

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
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:招商银行股份有限公司

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。

集合计划托管人招商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

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
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	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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
§ 5 托管人报告	12
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	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
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
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	44
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45

§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	东证融汇禧悦 90 天滚动	
基金主代码	970096	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 15 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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	15,226,340,753.60 份	
基金合同存续期	自《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	东证融汇禧悦 90 天滚动 A	东证融汇禧悦 90 天滚动 C
下属分级基金的交易代码	970096	970097
报告期末下属分级基金的份额总额	9,940,485,650.67 份	5,285,855,102.93 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格管理风险的前提下，主要投资中短期债券，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划主要采用：1、资产配置策略，采用专业的投资理念和分析方法，以系统化的研究为基础，通过对各类固定收益类资产的合理配置争取获取稳定收益；2、债券投资策略，在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理；3、资产支持证券投资策略，将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策；4、可转换债券和可交换债券投资策略，采用定量分析和定性分析相结合的方式，考量包括正股基本面、转股溢价率、纯债溢价率、信用风险及流动性等综合因素判断其债券投资价值
业绩比较基准	中债综合财富（1-3 年）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险

	和预期收益高于货币市场基金和货币市场型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。
--	--

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。东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王钟	张姗
	联系电话	021-80105523	400-61-95555
	电子邮箱	dzrhyy@nesc.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		021-80105551	400-61-95555
传真		021-80105552	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 255 号 540 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200127	518040
法定代表人		李福春	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dzronghui.com
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）	
	东证融汇禧悦 90 天滚动 A	东证融汇禧悦 90 天滚动 C
本期已实现收益	167,790,951.62	78,867,722.01
本期利润	178,051,862.02	83,963,561.99
加权平均基金份额本期利润	0.0170	0.0157
本期加权平均净值利润率	1.54%	1.44%
本期基金份额净值增长率	1.55%	1.45%
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	1,102,903,961.77	481,270,021.37
期末可供分配基金份额利润	0.1110	0.0910
期末基金资产净值	11,038,867,900.08	5,821,575,029.65
期末基金份额净值	1.1105	1.1013
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	10.74%	10.13%

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

东证融汇禧悦 90 天滚动 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	0.21%	0.01%	0.32%	0.01%	-0.11%	0.00%
过去三个月	0.70%	0.01%	1.01%	0.02%	-0.31%	-0.01%
过去六个月	1.55%	0.01%	1.97%	0.02%	-0.42%	-0.01%

过去一年	3.53%	0.01%	3.31%	0.02%	0.22%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.74%	0.02%	8.00%	0.03%	2.74%	-0.01%

东证融汇禧悦 90 天滚动 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	0.18%	0.01%	0.32%	0.01%	-0.14%	0.00%
过去三个月	0.64%	0.01%	1.01%	0.02%	-0.37%	-0.01%
过去六个月	1.45%	0.01%	1.97%	0.02%	-0.52%	-0.01%
过去一年	3.32%	0.01%	3.31%	0.02%	0.01%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.13%	0.02%	7.98%	0.03%	2.15%	-0.01%

注：本集合计划合同于 2021 年 12 月 15 日生效。本集合计划 C 类份额于 2021 年 12 月 17 日首次申购确认，2021 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 16 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

东证融汇禧悦90天滚动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12月15日-2024年06月30日)



东证融汇禧悦90天滚动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12月17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 12 月 15 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 12 月 15 日至 2024 年 06 月 30 日）计算，本集合计划 C 类份额于 2021 年 12 月 17 日首次申购确认，2021 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 16 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 12 月 17 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，截至本报告期末，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		
应洁茜	本集合计划的投资经理、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投资经理、东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划投资经理、公募投资管理部总经理	2021-12-15	-	10 年	浙江大学财务管理学士，美国北卡罗来纳州立大学会计管理学硕士，10 年以上固定收益领域交易投资及产品管理经验，5 年债券型公募基金产品投资经验，曾任浙江浙商证券资产管理有限公司基金经理。2021 年 1 月加入东证融汇证券资产管理有限公司，现任东证融汇公募投资管理部总经理、投资经理。
郑铮	本集合计划的投资经理、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投资经理、东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划投资经理	2023-01-11	-	7 年	上海理工大学管理学学士，具有 7 年证券从业经历。曾任光大保德信基金管理有限公司债券交易员、金元顺安基金管理有限公司债券交易员。2022 年 1 月加入东证融汇证券资产管理有限公司，历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助理，现任公司公募投资管理部投资经理。
李卿睿	本集合计划的投资经理、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投资经理、东证融汇	2023-01-11	-	4 年	加拿大阿尔伯塔大学财务管理硕士，深圳大学金融学学士。曾任上海国际货币经纪有限责任公司货币经纪人、华林证券股份有限公司

