

东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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

送出日期:2023 年 03 月 30 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。本年度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2023年3月17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。

本报告中财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2022年01月01日起至2022年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
8.3 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	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
8.6 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	76
8.7 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	77
8.8 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	77

8.9 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	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
8.12 投资组合报告附注	77
§9 基金份额持有人信息	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
9.3 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	79
§10 开放式基金份额变动	80
§11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
11.2 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	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8 其他重大事件	82
§12 影响投资者决策的其他重要信息	84
12.1 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	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§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	49,492,627.77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	37,546,038.98份	11,946,588.79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基准的投资回报。1、股票投资策略，本集合计划股票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	021-20361199	021-60637103
	电子邮箱	dzrhyy@nesc.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		021-20361067	021-60637228
传真		021-20361084	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 16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	田国立

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dzronghui.com
基金年度报告备置地点	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16层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2022年		2021年11月08日(基金合同生效日)-2021年12月31日	
	东证融汇成长优选A	东证融汇成长优选C	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	-2,856,246.2	-1,130,061.2	706,019.05	3,440.64

	0	9		
本期利润	-3,667,127.86	-398,606.36	842,659.77	-1,738.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0952	-0.0417	0.0235	-0.0084
本期加权平均净值利润率	-9.31%	-4.63%	2.13%	-0.85%
本期基金份额净值增长率	-8.91%	-9.25%	2.15%	-0.76%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	501,171.14	-1,187,907.80	4,004,477.36	-2,128.28
期末可供分配基金份额利润	0.0133	-0.0994	0.1124	-0.0076
期末基金资产净值	38,047,210.12	10,758,680.99	39,635,925.24	279,506.31
期末基金份额净值	1.0133	0.9006	1.1124	0.9924
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	-6.95%	-9.94%	2.15%	-0.76%

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12月31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

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

过去三个月	3.20%	1.14%	2.40%	0.92%	0.80%	0.22%
过去六个月	-4.93%	1.22%	-8.18%	0.99%	3.25%	0.23%
过去一年	-8.91%	1.42%	-18.28%	1.24%	9.37%	0.18%
自基金合同生效起至今	-6.95%	1.36%	-14.41%	1.17%	7.46%	0.19%

东证融汇成长优选C

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
过去三个月	3.10%	1.13%	2.40%	0.92%	0.70%	0.21%
过去六个月	-5.12%	1.22%	-8.18%	0.99%	3.06%	0.23%
过去一年	-9.25%	1.42%	-18.28%	1.24%	9.03%	0.18%
自基金合同生效起至今	-9.94%	1.37%	-17.23%	1.19%	7.29%	0.18%

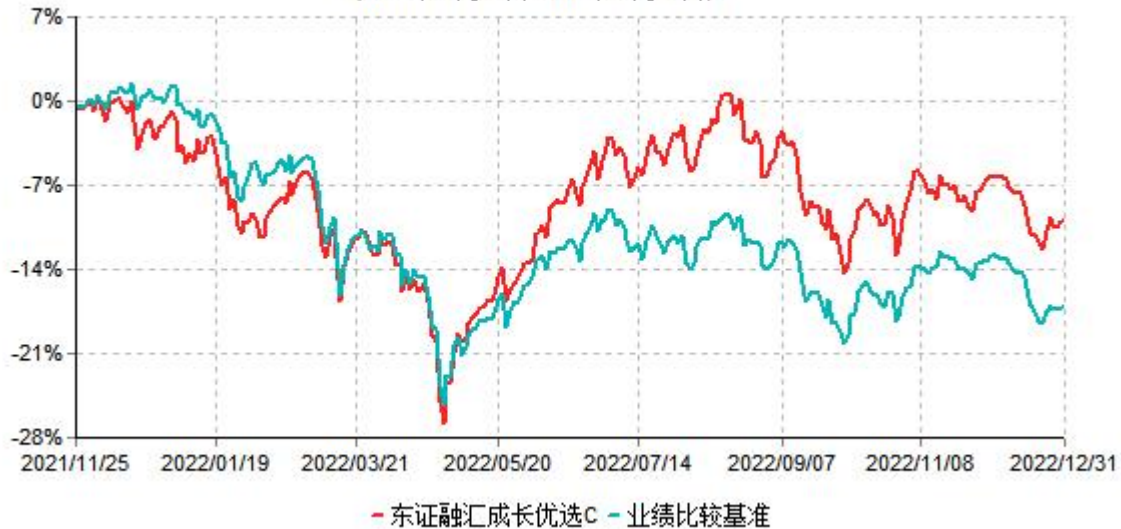
注：本集合计划合同于2021年11月08日生效。本集合计划C类份额于2021年11月25日首次申购确认，2021年11月08日至2021年11月24日期间，本集合计划C类份额为零。

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-2022年12月31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-2022年12月31日)

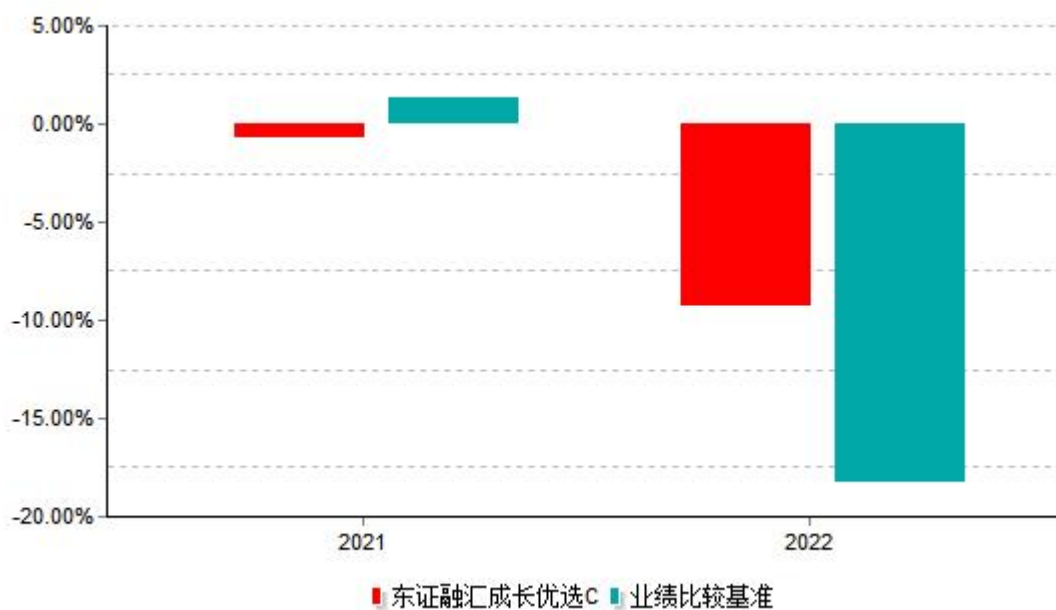


注：（1）净值表现所取数据截至2022年12月31日。

（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2022年12月31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2022年12月31日）计算。

（3）按照本集合计划合同的约定，管理人应自资产管理合同生效日起6个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。截至本报告期末，本集合计划已建仓完毕，建仓期结束时各项资产配置比例符合集合计划合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本集合计划合同生效日为2021年11月08日，合同生效当年（2021年）相关数据和指标按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本集合计划于2021年11月08日生效。自本集合计划合同生效以来未发生利润分配，符合相关法律法规规定及本集合计划合同的约定。

