

西部证券易储通现金管理型集合资产  
管理计划清算报告

管理人：西部证券股份有限公司

托管人：中国证券登记结算有限责任公司

清算报告出具日：2025年7月24日

清算报告公告日：2025年7月31日

## 一、重要提示

西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由西部证券股份有限公司（以下简称“管理人”）担任管理人，由中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“托管人”）担任托管人。本集合计划是由西部证券易储通现金管理集合资产管理计划变更而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2022]790号文准予变更。变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。自2022年7月20日起《西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划资产管理合同》和《西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划招募说明书》生效。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规的规定以及《西部证券易储通现金管理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》”）的约定，本集合计划自《资产管理合同》变更生效日起存续期不得超过3年。根据管理人于2025年7月17日发布的《关于西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划资产管理合同终止及集合计划财产清算的公告》，本集合计划于2025年7月17日终止。本集合计划从2025年7月18日起进入清算流程，由管理人西部证券股份有限公司、托管人中国证券登记结算有限责任公司、上会会计师事务所（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，并由上会会计师事务所（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、集合计划情况

### 1、集合计划的基本情况

产品名称	西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划
产品简称	西部证券易储通现金管理
产品代码	970171
运作方式	契约型开放式
集合计划合同生效日	2022年7月20日
管理人	西部证券股份有限公司
托管人	中国证券登记结算有限责任公司
集合计划合同存续期	不超过3年

## 2、产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	<p>1、利率策略 在分析主要经济变量、综合研究宏观经济状况基础上，判断未来的经济前景，预期财政政策、货币政策等宏观经济政策的变化方向。同时分析金融市场资金供求状况，在对影响资金供求的各因素综合分析基础上，判断整个市场的资金流动性及未来变化趋势。 在宏观分析与流动性分析的基础上，确定当前资金的时间价值、流动性溢价等要素，进而确定不同投资品种的流动性、预期收益率，在此基础上，构建投资组合，并定期对投资组合的剩余期限和投资比例调整优化，以满足总体流动性要求。</p> <p>2、信用债券投资策略 对不同的行业和公司作深入的基本面分析，估算不同行业 and 公司的信用风险及变化趋势，规避潜在风险较大的投资品种，选择发展趋势向好、信用风险较小、具有相对投资价值的投资品种进行投资。</p> <p>3、回购策略 在有效控制风险的前提下，本集合计划将密切跟踪不同市场和不同期限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为集合计划资产增加收益。同时，密切关注央行公开市场操作、季节因素、日历效应、IPO 发行等因素导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购融出资金以把握短期资金利率陡升的投资机会。</p> <p>4、流动性管理策略 对市场资金面的变化（如季节性资金流动、日历效应等）及本集合计划申购/赎回变化的动态预测，通过现金库存管理、回购滚动操作、债券品种的期限结构安排及资产变现等措施，实现对集合计划资产的结构化管理。在保证满足投资人申购、赎回的资金需求的前提下，获取稳定的收益。</p> <p>5、套利策略 由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异，以及资金供求失衡导致的中短期利率异常差异，债券现券市场上存在着套利机会。管理人将积极把握由于市场短期波动而可能带来的套利机会，通过跨市场、跨品种、跨期限等套利策略，力求获得超额收益。</p>
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

### 三、财务会计报告

#### 资产负债表（经审计）

会计主体：西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划

最后运作日：2025年7月17日

金额单位：人民币元

资产	最后运作日 2025年7月17日
<b>资产：</b>	
银行存款	141,786,481.43
结算备付金	
存出保证金	47,495.84
<b>资产总计</b>	<b>141,833,977.27</b>
<b>负债和所有者权益合计</b>	<b>最后运作日 2025年7月17日</b>
<b>负债：</b>	
应付管理人报酬	768,234.49
应付托管费	6,915.63
应付销售服务费	
应交税费	
应付利润	303,941.20
其他负债	16,173.10
<b>负债合计</b>	<b>1,095,264.42</b>
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	140,738,712.85
未分配利润	
<b>所有者权益合计</b>	<b>140,738,712.85</b>
<b>负债和所有者权益合计</b>	<b>141,833,977.27</b>

注：截至集合计划最后运作日2025年7月17日，西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划单位净值为1.0000元，份额总额140,738,712.85份，资产净值为140,738,712.85元。

### 四、清算报表附注

#### 1、集合计划

本集合计划由西部证券易储通现金管理集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来，原集合计划为现金管理产品，于2013年5月31日经中国证券业协会中证协函[2013]530号备案确认，自2013年5月13日起开始募集并于2013年5月20日结束募集，于2013年5月21日成立。

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》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更，并将集合计划名称变更为“西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划”。

经中国证监会批准，自 2022 年 7 月 20 日起，《西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划资产管理合同》生效，《西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

