

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

编制日期：2024年10月31日

送出日期：2024年11月06日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	东证融汇成长优选	基金代码	970073
基金简称 A	东证融汇成长优选 A	基金代码 A	970073
基金简称 C	东证融汇成长优选 C	基金代码 C	970074
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
基金合同生效日	2021年11月08日	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	魏江	开始担任本基金基金经理的日期	2021年11月08日
		证券从业日期	2017年12月17日
其他	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”）为证券公司大集合资产管理产品，根据《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》，参照		

《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，本概要所述的“基金”也包括变更后的证券公司大集合资产管理产品。本集合计划存续期限自本合同生效之日起至 2025 年 5 月 7 日。本集合计划自 2025 年 5 月 7 日后，按照中国证监会相关规定执行。

注：本产品资料概要所述的“基金”也包括按照《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。

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

请阅读《东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”了解详细情况。

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。

投资范围

本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括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。

本集合计划的投资组合比例为:股票投资的比例范围为集合计划资产的60%—95%;每个交易日日终,在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得低于集合计划资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,管理人在履行适当程序后,可相应调整本集合资产管理计划的投资比例限制。

主要投资策略

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。

具体策略包括：1、股票投资策略，2、债券投资策略，3、现金类资产投资策略，4、金融衍生品投资策略，5、资产支持证券等品种投资策略。

业绩比较基准

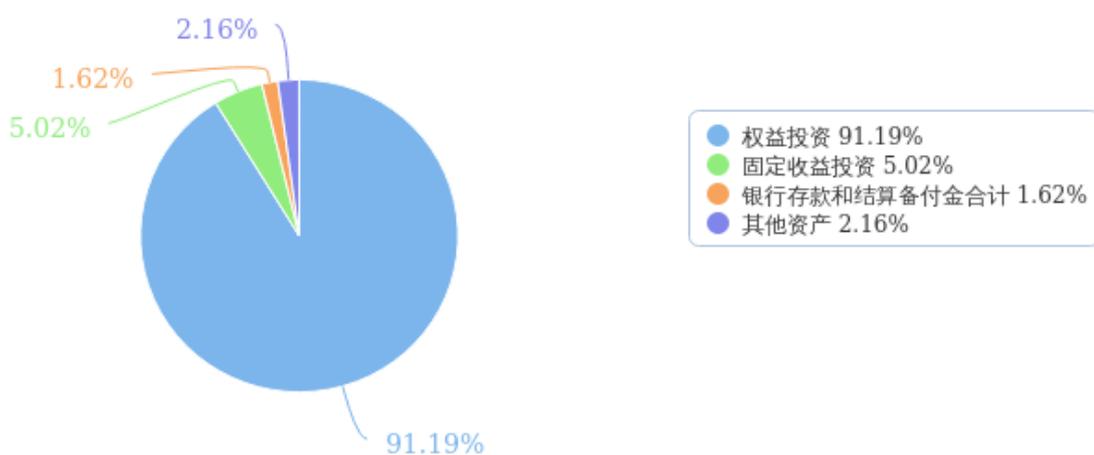
中证 500 指数收益率*90%+银行活期存款利率（税后）*10%

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。

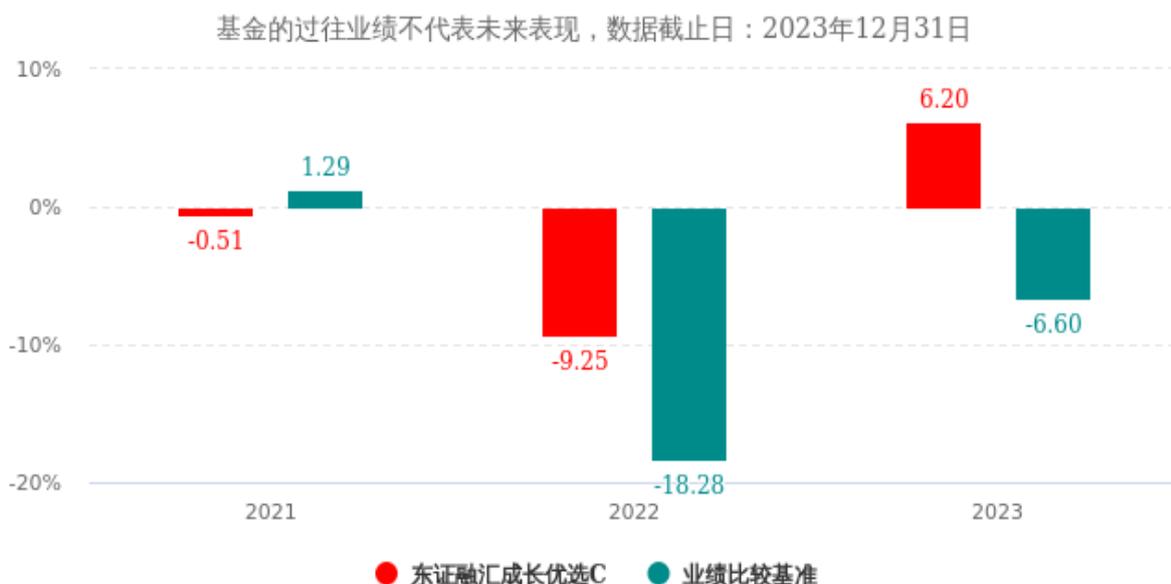
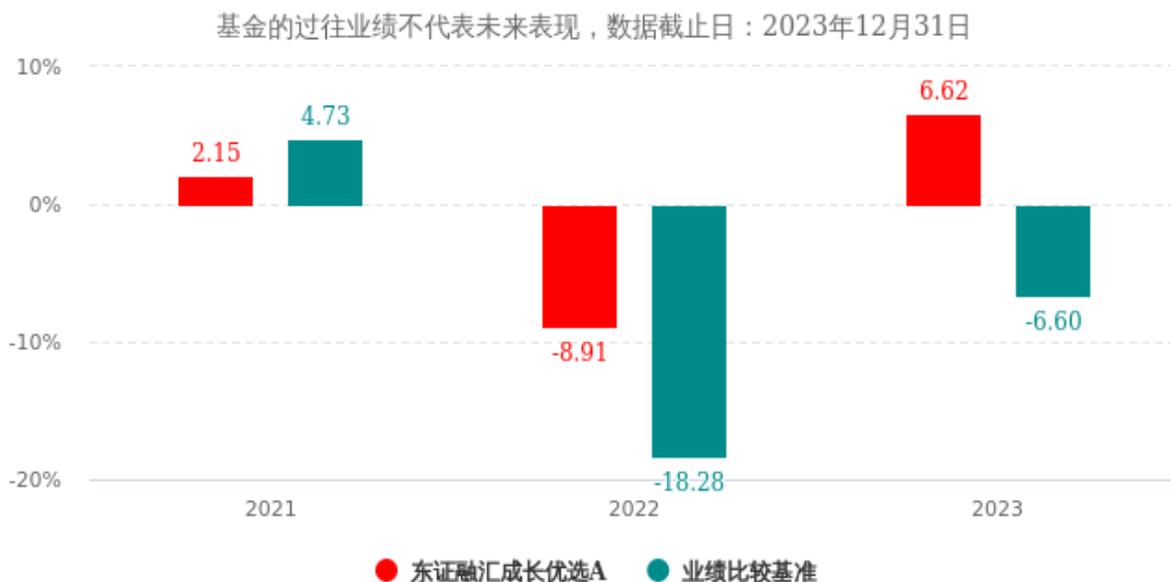
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表（数据截至日期：2024年09月30日）