§4 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	-	5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7年量化投研工作经验，其中5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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《东证融汇证券资产管理有限公司公平交易管理办法》，明确公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易监控、分析、评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，覆盖在证券交易所和全国银行间债券市场等交易场所进行的股票、金融债券、企业债券、国债现券、国债回购和买卖等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、分析评估等各个环节。

具体控制措施包括：（1）在投资授权和研究分析环节，公司通过建立公平的投资授权和研究资源共享机制，为投资经理提供公平的投资机会。（2）在投资决策环节，公司建立健全投资对象备选库、交易对手备选库和系统的投资决策方法，以保证各资产管理计划交易决策的客观性和独立性。（3）在交易执行环节，公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

（4）在交易行为监控、分析、评估环节，公司对公平交易执行情况建立监控分析机制，

对异常交易行为进行核查。(5) 在报告分析环节, 公司定期编制公平交易分析报告, 对整体公平交易执行情况进行分析, 使相关人员及时了解各组合的公平交易执行状况, 持续督促公平交易制度的落实执行。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

回首刚过去的2022, A股市场的表现令投资者印象深刻。从全年维度看, 新冠防疫形势是驱动权益市场的主要矛盾, 比如三月上海奥密克戎疫情带来一波深度调整, 待上海疫情进入尾声市场迎来了二季度的触底反弹, 三季度全国各地依旧有零星散点疫情由此带来全年第二波回调, 四季度防疫措施优化后市场迎来第二波触底反弹。当然这个过程中伴随着诸多次要矛盾扰动短期走势, 比如俄乌冲突、美联储加息、美对中国企业无理打压等。

在产品管理上, 我们始终坚持以模型为基础, 根据对防疫形势和政策的预期变化动态调整主观逻辑, 进而辅助模型作出更优化的选择。比如在四季度, 我们适度加大了“疫后复苏”逻辑相关板块的配置, 在优选细分板块高成长潜力股基础上, 适当增配了经济触底反弹相关板块的低估值蓝筹股, 也正因如此, 在成长板块大幅回撤的四季度我们依然实现了小幅的超额收益。未来, 我们将持续坚持“量化+主动”的策略模式, 兼顾好投资的科学性与灵活性。

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1.0133元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.91%，同期业绩比较基准收益率为-18.28%；截至报告期末东证融汇成长优选C基金份额净值为0.9006元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.25%，同期业绩比较基准收益率为-18.28%。

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2023年，我们预期国内经济或将实现触底反弹，在充满不确定性的国际环境下，国内经济疫后的稳步复苏或将是相对确定的事。与此同时，我们预期政策在扩大内需、提振市场信心方面也将加力加码，权益市场表现或超预期。

具体到投资策略上，我们计划保持相对积极的仓位水平，板块配置上具备一定的进攻性。一方面，以量化模型为主，精选细分板块高成长潜力股票；另一方面，继续关注“疫后复苏逻辑”和“经济触底反弹”相关板块的配置机会。在产品层面，继续通过量化手段控制组合风险敞口暴露，秉承一贯的不博取行业收益、不博取个股收益，力争以组合形式为持有人带来波动可控、可持续的长期超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障旗下集合资产管理计划份额持有人利益，管理人不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，主要包括：

（1）制度体系建设

管理人密切关注法规政策变化及监管动态。根据相关法律法规重大调整、公司业务实际开展情况及需要，持续督导业务部门开展公司制度“立改废”工作，不断优化公司内部控制体系。

（2）监管信息追踪、传导与新规落实

管理人执行监管信息追踪与传导机制，通过合规日报、合规专刊等形式及时进行公司内部传达以及宣导，加强员工对监管动态、法律法规理解。对于重要法规政策变化，管理人及时制定相应的落实方案并跟进后续新规落实工作。

（3）日常合规管理工作

管理人通过合规审查、合规检查、合规监测、合规报告、合规提示、合规咨询、合规培训等工作切实履行日常合规管理职责，加强员工执业行为管理，保障管理人旗下集合资产管理计划合规运作。

（4）日常风险管理工作

管理人建立、完善公司风险控制机制，通过风险识别、评估、应对、管控、监控、报告等工作切实履行日常风险管理职责，持续提高风险管理能力，防范旗下集合资产管理计划运作风险。

4.7 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，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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。

本集合计划管理人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，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和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 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。

4.9 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，本集合计划存在连续二十个工作日集合资产净值低于五千万元的情形，时间范围为2022年02月24日至2022年03月28日、2022年04月20日至2022年07月04日、2022年07月21日至2022年09月26日；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》、集合计划资产管理合同、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、集合计划资产管理合同、托管协议和其他有关规定，对本集合计划的资产净值计算、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资产管理合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第28402号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划全体集合计划份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划(以下简称“东证融汇成长优选”)的财务报表,包括2022年12月31日和2021年12月31日的资产负债表,2022年度和2021年11月8日(集合计划合同生效日)至2021年12月31日止期间的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了东证融汇成长优选2022年12月31日的

	财务状况和2021年12月31日的财务状况以及2022年度和2021年11月8日(集合计划合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东证融汇成长优选，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	东证融汇成长优选的集合计划管理人东证融汇证券资产管理有限公司(以下简称“集合计划管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括东证融汇成长优选2022年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	东证融汇成长优选集合计划管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，集合计划管理人管理层负责评估东证融汇成长优选的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非集合计划管理人管理层计划清算东证融汇成长

	<p>优选、终止运营或别无其他现实的选择。集合计划管理人治理层负责监督东证融汇成长优选的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 评价集合计划管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四) 对集合计划管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东证融汇成长优选持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东证融汇成长优选不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与集合计划管理人治理层就计划的审计范围、时间安</p>

	排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	魏佳亮	张晓阳
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼	
审计报告日期	2023-03-28	

§7 年度财务报表

7.1 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：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,976,327.74	234,764.90
结算备付金		372,049.22	372,851.36
存出保证金		184,060.01	20,528.87
交易性金融资产	7.4.7.2	46,371,142.88	39,348,319.30
其中：股票投资		43,726,610.00	37,171,589.30
基金投资		-	-
债券投资		2,644,532.88	2,176,730.00
资产支持证券投 资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投		-	-

资			
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	520,346.44
应收股利		-	-
应收申购款		74,921.40	35,972.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	19,939.20
资产总计		48,978,501.25	40,552,722.91
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	368,337.66
应付赎回款		11,876.54	164,257.74
应付管理人报酬		50,188.27	40,675.27
应付托管费		8,364.70	6,779.20
应付销售服务费		3,626.48	83.91
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.25	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	98,553.90	57,157.58
负债合计		172,610.14	637,291.36
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	49,492,627.77	35,913,082.47
其他综合收益		-	-

未分配利润	7.4.7.8	-686,736.66	4,002,349.08
净资产合计		48,805,891.11	39,915,431.55
负债和净资产总计		48,978,501.25	40,552,722.91

注：（1）本财务报表的实际编制期间为2022年度和2021年11月8日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日止期间。

（2）报告截止日2022年12月31日，本集合计划份额总额49,492,627.77份。其中A类份额净值1.0133元，A类份额总额37,546,038.98份，C类份额净值0.9006元，C类份额总额11,946,588.79份。截止2021年12月31日，本集合计划份额总额35,913,082.47份。其中A类份额净值1.1124元，A类份额总额35,631,447.88份，C类份额净值0.9924元，C类份额总额281,634.59份。