## 2、清算原因

根据《资产管理合同》第十九部分“合同的变更、终止与集合计划财产的清算”中的约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：……3、《资产管理合同》约定的其他情形”；《资产管理合同》第三部分“集合计划的基本情况”约定：“本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。”因《资产管理合同》于 2022 年 7 月 20 日生效，根据上述约定及根据管理人于 2025 年 7 月 17 日发布的《关于西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划资产管理合同终止及集合计划财产清算的公告》，本集合计划于 2025 年 7 月 17 日到期终止，2025 年 7 月 18 日进入清算程序。

## 3、清算起始日

本集合计划清算起始日为 2025 年 7 月 18 日。

## 4、清算报表编制基础

本集合计划的清算报表系本集合计划为集合计划财产清算而向中国证监会备案及公告清算报告之目的而编制。基于此目的，本清算报表系本集合计划财产清算小组在非持续经营基础上，参照《企业会计准则》及其相关规定、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《资产管理合同》的有关规定编制的。自本集合计划最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 五、清算情况

自 2025 年 7 月 18 日至 2025 年 7 月 21 日止的清算期间，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，全部清算工作按清算原则和清算

手续进行。具体清算情况如下：

### 1、资产处置情况

(1) 本集合计划最后运作日银行存款为 141,786,481.43 元，其中本金余额为 141,539,616.03 元，应计利息余额为 246,865.40 元。清算期间本金减少 141,065,668.17 元，计提银行存款利息 27.72 元。清算结束日银行存款为 720,840.98 元，其中本金余额为 473,947.86 元，应计利息余额为 246,893.12 元。

(2) 本集合计划最后运作日存出保证金为 47,495.84 元，其中本金为 47,482.98 元，应计利息余额为 12.86 元。清算期间本金无变动，计提利息 1.84 元。清算结束日存出保证金为 47,497.68 元，其中本金 47,482.98 元，应计利息余额为 14.70 元。

### 2、负债清偿情况

(1) 本集合计划最后运作日应付管理人报酬为 768,234.49 元，清算期间调减 419.15 元，系清算期损益的尾差调整，清算结束日应付管理人报酬为 767,815.34 元。

(2) 本集合计划最后运作日应付托管费为 6,915.63 元，该款项已于 2025 年 7 月 21 日支付。

(3) 本集合计划最后运作日应付利润为 303,941.20 元，清算期间调增 419.15 元，系清算期损益的尾差调整，该款项已于 2025 年 7 月 18 日和 2025 年 7 月 21 日支付。

(4) 本集合计划最后运作日其他负债为 16,173.10 元。其中银行间交易费用为 6,099.81 元，预提银行间账户维护费为 1,600.00 元，2025 年 7 月 21 日已支付上交所结算服务费 5,600.00 元和上交所账户维护费 1,600.00 元，剩余 499.81 元系银行间交易手续费，将于收到外汇交易中心缴费通知单后进行支付；预提审计费 8,273.29 元，为集合计划清算审计费用，该款项已于 2025 年 7 月 18 日支付；预提银行汇划费 200.00 元，该款项已于 2025 年 7 月 18 日划付赎回款时发生并进行支付。清算结束日其他负债为 499.81 元。

### 3、清算期间的损益情况

金额单位：人民币元

项目	2025年7月18日至2025年7月21日
一、清算收益①	29.56
1、存款利息收入	29.56
减：二、清算费用②	6.05
1、银行划款手续费	6.05
2、其他费用	
三、清算期间净收益①-②	23.51

#### 4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

金额单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2025年7月17日集合计划净资产	140,738,712.85
加：清算期间净收益	23.51
减：支付赎回款（于2025年7月18日确认的投资者赎回申请）	140,738,712.85
二、2025年7月21日集合计划净资产	23.51

资产处置及负债清偿后，2025年7月21日本集合计划剩余财产为23.51元。为保护集合计划份额持有人利益，加快清盘速度，应付管理人报酬金额暂未支付用于保证托管户资金能够足额支付清盘款项。暂未支付的管理人报酬金额及在账面产生的利息将于清算期后支付给管理人。截止2025年7月21日归属本集合计划份额持有人相关权益金额已支付完毕。本集合计划计提的各项生息资产利息收入和各项费用为合理估计金额，可能与实际发生金额存在微小差异，该部分微小差异所产生的损益由管理人承担。

#### 5、集合计划财产清算报告的告知安排

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，报中国证监会备案后向集合计划份额持有人公告。

## 六、备查文件目录

### 1、备查文件目录

(1) 《西部证券易储通现金管理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〈西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划清算报告〉的法律意见》。

## 2、存放地点

上述备查文本存放在本集合计划管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本集合计划管理人网站([www.west95582.com](http://www.west95582.com))查阅。

## 3、查阅方式

本报告存放在本集合计划管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

西部证券易储通现金管理型集合资产管理计划财产清算小组

2025年7月24日