580,450.00	0.34
112	300426	唐德影视	85,600	580,368.00	0.34
113	002878	元隆雅图	46,100	579,477.00	0.34
114	300840	酷特智能	62,600	579,050.00	0.34
115	300596	利安隆	21,300	577,869.00	0.34
116	600367	红星发展	58,300	577,753.00	0.34
117	688222	成都先导	50,900	577,715.00	0.34
118	603239	浙江仙通	42,100	577,191.00	0.34
119	603015	弘讯科技	76,100	575,316.00	0.34
120	002121	科陆电子	151,600	574,564.00	0.34
121	301056	森赫股份	74,900	574,483.00	0.34
122	600480	凌云股份	58,200	572,106.00	0.34
123	603258	电魂网络	35,400	571,710.00	0.34
124	601991	大唐发电	189,200	569,492.00	0.34
125	002785	万里石	22,900	569,065.00	0.34
126	000892	欢瑞世纪	227,400	568,500.00	0.33
127	300950	德固特	37,300	568,452.00	0.33
128	002537	海联金汇	109,300	565,081.00	0.33
129	002053	云南能投	46,700	564,603.00	0.33
130	603162	海通发展	60,668	564,212.40	0.33
131	000990	诚志股份	75,800	563,952.00	0.33
132	601068	中铝国际	133,800	563,298.00	0.33
133	300679	电连技术	14,000	563,220.00	0.33
134	301199	迈赫股份	23,200	560,976.00	0.33

135	002454	松芝股份	100,300	560,677.00	0.33
136	300783	三只松鼠	25,600	559,872.00	0.33
137	000830	鲁西化工	48,300	559,797.00	0.33
138	600335	国机汽车	97,000	559,690.00	0.33
139	000546	金圆股份	139,500	559,395.00	0.33
140	300881	盛德鑫泰	21,700	557,473.00	0.33
141	600776	东方通信	56,700	557,361.00	0.33
142	601616	广电电气	191,400	556,974.00	0.33
143	002646	天佑德酒	54,400	556,512.00	0.33
144	001207	联科科技	38,300	556,116.00	0.33
145	603919	金徽酒	30,600	556,002.00	0.33
146	601628	中国人寿	17,900	555,795.00	0.33
147	000601	韶能股份	150,600	555,714.00	0.33
148	688567	孚能科技	57,800	554,880.00	0.33
149	603189	网达软件	50,700	554,658.00	0.33
150	300846	首都在线	59,100	553,176.00	0.33
151	300323	华灿光电	127,100	552,885.00	0.33
152	000050	深天马 A	75,900	552,552.00	0.33
153	300379	东方通	68,300	551,864.00	0.33
154	301011	华立科技	35,807	551,785.87	0.33
155	300251	光线传媒	65,600	551,696.00	0.33
156	001300	三柏硕	48,500	551,445.00	0.32
157	002782	可立克	49,700	550,676.00	0.32
158	002755	奥赛康	57,000	550,050.00	0.32
159	300505	川金诺	45,100	549,769.00	0.32
160	300218	安利股份	36,400	548,912.00	0.32
161	002068	黑猫股份	77,300	548,830.00	0.32
162	300016	北陆药业	124,400	548,604.00	0.32
163	003015	日久光电	60,300	547,524.00	0.32
164	002752	昇兴股份	108,100	546,986.00	0.32
165	300492	华图山鼎	5,800	546,360.00	0.32
166	300222	科大智能	101,800	545,648.00	0.32
167	301071	力量钻石	19,680	545,332.80	0.32
168	600029	南方航空	92,500	544,825.00	0.32
169	002483	润邦股份	120,800	544,808.00	0.32
170	300400	劲拓股份	47,600	544,544.00	0.32
171	688662	广东富信科技	22,237	542,582.80	0.32
172	603186	华正新材	22,800	542,184.00	0.32
173	001331	胜通能源	39,100	541,535.00	0.32
174	600882	妙可蓝多	43,400	541,198.00	0.32
175	001213	中铁特货	137,000	541,150.00	0.32
176	002099	海翔药业	105,900	541,149.00	0.32

