

东证融汇汇选 A500 量化 1 号集合资产管理计划销售公告

东证融汇汇选 A500 量化 1 号集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)将于 2025 年 2 月 10 日正式发售,初始募集期为 2025 年 2 月 10 日至 2025 年 2 月 14 日。本集合计划管理人为东证融汇证券资产管理有限公司,托管人为浙商银行股份有限公司,注册登记机构为东证融汇证券资产管理有限公司。

本集合计划为混合类集合资产管理计划。首次参与的最低金额为人民币 40 万元(不含参与费用),超过最低参与金额的部分不设金额级差;追加参与的最低金额为人民币 1 万元,超过部分不设金额级差。

一、本集合计划投资范围

1、中国境内依法发行的上市公司股票(含主板、创业板、科创板,含二级市场投资、首次公开发行股票和非公开发行股票)、存托凭证、港股通标的股票。

2、中国境内依法发行的国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政策性金融债、可转债、可交债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、次级债(含二级资本债)、资产支持证券优先级、项目收益票据、银行存款(包括银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款)、债券

逆回购、同业存单、大额可转让存单、货币市场基金、债券型基金（含已按照《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》等规定完成规范及合同变更的比照公募基金管理的债券型证券公司大集合产品）。

3、股指期货、国债期货。

4、混合型基金（含已按照《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》等规定完成规范及合同变更的比照公募基金管理的混合型证券公司大集合产品）、股票型基金（含已按照《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》等规定完成规范及合同变更的比照公募基金管理的股票型证券公司大集合产品）、债券正回购。

二、本集合计划管理期限

自成立之日起，本集合计划管理期限为 10 年。

三、本集合计划运作方式

本集合计划自成立之日起每周开放不超过 3 个工作日，开放期内接受投资者的参与、退出申请。具体开放期以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根

据情况宣布提前结束或延期结束开放期。开放期的具体日期以管理人公告为准。

本集合计划对每份份额自参与日（初始募集期参与的，为本集合计划成立日；申购参与的，为参与日）起设置 90 个自然日的锁定期，锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务，法律法规及合同另有规定或约定的除外。

若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

除因合同变更、监管规则修订等情形，为保障投资者选择退出本集合资产管理计划权利外，本集合计划原则上不设定临时开放期。

四、本集合计划的开放期

自本集合计划成立之日起，每周四开放，开放期内接受投资者的参与申请和退出申请；如当周周四为非工作日，则顺延至下一工作日。若此开放规则有调整或其他额外的开放期安排，管理人将另行公告通知。每份份额 90 个自然日锁定期届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务。

（示例：本集合计划若于 2025 年 1 月 8 日成立，则初始募集期参与的份额将于 2025 年 4 月 7 日锁定期届满，则初始

募集期参与的份额可于 4 月 7 日（不含）之后的每个开放期办理退出。本示例仅作为举例作用，不代表本集合计划的实际开放期）

五、本集合计划的认购费

认购本集合计划的认购费率如下：

单笔认购金额（K）	认购费率
K<300 万元	1%
300 万元≤K<500 万元	0.5%
K≥500 万元	0

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+利息）/ 计划单位面值

上述计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的收益和损失由集合计划资产承担。

认购费用前端收取，由投资者承担，不列入集合计划资产。

认购费率可在法律法规和本合同约定范围内调低，具体方案详见管理人发布的相关公告。销售机构可对认购费率制定优惠规则，具体安排以销售机构为准。

六、本集合计划业绩报酬计提基准

本集合计划第一个业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准（年化）及业绩报酬计提比例如下：

业绩报酬计提基准 (K_{i1} 、 $K_{i2} \dots K_{i, n_i}$) (年化)	8%
业绩报酬计提比例 (G_{i1} 、 $G_{i2} \dots G_{i, n_i}$)	20%
业绩报酬计提规则	根据投资者每笔份额实际年化收益率(R)分段计提业绩报酬： (1) 当 $R \leq 8\%$ 时，业绩报酬计算结果为 0 (2) 当 $R > 8\%$ 时，计提超过 5.7% 部分的 20%

本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人业绩报酬计算的基准，供投资者参考，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。

七、本集合计划销售机构及相关信息

1、本集合计划的销售机构：

(1) 东北证券股份有限公司(代销)

网址：www.nesc.cn

服务热线：95360

(2) 东证融汇证券资产管理有限公司（直销）

网址：www.dzronghui.com

服务热线：021-80105551

2、本集合计划募集账户信息（直销）：

户名：东证融汇证券资产管理有限公司直销专户

银行账号：310066580018800040554

开户行：交通银行上海市浦东分行

大额支付号：301290050844

本集合计划的具体投资范围、比例及成立条件等详见《东证融汇汇选 A500 量化 1 号集合资产管理计划资产管理合同》和《东证融汇汇选 A500 量化 1 号集合资产管理计划说明书》。投资者在参与本集合计划前请仔细阅读以上法律文件，并按照销售机构的具体要求办理。

东证融汇证券资产管理有限公司

2025 年 1 月 23 日