7.2 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：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基 金合同生效日）至2 021年12月31日
一、营业总收入		-3,275,980.86	1,005,162.05
1.利息收入		17,217.73	4,634.02
其中：存款利息收入	7.4.7.9	17,217.73	3,655.39
债券利息收入		-	978.63
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）		-3,478,141.73	869,009.72
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,238,037.60	864,184.72
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	127,696.32	600.00

资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	35,865.85	-
股利收益	7.4.7.16	596,333.70	4,225.00
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-79,426.73	131,461.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	264,369.87	57.16
减：二、营业总支出		789,753.36	164,241.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	577,590.54	70,698.67
2. 托管费	7.4.10.2.2	96,265.17	11,783.09
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	34,767.35	83.91
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	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		0.30	-
8. 其他费用	7.4.7.20	81,130.00	81,675.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,065,734.22	840,920.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,065,734.22	840,920.84
五、其他综合收益的税后净		-	-

额			
六、综合收益总额		-4,065,734.22	840,920.84

7.3 净资产（基金净值）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：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	35,913,082.47	-	4,002,349.08	39,915,431.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	35,913,082.47	-	4,002,349.08	39,915,431.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	13,579,545.30	-	-4,689,085.74	8,890,459.56
（一）、综合收益总额	-	-	-4,065,734.22	-4,065,734.22
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	13,579,545.30	-	-623,351.52	12,956,193.78
其中：1.基金申购款	93,150,358.89	-	-6,036,793.65	87,113,565.24

2.基金 赎回款	-79,570,813.59	-	5,413,442.13	-74,157,371.46
(三)、本期向 基金份额持有 人分配利润产 生的基金净值 变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综 合收益结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净 值)	49,492,627.77	-	-686,736.66	48,805,891.11
项目	上年度可比期间 2021年11月08日(基金合同生效日)至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产(基金净 值)	-	-	-	-
加: 会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错 更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产(基金净 值)	35,938,531.60	-	3,189,982.35	39,128,513.95
三、本期增减变 动额(减少以“- ”号填列)	-25,449.13	-	812,366.73	786,917.60
(一)、综合收 益总额	-	-	840,920.84	840,920.84

（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-25,449.13	-	-28,554.11	-54,003.24
其中：1.基金申购款	632,344.07	-	40,464.99	672,809.06
2.基金赎回款	-657,793.20	-	-69,019.10	-726,812.30
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	35,913,082.47	-	4,002,349.08	39,915,431.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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2023年3月30日批准报出。

7.4.2 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》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划2022年度及2021年11月8日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日止期间的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2022年12月31日及2021年12月31日的财务状况以及2022年度及2021年11月8日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2022年度和2021年11月8日（集合计划合同生效日）至2021年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本集合计划成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本集合计划管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本集合计划持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本集合计划管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本集合计划将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本集合计划将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本集合计划将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本集合计划于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本集合计划以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本集合计划对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本集合计划考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本集合计划对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本集合计划按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本集合计划假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本集合计划对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本集合计划将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本集合计划于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本集合计划以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本集合计划于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本集合计划以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本集合计划同一类别每一集合计划份额享有同等分配权。本集合计划收益默认以现金形式分配，但集合计划份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的集合计划份额净值自动转为集合计划份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括集合计划经营活动产生的未实现损益以及集合计划份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配集合计划收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本集合计划的集合计划管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)

基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中债金融估值中心有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号--套期会计》及《企业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，资产管理产品自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本集合计划的管理人已采用上述准则及通知编制本集合计划2022年度财务报表，对本集合计划财务报表的影响列示如下：

(1) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本集合计划对于首次执行该准则的累积影响数调整

2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本集合计划均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收申购款、应收证券清算款，金额分别为234,764.90元、372,851.36元、20,528.87元、19,939.20元、35,972.84、520,346.44元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收申购款、应收证券清算款，金额分别为235,039.16元、373,035.50元、20,538.99元、0.00元、35,972.84、520,346.44元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为39,348,319.30元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为39,367,789.98元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付证券清算款，金额分别为164,257.74元、40,675.27元、6,779.20元、83.91元、44,157.58元、368,337.66元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付证券清算款，金额分别为164,257.74元、40,675.27元、6,779.20元、83.91元、44,157.58元、368,337.66元。

于2021年12月31日，本集合计划持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“应收申购款”、“应收证券清算款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本集合计划根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“应收申购款”、“应收证券清算款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(2) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本集合计划的集合计划管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本集合计划财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	1,976,327.74	234,764.90
等于：本金	1,976,057.55	234,764.90
加：应计利息	270.19	-
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	1,976,327.74	234,764.90

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	43,764,924.52	-	43,726,610.00	-38,314.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	45,872.88	2,644,532.88	-5,714.77
	银行间市场	-	-	-
	合计	45,872.88	2,644,532.88	-5,714.77
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	46,369,299.29	45,872.88	46,371,142.88	-44,029.29
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	37,178,469.86	-	37,171,589.30	-6,880.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债	交易所市场	-	2,176,730.00	-122.00

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,176,852.00	-	2,176,730.00	-122.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		39,355,321.86	-	39,348,319.30	-7,002.56

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	1,217,280.00	-	-	-
--股指期货	1,217,280.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,217,280.00	-	-	-
项目	上年度末 2021年12月31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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IC2303	中证500股指期货2 303合约	1.00	1,174,880.00	-42,400.00
合计				-42,400.00
减:可抵销 期货暂收 款				-42,400.00
净额				-

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。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	19,939.20
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	19,939.20

于2021年12月31日，其他资产合计金额19,939.20元，其中应收活期银行存款利息274.26元，应收结算备付金利息184.14元，应收存出保证金利息10.12元，应收债券利息19,470.68元。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1.86	-
应付交易费用	35,552.04	44,157.58
其中：交易所市场	35,552.04	44,157.58
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	63,000.00	13,000.00
合计	98,553.90	57,157.58

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 东证融汇成长优选A

金额单位：人民币元

项目 (东证融汇成长优选A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,631,447.88	35,631,447.88
本期申购	23,052,741.59	23,052,741.59
本期赎回（以“-”号填列）	-21,138,150.49	-21,138,150.49
本期末	37,546,038.98	37,546,038.98

7.4.7.7.2 东证融汇成长优选C

金额单位：人民币元

项目 (东证融汇成长优选C)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	281,634.59	281,634.59
本期申购	70,097,617.30	70,097,617.30

本期赎回（以“-”号填列）	-58,432,663.10	-58,432,663.10
本期末	11,946,588.79	11,946,588.79

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 东证融汇成长优选A

单位：人民币元

项目 (东证融汇成长优选A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	18,405,761.89	-14,401,284.53	4,004,477.36
本期利润	-2,856,246.20	-810,881.66	-3,667,127.86
本期基金份额交易产生的变动数	1,739,400.12	-1,575,578.48	163,821.64
其中：基金申购款	10,837,014.39	-10,151,823.85	685,190.54
基金赎回款	-9,097,614.27	8,576,245.37	-521,368.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,288,915.81	-16,787,744.67	501,171.14

7.4.7.8.2 东证融汇成长优选C

单位：人民币元

项目 (东证融汇成长优选C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,145.28	-5,273.56	-2,128.28
本期利润	-1,130,061.29	731,454.93	-398,606.36
本期基金份额交易产生的变动数	619,551.56	-1,406,724.72	-787,173.16
其中：基金申购款	-3,257,745.31	-3,464,238.88	-6,721,984.19
基金赎回款	3,877,296.87	2,057,514.16	5,934,811.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-507,364.45	-680,543.35	-1,187,907.80