177	600399	抚顺特钢	96,100	541,043.00	0.32
178	002725	跃岭股份	64,700	540,892.00	0.32
179	000065	北方国际	52,000	539,240.00	0.32
180	605180	华生科技	45,500	539,175.00	0.32
181	603693	江苏新能	46,400	539,168.00	0.32
182	300396	迪瑞医疗	26,500	538,215.00	0.32
183	301077	星华新材	30,100	537,586.00	0.32
184	300424	航新科技	43,900	536,897.00	0.32
185	002140	东华科技	69,100	535,525.00	0.32
186	300340	科恒股份	77,600	535,440.00	0.32
187	600926	杭州银行	41,000	535,050.00	0.32
188	688678	福立旺精密	49,400	535,002.00	0.32
189	600478	科力远	141,600	533,832.00	0.31
190	300942	易瑞生物	89,100	533,709.00	0.31
191	300049	福瑞股份	10,600	533,604.00	0.31
192	000698	沈阳化工	175,500	533,520.00	0.31
193	600673	东阳光	75,600	532,224.00	0.31
194	688022	瀚川智能	38,800	531,948.00	0.31
195	002362	汉王科技	31,900	531,135.00	0.31
196	000600	建投能源	84,300	531,090.00	0.31
197	002006	精工科技	39,500	530,090.00	0.31
198	000639	西王食品	222,600	529,788.00	0.31
199	600125	铁龙物流	88,700	529,539.00	0.31
200	600336	澳柯玛	123,700	529,436.00	0.31
201	002284	亚太股份	78,300	529,308.00	0.31
202	002180	纳思达	20,000	528,400.00	0.31
203	002034	旺能环境	40,600	528,206.00	0.31
204	300841	康华生物	10,400	526,656.00	0.31
205	300916	朗特智能	20,900	526,262.00	0.31
206	603088	宁波精达	69,800	525,594.00	0.31
207	001338	永顺泰	53,600	525,280.00	0.31
208	300837	浙矿股份	25,300	525,228.00	0.31
209	605488	福莱新材	40,400	525,200.00	0.31
210	002476	宝莫股份	143,100	525,177.00	0.31
211	603738	泰晶科技	38,500	525,140.00	0.31
212	002608	江苏国信	67,700	524,675.00	0.31
213	000958	电投产融	143,200	524,112.00	0.31
214	002544	普天科技	28,000	523,320.00	0.31
215	300048	合康新能	113,000	523,190.00	0.31
216	003025	思进智能	42,500	523,175.00	0.31
217	600506	统一股份	42,200	522,436.00	0.31
218	688150	莱特光电股份	26,908	522,015.20	0.31