	添添益中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划投资经理			高级交易员、平安信托有限责任公司投资经理、太平养老保险股份有限公司投资经理。2022 年 3 月加入东证融汇证券资产管理有限公司，历任东证融汇证券资产管理有限公司投资经理、多策略研究员，现任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，本着诚实守信、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

复盘上半年，债券市场供需不平衡的矛盾较为突出，经济基本面呈现结构性复苏，

政策端保持稳中求进的定力，多重因素驱动收益率曲线整体下行。商业银行进行新一轮存款利率下调，市场风险偏好显著回落，避险资金进入债市，催化利率加速下行；地产虽有政策，但销售总体延续疲弱，资产欠配的做多逻辑得到强化，收益率进一步下探。两会公布的经济增长和赤字率目标基本符合市场预期，万亿超长期国债发行节奏相对较缓慢，城投债券在化债背景下供给缩减。随着经济开始步入高质量发展轨道，金融数据开始主动“挤水分”，社融数据、M1 增速走低，贴合新时期的经济结构和增长模式。监管“叫停”存款手工补息，大量资金回流到理财产品，形成了债券配置需求。在上述多重驱动因素下，债券收益率步入下行轨道。尽管央行曾多次提示长期利率下行过快的隐忧，但在债券供给乏力、配债需求旺盛的背景下，债券市场快速消化了调整空间，6 月开始，随着风险偏好情绪的回落，十年期国债从 2.30% 开始重新向 2.20% 靠拢，需关注长端债券波动和赔率。而短端方面，从央行描述的未来货币政策框架演进方向来看，7 天逆回购利率将成为政策利率的核心角色之一，且国债二级买卖将成为新的流动性投放工具，为短端收益率提供中枢性指导，未来将重点关注货币政策和预期管理的变化。

本报告期内，本集合计划秉持既定的投资思路，采用中短久期策略的前提下，密切跟踪资金面、宏观运行情况和机构行为变化，适时优化组合形态，并审慎灵活参与波段交易，将防范信用和流动性风险放在产品运作的首位，力争在保证安全性和流动性的前提下增厚整体收益，报告期内本投资组合策略运行良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东证融汇禧悦 90 天滚动 A 基金份额净值为 1.1105 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.97%；截至报告期末东证融汇禧悦 90 天滚动 C 基金份额净值为 1.1013 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.45%，同期业绩比较基准收益率为 1.97%。

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，目前经济依然面临一定的周期性压力，或继续维持结构性复苏；随着政府债券发行提速，财政政策力度或将提升，流动性继续保持合理充裕，资金利率在政策利率附近波动。需要重点关注债券供给压力、股市风险偏好情绪修复和美联储年内降息的可能性。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,863,360.90	1,046,284.10
结算备付金		4,034.92	653,296.37
存出保证金		42,906.24	36,346.37
交易性金融资产	6.4.7.2	16,838,586,706.98	13,733,042,687.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		16,280,734,455.97	13,285,468,768.36
资产支持证券投资		557,852,251.01	447,573,919.24
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	115,063,489.51	2,530,472,212.26
应收清算款		80,000,000.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		27,395,346.47	71,940,015.33

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	4,680,000.00	-
资产总计		17,069,635,845.02	16,337,190,842.03
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
负 债:			
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		169,234,767.12	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		30,224,403.59	644,600.03
应付管理人报酬		4,197,540.86	4,060,854.34
应付托管费		699,590.14	676,809.02
应付销售服务费		960,722.23	915,781.49
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,676,630.90	3,442,004.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	199,260.45	326,151.93
负债合计		209,192,915.29	10,066,200.99
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	15,221,819,041.24	14,963,514,937.20
未分配利润	6.4.7.8	1,638,623,888.49	1,363,609,703.84
净资产合计		16,860,442,929.73	16,327,124,641.04

负债和净资产总计		17,069,635,845.02	16,337,190,842.03
----------	--	-------------------	-------------------

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，本集合计划份额总额 15,226,340,753.60 份。其中 A 类份额净值 1.1105 元，A 类份额总额 9,940,485,650.67 份；C 类份额净值 1.1013 元，C 类份额总额 5,285,855,102.93 份。

6.2 利润表

会计主体：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

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		299,525,695.82	238,815,241.74
1. 利息收入		10,959,194.88	12,508,176.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	59,419.45	46,678.98
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		10,899,775.43	12,461,497.34
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		273,209,556.12	175,214,978.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	261,105,010.15	171,215,515.05
资产支持证券投资	6.4.7.13	12,104,545.97	3,999,463.24
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,356,750.38	51,091,895.35