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	11,995.02	2,778.01
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	4,753.71	833.05
其他	469.00	44.33
合计	17,217.73	3,655.39

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	394,612,386.93	47,817,623.18
减：卖出股票成本总额	398,204,173.48	46,953,438.46
减：交易费用	646,251.05	-
买卖股票差价收入	-4,238,037.60	864,184.72

7.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	52,930.28	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付）	74,766.04	600.00

差价收入		
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	127,696.32	600.00

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,488,049.52	2,511,750.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,317,623.23	2,496,000.00
减：应计利息总额	93,095.59	15,150.69
减：交易费用	2,564.66	-
买卖债券差价收入	74,766.04	600.00

7.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益--赎回差价收入。

7.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益--申购差价收入。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间收益金额 2021年11月08日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
期货投资	35,865.85	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	596,333.70	4,225.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	596,333.70	4,225.00

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至20 22年12月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-37,026.73	131,461.15
——股票投资	-31,433.96	132,833.15
——债券投资	-5,592.77	-1,372.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2.衍生工具	-42,400.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-42,400.00	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-79,426.73	131,461.15

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。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	264,369.87	57.16
合计	264,369.87	57.16

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。

7.4.7.19 信用减值损失

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
审计费用	13,000.00	1,922.18
信息披露费	50,000.00	-
汇划手续费	130.00	320.92
帐户维护费	18,000.00	-484.75

其他费用	-	50.00
交易费用	-	79,867.19
合计	81,130.00	81,675.54

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
建设银行	集合计划托管人、集合计划销售机构
东证融汇融誉FOF2号集合资产管理计划	集合计划管理人管理的资产管理计划、集合计划份额持有人

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效日） 至2021年12月31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	799,333,810.07	100.00%	97,228,882.49	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期内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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效日） 至2021年12月31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	12,823,201.27	100.00%	4,673,452.00	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

本集合计划本报告期内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。

7.4.10.1.5 基金交易

本集合计划本报告期内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。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31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	187,438.90	100.00%	35,552.04	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效日）至2021年12月31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	23,418.86	100.00%	44,157.58	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、经手费等的净额列示。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同 生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	577,590.54	70,698.67
其中：支付销售机构的客户维护费	231,346.67	28,631.74

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	96,265.17	11,783.09

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31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
建设银行	0.00	5.07	5.07
东北证券	0.00	22,200.44	22,200.44
东证融汇	0.00	5,909.22	5,909.22
合计	-	28,114.73	28,114.73
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效日）至2021年12月31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	0.00	78.66	78.66
合计	0.00	78.66	78.66

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。

7.4.10.3 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内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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2022年01月01 日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金 合同生效日）至2021年1 月31日
基金合同生效日（2021年11月08日）持有的基金份额	5,574,453.07	5,574,453.07
报告期初持有的基金份额	5,574,453.07	5,574,453.07
报告期间申购/买入总份额	1,895,285.48	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	6,469,738.55	5,574,453.07
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.23%	15.64%

东证融汇成长优选C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01 日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年11月08日（基金 合同生效日）至2021年1 月31日
基金合同生效日（2021年11月08日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

例		
---	--	--

注：（1）本报告期内，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）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。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

东证融汇成长优选C

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
东证融汇融誉FOF 2号集合资产管理计划	3,357,582.54	28.10%	0.00	0.00%

注：（1）本报告期内，除管理人之外的其他关联方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）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。

7.4.10.5 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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年11月08日（基金合同生效日） 至2021年12月31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	1,976,327.74	11,995.02	234,764.90	2,778.01

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。

7.4.10.6 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内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内没有须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日止，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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日止，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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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2022年12月31日，本集合计划未持有除国债以外的债券(2021年12月31日：同)。

7.4.13.2.1 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	2,644,532.88	2,196,200.68
合计	2,644,532.88	2,196,200.68

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。

7.4.13.3 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。

集合计划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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

集合计划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7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 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							
银行存款	1,976,327.74	-	-	-	-	-	1,976,327.74
结算备付金	142,066.57	-	-	-	-	229,982.65	372,049.22
存出保证金	184,060.01	-	-	-	-	-	184,060.01
交易性金融资产	2,040,419.18	-	604,113.70	-	-	43,726,610.00	46,371,142.88
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	74,921.40	74,921.40
资产总计	4,342,873.50	-	604,113.70	-	-	44,031,514.05	48,978,501.25
负债							

东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划 2022 年年度报告

应付赎回款	-	-	-	-	-	11,876.54	11,876.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,188.27	50,188.27
应付托管费	-	-	-	-	-	8,364.70	8,364.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,626.48	3,626.48
应交税费	-	-	-	-	-	0.25	0.25
其他负债	-	-	-	-	-	98,553.90	98,553.90
负债总计	-	-	-	-	-	172,610.14	172,610.14
利率敏感度缺口	4,342,873.50	-	604,113.70	-	-	43,858,903.91	48,805,891.11
上年度末 2021年 12月31 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							
银行存款	234,764.90	-	-	-	-	-	234,764.90
结算备付金	371,851.36	-	-	-	-	1,000.00	372,851.36
存出保证金	20,528.87	-	-	-	-	-	20,528.87
交易性金融资产	-	-	2,176,730.00	-	-	37,171,589.30	39,348,319.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	520,346.44	520,346.44
应收利息	-	-	-	-	-	19,939.20	19,939.20
应收申购款	-	-	-	-	-	35,972.84	35,972.84
资产总计	627,145.13	-	2,176,730.00	-	-	37,748,847.78	40,552,722.91
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	368,337.66	368,337.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	164,257.74	164,257.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,675.27	40,675.27
应付托	-	-	-	-	-	6,779.20	6,779.20

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	83.91	83.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	44,157.58	44,157.58
其他负债	-	-	-	-	-	13,000.00	13,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	637,291.36	637,291.36
利率敏感度缺口	627,145.13	-	2,176,730.00	-	-	37,111,556.42	39,915,431.55

7.4.13.4.1.2 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率下降25个基点	996.54	2,974.73
	市场利率上升25个基点	-993.00	-2,963.39

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021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	43,726,610.00	89.59	37,171,589.30	93.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	43,726,610.00	89.59	37,171,589.30	93.13

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注7.4.7.3)。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。

7.4.13.4.3.2 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	中证500指数上升5%	2,169,597.86	2,453,324.89
	中证500指数下降5%	-2,169,597.86	-2,453,324.89

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	43,726,610.00	37,171,589.30
第二层次	2,644,532.88	2,176,730.00
第三层次	-	-
合计	46,371,142.88	39,348,319.30

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	43,726,610.00	89.28
	其中：股票	43,726,610.00	89.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,644,532.88	5.40
	其中：债券	2,644,532.88	5.40
	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	2,348,376.96	4.79
8	其他各项资产	258,981.41	0.53
9	合计	48,978,501.25	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	545,524.00	1.12
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,540,195.00	58.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	755,250.00	1.55
E	建筑业	525,360.00	1.08
F	批发和零售业	3,420,687.00	7.01
G	交通运输、仓储和邮政业	593,780.00	1.22
H	住宿和餐饮业	741,900.00	1.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,052,480.00	2.16
J	金融业	7,170,472.00	14.69
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	380,962.00	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	43,726,610.00	89.59