219	603025	大豪科技	37,700	521,014.00	0.31
220	600114	东睦股份	36,200	520,918.00	0.31
221	603026	石大胜华	15,400	520,520.00	0.31
222	300578	会畅通讯	35,100	519,480.00	0.31
223	688233	神工半导体	26,893	518,228.11	0.31
224	688380	中微半导	30,800	514,976.00	0.30
225	000544	中原环保	65,400	514,698.00	0.30
226	002219	新里程	276,400	514,104.00	0.30
227	601198	东兴证券	64,500	513,420.00	0.30
228	002282	博深股份	80,300	513,117.00	0.30
229	601969	海南矿业	80,300	509,102.00	0.30
230	300652	雷迪克	25,600	507,648.00	0.30
231	600000	浦发银行	61,500	506,145.00	0.30
232	601038	一拖股份	32,000	505,920.00	0.30
233	000930	中粮科技	99,900	502,497.00	0.30
234	000883	湖北能源	83,000	498,830.00	0.29
235	301155	海力风电	12,300	494,829.00	0.29
236	300375	鹏翎股份	127,100	491,877.00	0.29
237	605388	均瑶健康	89,740	491,775.20	0.29
238	002399	海普瑞	56,500	489,855.00	0.29
239	002727	一心堂	32,300	487,407.00	0.29
240	300291	百纳千成	114,000	485,640.00	0.29
241	002906	华阳集团	18,100	484,356.00	0.29
242	000818	航锦科技	21,900	483,552.00	0.28
243	300953	震裕科技	8,900	482,380.00	0.28
244	301299	卓创资讯	11,400	478,800.00	0.28
245	002975	博杰股份	15,800	472,104.00	0.28
246	001330	博纳影业	86,800	469,588.00	0.28
247	002145	中核钛白	141,900	465,432.00	0.27
248	600586	金晶科技	79,900	463,420.00	0.27
249	000860	顺鑫农业	27,500	460,350.00	0.27
250	300115	长盈精密	37,600	450,824.00	0.27
251	688609	广东九联科技	51,100	450,702.00	0.27
252	300100	双林股份	41,800	450,186.00	0.27
253	688253	英诺特生物股份	11,700	445,887.00	0.26
254	300769	德方纳米	15,700	442,740.00	0.26
255	301327	华宝新能	7,700	441,210.00	0.26
256	603803	瑞斯康达	62,000	440,200.00	0.26
257	600308	华泰股份	140,000	439,600.00	0.26
258	603156	养元饮品	20,500	436,035.00	0.26
259	688208	道通科技	18,000	434,520.00	0.26

260	688123	聚辰半导体	7,100	431,893.00	0.25
261	000409	云鼎科技	53,000	427,710.00	0.25
262	300448	浩云科技	100,200	419,838.00	0.25
263	002296	辉煌科技	27,200	280,432.00	0.17
264	688691	灿芯半导体股份	167	8,246.46	0.00
265	301591	肯特股份	127	4,688.84	0.00
266	688530	欧莱新材	232	4,398.72	0.00
267	301588	美新科技	127	2,698.75	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688590	新致软件	3,091,162.25	1.28
2	301011	华立科技	2,989,237.17	1.24
3	605008	长鸿高科	2,882,748.60	1.19
4	603681	永冠新材	2,534,924.00	1.05
5	603055	台华新材	2,463,699.00	1.02
6	600299	安迪苏	2,458,114.00	1.02
7	688519	南亚新材料	2,307,462.93	0.95
8	603906	龙蟠科技	2,288,133.00	0.95
9	301188	力诺特玻	2,224,463.00	0.92
10	300803	指南针	2,198,255.00	0.91
11	688501	青岛达能环保	2,186,595.06	0.90
12	000703	恒逸石化	2,168,820.00	0.90
13	600446	金证股份	2,068,699.00	0.86
14	603727	博迈科	2,065,501.00	0.85
15	300497	富祥药业	2,042,904.00	0.85
16	603156	养元饮品	1,900,077.00	0.79
17	300821	东岳硅材	1,894,661.00	0.78
18	603383	顶点软件	1,872,919.00	0.77
19	300652	雷迪克	1,850,652.00	0.77
20	300733	西菱动力	1,804,198.48	0.75

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	301011	华立科技	3,070,554.00	1.27
2	688590	新致软件	3,038,142.58	1.26
3	605008	长鸿高科	2,843,520.40	1.18
4	603055	台华新材	2,737,973.80	1.13
5	688519	南亚新材料	2,480,473.91	1.03
6	603992	松霖科技	2,165,236.50	0.90
7	600446	金证股份	2,124,263.00	0.88
8	300803	指南针	2,119,429.00	0.88
9	301045	天禄科技	2,065,111.00	0.85
10	688501	青岛达能环保	2,006,385.42	0.83
11	301046	能辉科技	1,941,764.00	0.80
12	002838	道恩股份	1,924,935.62	0.80
13	300902	国安达	1,895,536.00	0.78
14	600299	安迪苏	1,890,109.00	0.78
15	603949	雪龙集团	1,875,534.00	0.78
16	300976	达瑞电子	1,856,463.00	0.77
17	301003	江苏博云	1,850,901.00	0.77
18	600521	华海药业	1,847,033.00	0.76
19	603681	永冠新材	1,815,599.00	0.75
20	300577	开润股份	1,782,465.00	0.74