（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较

图



注：本集合计划合同生效日为 2021 年 11 月 08 日，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。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。集合计划的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

东证融汇成长优选 A

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费(前收费)	M<100 万元	1.20%	
	100 万元≤M<200 万元	1.00%	
	200 万元≤M<500 万元	0.50%	
	M≥500 万元	1000.00 元/笔	
赎回费	N<7 天	1.50%	
	7 天≤N<30 天	0.75%	
	30 天≤N<365 天	0.50%	
	N≥365 天	0%	

东证融汇成长优选 C

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费(前收费)			本集合计划 C 类份额 不收取申购费
赎回费	N<7 天	1.50%	

7天≤N<30天	0.50%
----------	-------

N≥30天	0%
-------	----

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	1.20%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
销售服务费 C 类	0.40%	销售机构
审计费用	13,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	50,000.00 元/年	规定披露报刊

《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费和诉讼费；集合计划份额持有人大会费用；集合计划的证券交易费用；集合计划的银行汇划费用；集合计划的开户费用、账户维护费用；按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

其他费用 相关服务机构

注：本集合计划交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除。

审计费、信息披露费金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实

际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划招募说明书》第十四部分“集合计划费用与税收”了解详细情况。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

东证融汇成长优选 A

基金运作综合费用测算明细的类别	基金运作综合费率（年化）
-	1.51%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

东证融汇成长优选 C

基金运作综合费用测算明细的类别	基金运作综合费率（年化）
-	1.91%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失本金。投资有风险，投资者购买集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划的风险主要包括：

1、市场风险：

（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）信用风险；（4）利率风险；（5）购买力风险；（6）

债券收益率曲线风险；（7）再投资风险

2、管理风险

3、流动性风险

4、本集合计划特有风险：

（1）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。

（2）资产支持证券的投资风险

本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的集合计划所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成集合计划财产损失。

（3）股指期货、国债期货投资风险

本集合计划可投资于股指期货、国债期货。投资股指期货、国债期货主要存在以下风险：

市场风险：定义为由于投资标的物价格变动而产生的衍生品的价格波动；

市场流动性风险：当衍生品合约无法及时变现所带来的风险；

基差风险：定义为衍生品市场价格与连动之标的价格不一致所产生的风险；

结算流动性风险：定义为当集合计划之保证金部位不足而无法交易衍生品，或因指数波动导致保证金低于维持保证金而必须追缴保证金的风险；

保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

信用风险：定义为交易对手不愿或无法履行契约之风险；

作业风险：定义为因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期事件所导致的损失。

国债期货、股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应标的资产出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货、股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

（4）股票期权投资风险

本集合计划可投资于股票期权，投资股票期权所面临的风险主要包括：股票期权价格波动带来的市场风险；因保证金不足、备兑证券数量不足或持仓超限而导致的强行平仓风险；股票期权具有高杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失；包括对手方风险和连带风险在内的第三方风险；以及各类操作风险，极端情况下会给投资组合带来较大损失。

（5）本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续至 2025 年 5 月 7 日，本集合计划份额持有人将面临在 2025 年 5 月 7 日资产管理合同到期的风险。

5、操作或技术风险

6、合规性风险

7、其他风险

（二）重要提示

中国证监会对东北证券 3 号主题投资集合资产管理计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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，也不保证最低收益。

投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和资产管理合同的当事人。

本集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注管理人发布的相关临时公告等。

因本集合计划资产管理合同而产生的或与资产管理合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海仲裁委员会，根据其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地为上海。仲裁裁决是终局的，并对相关各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见管理人网站，网址：www.dzronghui.com，客服电话：021-80105551

- 1、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、东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划托管协议、东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划招募说明书
- 2、定期报告，包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告
- 3、集合计划份额净值
- 4、集合计划销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料

六、其他情况说明

无