8.2.2 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。

8.3 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(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	603198	迎驾贡酒	7,800	489,684.00	1.00
2	600702	舍得酒业	2,900	461,622.00	0.95
3	300896	爱美客	800	453,080.00	0.93
4	000799	酒鬼酒	3,200	441,408.00	0.90
5	002561	徐家汇	30,000	420,300.00	0.86
6	603587	地素时尚	27,000	410,940.00	0.84
7	603919	金徽酒	15,000	401,250.00	0.82
8	603214	爱婴室	22,000	397,760.00	0.81
9	000417	合肥百货	72,000	392,400.00	0.80
10	600298	安琪酵母	8,500	384,370.00	0.79
11	603199	九华旅游	13,400	380,962.00	0.78
12	605108	同庆楼	10,000	372,300.00	0.76
13	601007	金陵饭店	30,000	369,600.00	0.76
14	600814	杭州解百	50,000	369,500.00	0.76

15	601166	兴业银行	21,000	369,390.00	0.76
16	000858	五粮液	2,000	361,380.00	0.74
17	600958	东方证券	40,000	357,600.00	0.73
18	603055	台华新材	34,900	352,490.00	0.72
19	000999	华润三九	7,500	351,075.00	0.72
20	603589	口子窖	6,000	346,020.00	0.71
21	600016	民生银行	100,000	345,000.00	0.71
22	600000	浦发银行	47,000	342,160.00	0.70
23	600779	水井坊	4,000	337,680.00	0.69
24	002727	一心堂	10,700	337,157.00	0.69
25	601116	三江购物	29,000	329,150.00	0.67
26	002304	洋河股份	2,000	321,000.00	0.66
27	600398	海澜之家	60,000	318,000.00	0.65
28	000001	平安银行	24,000	315,840.00	0.65
29	000568	泸州老窖	1,400	313,992.00	0.64
30	603877	太平鸟	17,000	312,630.00	0.64
31	605009	豪悦护理	6,000	311,220.00	0.64
32	601818	光大银行	100,000	307,000.00	0.63
33	601688	华泰证券	24,000	305,760.00	0.63
34	000878	云南铜业	26,000	305,500.00	0.63
35	603369	今世缘	6,000	305,400.00	0.63
36	603883	老百姓	7,500	303,525.00	0.62
37	600030	中信证券	15,000	298,650.00	0.61
38	601788	光大证券	20,000	297,400.00	0.61
39	300684	中石科技	20,000	296,200.00	0.61
40	601319	中国人保	56,000	292,320.00	0.60
41	600933	爱柯迪	16,000	291,360.00	0.60
42	000651	格力电器	9,000	290,880.00	0.60
43	300532	今天国际	20,000	289,600.00	0.59
44	688589	力合微	8,500	287,470.00	0.59
45	601377	兴业证券	50,000	287,000.00	0.59

46	600036	招商银行	7,700	286,902.00	0.59
47	603336	宏辉果蔬	41,000	285,360.00	0.58
48	601066	中信建投	12,000	285,000.00	0.58
49	601108	财通证券	40,000	284,800.00	0.58
50	600060	海信视像	21,000	284,340.00	0.58
51	601038	一拖股份	25,000	282,500.00	0.58
52	601318	中国平安	6,000	282,000.00	0.58
53	002832	比音勒芬	11,000	281,710.00	0.58
54	600233	圆通速递	14,000	281,260.00	0.58
55	600976	健民集团	5,500	273,295.00	0.56
56	002324	普利特	17,000	272,000.00	0.56
57	002371	北方华创	1,200	270,360.00	0.55
58	600284	浦东建设	40,000	269,600.00	0.55
59	603179	新泉股份	7,000	269,430.00	0.55
60	002885	京泉华	9,000	268,380.00	0.55
61	600999	招商证券	20,000	266,000.00	0.55
62	688066	航天宏图	3,100	265,050.00	0.54
63	600732	爱旭股份	7,000	264,740.00	0.54
64	000791	甘肃电投	50,000	264,000.00	0.54
65	688123	聚辰股份	2,600	263,120.00	0.54
66	601555	东吴证券	40,000	261,200.00	0.54
67	600109	国金证券	30,000	261,000.00	0.53
68	600098	广州发展	47,000	260,850.00	0.53
69	300580	贝斯特	14,000	260,680.00	0.53
70	300693	盛弘股份	4,800	260,544.00	0.53
71	300272	开能健康	50,000	260,500.00	0.53
72	002518	科士达	4,500	259,200.00	0.53
73	000333	美的集团	5,000	259,000.00	0.53
74	000726	鲁泰 A	34,800	256,824.00	0.53
75	600039	四川路桥	23,000	255,760.00	0.52
76	603328	依顿电子	38,600	250,514.00	0.51

77	600761	安徽合力	19,000	249,850.00	0.51
78	300438	鹏辉能源	3,200	249,568.00	0.51
79	002311	海大集团	4,000	246,920.00	0.51
80	601601	中国太保	10,000	245,200.00	0.50
81	002606	大连电瓷	26,000	243,880.00	0.50
82	600963	岳阳林纸	44,000	239,800.00	0.49
83	603596	伯特利	3,000	239,400.00	0.49
84	300502	新易盛	10,000	237,500.00	0.49
85	603605	珀莱雅	1,400	234,472.00	0.48
86	603031	安孚科技	5,000	233,250.00	0.48
87	600345	长江通信	15,000	232,650.00	0.48
88	300258	精锻科技	20,000	232,600.00	0.48
89	601881	中国银河	25,000	232,250.00	0.48
90	002839	张家港行	50,000	230,500.00	0.47
91	002938	鹏鼎控股	8,400	230,496.00	0.47
92	600236	桂冠电力	40,000	230,400.00	0.47
93	603583	捷昌驱动	9,000	230,040.00	0.47
94	601567	三星医疗	17,000	229,160.00	0.47
95	000915	华特达因	5,000	227,500.00	0.47
96	601128	常熟银行	30,000	226,500.00	0.46
97	300514	友讯达	22,000	225,500.00	0.46
97	002985	北摩高科	5,000	225,500.00	0.46
99	603699	纽威股份	20,000	222,000.00	0.45
100	000400	许继电气	11,000	219,670.00	0.45
101	300308	中际旭创	8,000	216,240.00	0.44
102	300129	泰胜风能	30,000	215,100.00	0.44
103	003011	海象新材	10,000	213,700.00	0.44
104	000783	长江证券	40,000	213,200.00	0.44
105	603185	上机数控	2,000	211,700.00	0.43
106	300075	数字政通	12,000	210,360.00	0.43
107	603477	巨星农牧	8,600	209,754.00	0.43