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	814,135,218.69
卖出股票收入（成交）总额	869,151,472.32

注：本表“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	8,822,449.89	5.20
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,822,449.89	5.20

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019733	24 国债 02	48,000	4,851,507.29	2.86
2	019727	23 国债 24	39,000	3,970,942.60	2.34

注：本集合计划本报告期末仅持有上述债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划投资股指期货以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本集合计划力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，从而更好地实现本集合计划的投资目标，力争超越业绩比较基准。

本集合计划投资于股指期货，对集合计划总体风险的影响很小，符合既定的投资政

策和投资目标。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本集合计划投资的前十名股票中，没有投资超出集合计划合同规定备选股票库之外的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,368,776.23
2	应收清算款	1,212,235.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,842,005.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,423,017.21

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
			机构投资者		个人投资者		其他投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东证融汇成长优选A	1,093	60,519.9	19,699,682.18	29.78%	46,448,563.87	70.22%	-	-
东证融汇成长优选C	4,054	29,603.46	1,639,694.09	1.37%	116,652,606.57	97.20%	1,720,132.25	1.43%
合计	5,147	36,168.77	21,339,376.27	11.46%	163,101,170.44	87.61%	1,720,132.25	0.92%

注：分级集合计划占集合计划总份额比例的计算中，对下属分级集合计划，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合计划份额的合计数（即期末集合计划份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东证融汇成长优选 A	2,741,717.67	4.1448%
	东证融汇成长优选 C	44,729.26	0.0373%
	合计	2,786,446.93	1.4968%

注：分级集合计划占集合计划总份额比例的计算中，对下属分级集合计划，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合计划份额的合计数（即期末集合计划份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东证融汇成长优选 A	>100
	东证融汇成长优选 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	东证融汇成长优选 A	50~100
	东证融汇成长优选 C	0~10
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东证融汇成长优选 A	东证融汇成长优选 C
本报告期期初基金份额总额	72,774,169.05	170,510,981.96
本报告期基金总申购份额	22,537,471.59	119,554,519.85
减：本报告期基金总赎回份额	29,163,394.59	170,053,068.90
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	66,148,246.05	120,012,432.91

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本集合计划管理人、托管人专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本集合计划未发生对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的涉及集合计划财产、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划本报告期内未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	2	1,683,188,365.00	100.00%	418,279.48	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元



券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东北证券	21,854,235.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划 2023 年第四季度报告	规定网站	2024-01-19
2	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划 2023 年第四季度报告提示性公告	规定报刊	2024-01-19
3	东证融汇证券资产管理有限公司关于旗下集合资产管理计划风险等级划分的公告	规定报刊、网站	2024-01-25
4	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2024-02-23
5	东证融汇证券资产管理有限公司关于旗下部分资产管理计划增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2024-03-20
6	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划 2023 年年度报告	规定网站	2024-03-27
7	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划 2023 年年度报告提示性公告	规定报刊	2024-03-27
8	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划 2024 年第一季度报告	规定网站	2024-04-19
9	东证融汇成长优选混合型	规定报刊	2024-04-19

	集合资产管理计划 2024 年第一季度报告提示性公告		
10	东证融汇证券资产管理有限公司关于旗下部分资产管理计划增加浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2024-04-23
11	东证融汇证券资产管理有限公司关于暂停北京中植基金销售有限公司办理旗下集合计划相关销售业务的公告	规定报刊、网站	2024-06-13
12	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划(A类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-27
13	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-27
14	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新的提示性公告	规定报刊	2024-06-27

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本集合计划本报告期内未发生单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本集合计划未有影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意变更的文件。
- 2、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。

- 3、东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划托管协议。
- 4、东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划招募说明书。
- 5、管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、托管人业务资格批件、营业执照。
- 7、东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告。

## 12.2 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。

## 12.3 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。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

如有疑问，可咨询本管理人。

东证融汇证券资产管理有限公司  
二〇二四年八月二十八日