108	300200	高盟新材	30,000	209,700.00	0.43
109	300856	科思股份	4,000	208,600.00	0.43
110	600741	华域汽车	12,000	207,960.00	0.43
111	600015	华夏银行	40,000	207,600.00	0.43
112	601916	浙商银行	70,000	205,800.00	0.42
113	603129	春风动力	1,800	202,536.00	0.41
114	605258	协和电子	8,000	201,040.00	0.41
115	002338	奥普光电	9,000	200,610.00	0.41
116	002318	久立特材	12,000	199,680.00	0.41
117	603355	莱克电气	7,100	199,084.00	0.41
118	600481	双良节能	15,300	197,982.00	0.41
119	002634	棒杰股份	20,000	196,600.00	0.40
120	601231	环旭电子	12,000	194,760.00	0.40
121	300516	久之洋	8,000	194,720.00	0.40
122	000795	英洛华	30,000	194,700.00	0.40
123	603128	华贸物流	18,000	193,320.00	0.40
124	600563	法拉电子	1,200	191,856.00	0.39
125	002158	汉钟精机	8,000	191,600.00	0.39
126	000049	德赛电池	4,400	191,312.00	0.39
127	688599	天合光能	3,000	191,280.00	0.39
128	002809	红墙股份	20,000	190,600.00	0.39
129	002299	圣农发展	8,000	189,520.00	0.39
130	688063	派能科技	600	189,390.00	0.39
131	603368	柳药集团	10,000	186,700.00	0.38
132	605099	共创草坪	8,000	185,600.00	0.38
133	688050	爱博医疗	800	184,560.00	0.38
134	002849	威星智能	10,000	184,300.00	0.38
135	688617	惠泰医疗	600	184,158.00	0.38
136	601163	三角轮胎	15,000	183,150.00	0.38
137	002698	博实股份	13,000	182,130.00	0.37
138	300314	戴维医疗	14,000	181,720.00	0.37

139	000691	亚太实业	40,000	181,600.00	0.37
140	603787	新日股份	10,000	181,000.00	0.37
141	002959	小熊电器	3,000	180,960.00	0.37
142	603876	鼎胜新材	4,400	180,576.00	0.37
143	688556	高测股份	2,400	180,048.00	0.37
144	003020	立方制药	5,500	177,650.00	0.36
145	600660	福耀玻璃	5,000	175,350.00	0.36
146	688518	联赢激光	6,000	175,260.00	0.36
147	600519	贵州茅台	100	172,700.00	0.35
148	603298	杭叉集团	10,000	168,100.00	0.34
149	300640	德艺文创	30,000	168,000.00	0.34
150	002837	英维克	5,000	166,550.00	0.34
151	688386	泛亚微透	3,000	166,350.00	0.34
152	603399	吉翔股份	12,000	165,600.00	0.34
153	605388	均瑶健康	11,000	165,440.00	0.34
154	002955	鸿合科技	7,000	164,850.00	0.34
155	600901	江苏租赁	30,000	164,400.00	0.34
156	603305	旭升集团	5,000	161,200.00	0.33
157	603556	海兴电力	9,000	158,400.00	0.32
158	002430	杭氧股份	4,000	157,440.00	0.32
159	688639	华恒生物	1,000	155,250.00	0.32
160	300575	中旗股份	7,000	153,090.00	0.31
161	605077	华康股份	5,000	151,700.00	0.31
162	603283	赛腾股份	5,000	150,150.00	0.31
163	600210	紫江企业	30,000	150,000.00	0.31
164	002111	威海广泰	15,000	149,550.00	0.31
165	002714	牧原股份	3,000	146,250.00	0.30
166	300943	春晖智控	12,000	144,840.00	0.30
167	688559	海目星	2,500	144,600.00	0.30
168	300698	万马科技	6,000	142,080.00	0.29
169	002843	泰嘉股份	7,000	141,960.00	0.29

170	002947	恒铭达	7,000	138,250.00	0.28
171	300260	新莱应材	2,000	134,200.00	0.27
172	688505	复旦张江	16,000	133,600.00	0.27
173	002444	巨星科技	7,000	132,860.00	0.27
174	601869	长飞光纤	4,000	130,520.00	0.27
175	688389	普门科技	7,000	124,810.00	0.26
176	300450	先导智能	3,000	120,750.00	0.25
177	603158	腾龙股份	17,000	120,530.00	0.25
178	600428	中远海特	20,000	119,200.00	0.24
179	300547	川环科技	8,000	115,520.00	0.24
180	300724	捷佳伟创	1,000	114,020.00	0.23
181	300820	英杰电气	1,500	110,220.00	0.23
182	300743	天地数码	5,200	60,164.00	0.12
183	601908	京运通	5,000	32,850.00	0.07

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300059	东方财富	2,558,227.00	6.41
2	002821	凯莱英	2,260,483.00	5.66
3	300363	博腾股份	1,550,717.00	3.89
4	002460	赣锋锂业	1,512,416.00	3.79
5	002371	北方华创	1,485,924.00	3.72
6	002258	利尔化学	1,472,282.00	3.69
7	300450	先导智能	1,440,973.00	3.61
8	002304	洋河股份	1,405,954.00	3.52
9	601689	拓普集团	1,319,500.00	3.31
10	603360	百傲化学	1,310,316.00	3.28
11	002738	中矿资源	1,285,598.00	3.22

12	603339	四方科技	1,262,387.00	3.16
13	603198	迎驾贡酒	1,240,529.00	3.11
14	688085	三友医疗	1,238,178.23	3.10
15	600180	瑞茂通	1,213,171.00	3.04
16	600496	精工钢构	1,190,050.00	2.98
17	002920	德赛西威	1,175,849.00	2.95
18	300750	宁德时代	1,158,799.00	2.90
19	300628	亿联网络	1,156,521.00	2.90
20	300772	运达股份	1,149,455.51	2.88
21	002455	百川股份	1,146,472.00	2.87
22	688005	容百科技	1,138,091.76	2.85
23	300347	泰格医药	1,136,465.00	2.85
24	600519	贵州茅台	1,133,407.00	2.84
25	600233	圆通速递	1,131,572.00	2.83
26	603305	旭升集团	1,127,508.00	2.82
27	688313	仕佳光子	1,123,391.04	2.81
28	600873	梅花生物	1,123,224.00	2.81
29	601377	兴业证券	1,122,090.00	2.81
30	300432	富临精工	1,121,551.00	2.81
31	688116	天奈科技	1,121,017.01	2.81
32	002819	东方中科	1,108,486.00	2.78
33	601116	三江购物	1,106,227.00	2.77
34	600030	中信证券	1,103,331.00	2.76
35	002756	永兴材料	1,101,749.00	2.76
36	600929	雪天盐业	1,098,444.00	2.75
37	002829	星网宇达	1,094,390.00	2.74
38	601881	中国银河	1,090,754.00	2.73
39	603477	巨星农牧	1,086,945.00	2.72
40	600673	东阳光	1,079,138.00	2.70
41	002625	光启技术	1,078,254.00	2.70
42	600160	巨化股份	1,077,534.00	2.70

43	600348	华阳股份	1,070,819.00	2.68
44	601226	华电重工	1,052,973.00	2.64
45	300170	汉得信息	1,051,921.00	2.64
46	000728	国元证券	1,048,838.00	2.63
47	000970	中科三环	1,041,397.00	2.61
48	300475	香农芯创	1,020,354.00	2.56
49	000895	双汇发展	1,019,286.00	2.55
50	300260	新莱应材	1,015,102.00	2.54
51	688196	卓越新能	1,014,713.98	2.54
52	000603	盛达资源	1,014,133.00	2.54
53	600438	通威股份	1,011,988.00	2.54
54	600702	舍得酒业	1,006,343.00	2.52
55	600109	国金证券	1,004,064.00	2.52
56	601615	明阳智能	988,294.06	2.48
57	000333	美的集团	987,870.00	2.47
58	603283	赛腾股份	977,951.00	2.45
59	000878	云南铜业	977,803.00	2.45
60	603919	金徽酒	977,296.00	2.45
61	603896	寿仙谷	975,938.00	2.45
62	600980	北矿科技	958,651.00	2.40
63	002562	兄弟科技	957,535.00	2.40
64	300401	花园生物	956,544.00	2.40
65	002182	云海金属	954,410.00	2.39
66	600546	山煤国际	952,743.00	2.39
67	002041	登海种业	951,329.00	2.38
68	002709	天赐材料	948,642.00	2.38
69	002204	大连重工	946,365.00	2.37
70	600141	兴发集团	940,578.00	2.36
71	603799	华友钴业	935,068.00	2.34
72	600535	天士力	933,950.00	2.34
73	600123	兰花科创	930,865.00	2.33

74	600039	四川路桥	930,706.00	2.33
75	600563	法拉电子	928,406.00	2.33
76	300596	利安隆	922,575.00	2.31
77	300801	泰和科技	921,760.00	2.31
78	600596	新安股份	918,170.00	2.30
79	603585	苏利股份	915,692.00	2.29
80	600888	新疆众和	912,625.00	2.29
81	605366	宏柏新材	911,854.00	2.28
82	000790	华神科技	909,628.00	2.28
83	002352	顺丰控股	902,800.00	2.26
84	002344	海宁皮城	899,832.00	2.25
85	000983	山西焦煤	894,489.88	2.24
86	000713	丰乐种业	886,584.00	2.22
87	300341	麦克奥迪	880,949.00	2.21
88	600378	昊华科技	878,602.00	2.20
89	601339	百隆东方	877,703.00	2.20
90	600188	兖矿能源	876,468.00	2.20
91	300373	扬杰科技	871,513.00	2.18
92	603088	宁波精达	870,131.00	2.18
93	300787	海能实业	869,203.00	2.18
94	600722	金牛化工	867,615.00	2.17
95	002241	歌尔股份	867,016.00	2.17
96	000933	神火股份	864,880.00	2.17
97	601318	中国平安	861,096.00	2.16
98	002966	苏州银行	854,673.00	2.14
99	000408	藏格矿业	848,939.00	2.13
100	002993	奥海科技	844,804.00	2.12
101	600499	科达制造	843,033.00	2.11
102	688599	天合光能	842,621.08	2.11
103	600360	华微电子	841,315.00	2.11
104	600859	王府井	828,843.00	2.08

105	603290	斯达半导	827,876.00	2.07
106	002326	永太科技	827,489.00	2.07
107	603883	老百姓	822,013.00	2.06
108	002407	多氟多	821,500.00	2.06
109	600521	华海药业	821,141.00	2.06
110	000915	华特达因	819,957.00	2.05
111	000997	新大陆	819,818.00	2.05
112	688559	海目星	819,470.00	2.05
113	002812	恩捷股份	818,727.00	2.05
114	603668	天马科技	817,784.00	2.05
115	603327	福蓉科技	816,776.00	2.05
116	002977	天箭科技	815,159.00	2.04
117	000568	泸州老窖	810,837.00	2.03
118	603976	正川股份	809,786.00	2.03
119	601666	平煤股份	808,923.00	2.03
120	000517	荣安地产	808,740.00	2.03
121	603369	今世缘	807,641.10	2.02
122	601137	博威合金	807,580.00	2.02
123	603613	国联股份	806,489.00	2.02
124	002049	紫光国微	804,651.00	2.02
125	600251	冠农股份	798,350.00	2.00

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。

8.4.2 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	300059	东方财富	2,502,011.00	6.27
2	002821	凯莱英	2,094,453.40	5.25
3	600180	瑞茂通	1,559,687.00	3.91

4	600123	兰花科创	1,474,878.00	3.70
5	002460	赣锋锂业	1,446,427.00	3.62
6	002258	利尔化学	1,434,363.40	3.59
7	300363	博腾股份	1,434,216.00	3.59
8	601615	明阳智能	1,377,831.00	3.45
9	603360	百傲化学	1,370,375.00	3.43
10	601689	拓普集团	1,326,029.00	3.32
11	002241	歌尔股份	1,324,534.05	3.32
12	002371	北方华创	1,318,761.26	3.30
13	002738	中矿资源	1,316,557.00	3.30
14	300260	新莱应材	1,316,221.00	3.30
15	300432	富临精工	1,312,445.00	3.29
16	000983	山西焦煤	1,286,172.00	3.22
17	300750	宁德时代	1,265,047.00	3.17
18	002709	天赐材料	1,260,612.21	3.16
19	600888	新疆众和	1,257,748.00	3.15
20	603305	旭升集团	1,242,050.00	3.11
21	601666	平煤股份	1,233,059.00	3.09
22	300390	天华超净	1,232,683.00	3.09
23	002756	永兴材料	1,222,237.00	3.06
24	002920	德赛西威	1,209,465.00	3.03
25	600389	江山股份	1,199,398.00	3.00
26	300450	先导智能	1,181,366.00	2.96
27	603259	药明康德	1,179,752.00	2.96
28	601881	中国银河	1,173,376.00	2.94
29	603339	四方科技	1,158,415.00	2.90
30	600496	精工钢构	1,145,120.00	2.87
31	002326	永太科技	1,135,888.00	2.85
32	688085	三友医疗	1,132,919.70	2.84
33	000408	藏格矿业	1,129,092.00	2.83
34	002304	洋河股份	1,124,757.09	2.82

35	603599	广信股份	1,119,203.00	2.80
36	603976	正川股份	1,119,011.00	2.80
37	600873	梅花生物	1,113,636.00	2.79
38	600673	东阳光	1,109,489.00	2.78
39	002204	大连重工	1,103,874.00	2.77
40	600295	鄂尔多斯	1,103,271.00	2.76
41	000333	美的集团	1,102,809.00	2.76
42	300628	亿联网络	1,080,444.00	2.71
43	600160	巨化股份	1,075,850.00	2.70
44	000728	国元证券	1,074,230.00	2.69
45	002977	火箭科技	1,071,189.00	2.68
46	600348	华阳股份	1,069,515.00	2.68
47	000895	双汇发展	1,069,133.00	2.68
48	603260	合盛硅业	1,062,717.00	2.66
49	600438	通威股份	1,062,344.00	2.66
50	600929	雪天盐业	1,054,633.00	2.64
51	002455	百川股份	1,050,788.00	2.63
52	605366	宏柏新材	1,043,568.00	2.61
53	300772	运达股份	1,042,512.40	2.61
54	600546	山煤国际	1,041,417.00	2.61
55	300037	新宙邦	1,040,146.20	2.61
56	002119	康强电子	1,039,844.00	2.61
57	300347	泰格医药	1,025,378.00	2.57
58	600256	广汇能源	1,015,626.00	2.54
59	002790	瑞尔特	1,002,763.00	2.51
60	688313	仕佳光子	1,000,896.27	2.51
61	600188	兖矿能源	999,036.00	2.50
62	601226	华电重工	997,811.18	2.50
63	603283	赛腾股份	997,639.00	2.50
64	000603	盛达资源	989,420.00	2.48
65	603896	寿仙谷	988,792.00	2.48

66	300596	利安隆	977,725.00	2.45
67	600141	兴发集团	973,737.00	2.44
68	600535	天士力	971,825.00	2.43
69	002562	兄弟科技	969,619.00	2.43
70	300170	汉得信息	967,239.00	2.42
71	002539	云图控股	965,164.00	2.42
72	002829	星网宇达	963,901.00	2.41
73	000790	华神科技	958,800.00	2.40
74	688116	天奈科技	955,440.86	2.39
75	600596	新安股份	953,961.00	2.39
76	300401	花园生物	952,827.00	2.39
77	603327	福蓉科技	952,192.00	2.39
78	000933	神火股份	951,387.00	2.38
79	002625	光启技术	951,333.00	2.38
80	002819	东方中科	950,791.00	2.38
81	600096	云天化	948,313.00	2.38
82	002730	电光科技	941,534.00	2.36
83	002041	登海种业	941,521.00	2.36
84	600519	贵州茅台	939,909.00	2.35
85	002182	云海金属	939,767.63	2.35
86	000823	超声电子	936,773.00	2.35
87	002352	顺丰控股	934,414.00	2.34
88	300475	香农芯创	931,409.00	2.33
89	000970	中科三环	928,826.00	2.33
90	688196	卓越新能	920,648.73	2.31
91	603668	天马科技	917,846.00	2.30
92	000713	丰乐种业	914,969.00	2.29
93	688012	中微公司	904,000.00	2.26
94	300341	麦克奥迪	903,015.00	2.26
95	002966	苏州银行	901,734.00	2.26
96	600765	中航重机	896,989.00	2.25

97	600867	通化东宝	896,736.00	2.25
98	300801	泰和科技	894,984.00	2.24
99	603088	宁波精达	889,127.00	2.23
100	002240	盛新锂能	886,746.00	2.22
101	601137	博威合金	885,258.00	2.22
102	603585	苏利股份	884,748.00	2.22
103	002407	多氟多	882,287.00	2.21
104	002993	奥海科技	880,340.12	2.21
105	002344	海宁皮城	878,723.00	2.20
106	603290	斯达半导	876,905.00	2.20
107	600980	北矿科技	870,355.00	2.18
108	688005	容百科技	864,730.26	2.17
109	601377	兴业证券	861,060.00	2.16
110	300496	中科创达	856,188.00	2.15
111	603688	石英股份	854,648.00	2.14
112	000517	荣安地产	853,309.00	2.14
113	603613	国联股份	847,434.00	2.12
114	600722	金牛化工	846,323.00	2.12
115	603392	万泰生物	837,811.00	2.10
116	300787	海能实业	836,051.00	2.09
117	603799	华友钴业	833,862.00	2.09
118	600378	昊华科技	830,865.00	2.08
119	603198	迎驾贡酒	829,011.00	2.08
120	000960	锡业股份	826,171.00	2.07
121	601199	江南水务	825,656.00	2.07
122	002011	盾安环境	823,815.00	2.06
123	002943	宇晶股份	823,268.00	2.06
124	601339	百隆东方	822,760.00	2.06
125	002807	江阴银行	822,463.38	2.06
126	601116	三江购物	815,331.00	2.04
127	300852	四会富仕	814,675.00	2.04

128	600233	圆通速递	813,487.00	2.04
129	600971	恒源煤电	808,311.00	2.03
130	603871	嘉友国际	806,624.92	2.02
131	300373	扬杰科技	803,199.00	2.01
132	300777	中简科技	800,912.00	2.01
133	300755	华致酒行	800,196.00	2.00

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。

8.4.3 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	404,790,628.14
卖出股票收入（成交）总额	394,612,386.93

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。

8.5 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	2,644,532.88	5.42
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	2,644,532.88	5.42

8.6 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	019666	22国债01	20,000	2,040,419.18	4.18
2	019679	22国债14	6,000	604,113.70	1.24

注：本集合计划本报告期末仅持两只债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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，对本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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本集合计划本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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的情况，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 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	184,060.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	74,921.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	258,981.41

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息**9.1 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		产品投 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	498	75,393.65	6,872,739.86	18.30%	30,673,299.12	81.70%	0.00	-
东证融汇成长优选C	3,152	3,790.16	181,279.38	1.52%	8,407,726.87	70.38%	3,357.58	28.10%
合计	3,650	13,559.62	7,054,019.24	14.25%	39,081,025.99	78.96%	3,357.58	6.78%

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）。

9.2 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	946,616.50	2.52%
	东证融汇成长优选C	765,555.02	6.41%
	合计	1,712,171.52	3.46%

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）。

9.3 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	50~100
	东证融汇成长优选 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	东证融汇成长优选 A	10~50
	东证融汇成长优选 C	0~10
	合计	10~50

§10 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
基金合同生效日(2021年11月08日)基金份额总额	35,839,525.60	-
本报告期期初基金份额总额	35,631,447.88	281,634.59
本报告期基金总申购份额	23,052,741.59	70,097,617.30
减：本报告期基金总赎回份额	21,138,150.49	58,432,663.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	37,546,038.98	11,946,588.79

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，本集合计划管理人发生以下重大人事变动：

自2022年2月23日起，王安民先生不再担任公司首席风险官职务。

自2022年2月28日起，薛金艳女士担任公司首席风险官职务。

自2022年3月31日起，王安民先生不再担任公司首席信息官职务。

自2022年4月6日起，孔亚洲先生担任公司首席信息官职务。

本报告期内，本集合计划托管人专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划管理人于2022年12月2日发布了《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改聘会计师事务所的公告》，将会计师事务所由中准会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划提供2022年度审计服务。

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用为13,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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，本集合计划托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	799,333,810.07	100.00%	187,438.90	100.00%	-
----------	---	----------------	---------	------------	---------	---

11.7.2 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	12,823,201.27	100.00%	-	-	-	-	-	-

11.8 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增加上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2022-01-25
2	东证融汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、网站	2022-03-01
3	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划增加上海好买基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2022-03-11
4	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划增加珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2022-03-28
5	东证融汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、网站	2022-04-01
6	东证融汇证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、网站	2022-04-07
7	东证融汇证券资产管理有限公司旗下部分集合资产管理计划2022年第一季度报告提示性公告	规定报刊	2022-04-22

8	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划2022年第一季度报告	规定网站	2022-04-22
9	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划2022年第二季度报告	规定网站	2022-07-20
10	东证融汇证券资产管理有限公司旗下集合资产管理计划2022年第二季度报告提示性公告	规定报刊	2022-07-20
11	东证融汇证券资产管理有限公司旗下集合资产管理计划2022年中期报告提示性公告	规定报刊	2022-08-30
12	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划2022年中期报告	规定网站	2022-08-30
13	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2022-09-05
14	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划增加京东肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2022-09-13
15	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划增加北京度小满基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2022-09-14
16	东证融汇证券资产管理有限公司旗下集合资产管理计划2022年第三季度报告提示性公告	规定报刊	2022-10-25
17	东证融汇成长优选混合型集	规定网站	2022-10-25

	合资产管理计划2022年第三季度报告		
18	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划招募说明书及产品资料概要更新的提示性公告	规定报刊	2022-11-02
19	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	2022-11-02
20	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	2022-11-02
21	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划更新招募说明书（2022年第1号）	规定网站	2022-11-02
22	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划增加玄元保险代理有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2022-11-10
23	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改聘会计师事务所的公告	规定报刊、网站	2022-12-02
24	东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划增加北京中植基金销售有限公司为销售机构的公告	规定报刊、网站	2022-12-28

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划由东北证券3号主题投资集合资产管理计划变更而来。根据中国证监会《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）的规定，管理人对东北证券3号主题投资集合资产管理计划进行了规范，并向中国证监会申请合同变更。经中国证监会批准，《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》于2021年11月8日起生效，原《东北证券3号主题投资集合资产管理计划管理合同》同日起失效，“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”。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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16层。

13.3 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

二〇二三年三月三十日