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	194.44	191.78
减：二、营业总支出		37,510,271.81	20,634,577.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,947,568.39	14,198,580.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,324,594.74	2,366,430.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,806,087.35	3,315,938.30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		395,211.40	42,786.74
其中：卖出回购金融资产支出		395,211.40	42,786.74
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		872,012.08	553,671.62
8. 其他费用	6.4.7.20	164,797.85	157,170.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		262,015,424.01	218,180,664.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		262,015,424.01	218,180,664.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		262,015,424.01	218,180,664.26

6.3 净资产变动表

会计主体：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

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	14,963,514,937.20	1,363,609,703.84	16,327,124,641.04
二、本期期初净资产	14,963,514,937.20	1,363,609,703.84	16,327,124,641.04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	258,304,104.04	275,014,184.65	533,318,288.69
(一)、综合收益总额	-	262,015,424.01	262,015,424.01

(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)	258,304,104.04	12,998,760.64	271,302,864.68
其中: 1. 基金申购款	7,023,515,134.24	693,144,689.95	7,716,659,824.19
2. 基金赎回款	-6,765,211,030.20	-680,145,929.31	-7,445,356,959.51
(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	15,221,819,041.24	1,638,623,888.49	16,860,442,929.73
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	3,031,678,633.99	134,106,778.01	3,165,785,412.00
二、本期期初净资产	3,031,678,633.99	134,106,778.01	3,165,785,412.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,866,243,320.03	782,417,253.10	10,648,660,573.13
(一)、综合收益总额	-	218,180,664.26	218,180,664.26
(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)	9,866,243,320.03	564,236,588.84	10,430,479,908.87
其中: 1. 基金申购款	14,895,856,542.81	877,796,047.60	15,773,652,590.41
2. 基金赎回款	-5,029,613,222.78	-313,559,458.76	-5,343,172,681.54
(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	12,897,921,954.02	916,524,031.11	13,814,445,985.13

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

东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为东北证券元伯 2 号债券优选集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）。

原集合计划于 2013 年 5 月 13 日起开始募集并于 2013 年 5 月 17 日结束募集，于 2013 年 5 月 21 日成立，并于 2013 年 5 月 31 日获中国证券业协会中证协函（2013）533 号文备案确认。

原集合计划在募集期间收到优先级客户有效净参与资金为人民币 423,751,000.00 元，折合认购份额 423,751,000.00 份；认购资金产生的利息金额为人民币 28,831.01 元，折合集合计划份额 28,831.01 份；以上优先级实收资金共计人民币 423,779,831.01 元，折合 423,779,831.01 份优先级集合计划份额；次级客户有效净参与资金为人民币 74,779,589.00 元，折合认购份额 74,779,589.00 份；认购资金产生的利息金额为人民币 3,635.11 元，折合集合计划份额 3,635.11 份；以上次级实收资金共计人民币 74,783,224.11 元，折合 74,783,224.11 份次级集合计划份额。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”），托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2016 年 7 月 14 日发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》的规定，2017 年 3 月 16 日，东北证券元伯 2 号债券优选集合资产管理计划名称变更为东北证券元伯 2 号债券优选分级集合资产管理计划。2021 年 7 月 16 日，东北证券元伯 2 号债券优选分级集合资产管理计划名称变更为东北证券元伯 2 号集合资产管理计划，产品不再分级，仅有一类份额，每一份额共担风险、共享收益。

根据中国证监会于 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 12 月 15 日起，“东北证券元伯 2 号集合资产管理计划”正式更名为“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”，《东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《东北证券元伯 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》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《东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券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《东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债

债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接投资于股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换债转股所形成的股票等权益类资产。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，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：中债综合财富（1-3 年）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%。

本集合计划为债券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，招商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》、《东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券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	3,863,360.90
等于：本金	3,861,591.34
加：应计利息	1,769.56
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	3,863,360.90

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	-	-	-	-	
贵金属 投资-金 交所黄 金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,530,345,651.85	32,330,381.94	1,580,139,096.94	17,463,063.15
	银行间市场	14,456,315,492.19	184,470,059.03	14,700,595,359.03	59,809,807.81
	合计	15,986,661,144.04	216,800,440.97	16,280,734,455.97	77,272,870.96
资产支持 证券	547,931,462.00	7,520,451.01	557,852,251.01	2,400,338.00	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	16,534,592,606.04	224,320,891.98	16,838,586,706.98	79,673,208.96	

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

本集合计划本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本集合计划本报告期末无期货合约持仓。

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**

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	35,037,644.66	-
银行间市场	80,025,844.85	-
合计	115,063,489.51	-

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应收利息	4,680,000.00
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	4,680,000.00

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	112,735.83
其中：交易所市场	-
银行间市场	112,735.83
应付利息	-
预提费用	86,524.62
合计	199,260.45

6.4.7.7 实收基金

东证融汇禧悦 90 天滚动 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	9,907,005,167.18	9,902,483,454.82
本期申购	4,723,529,693.00	4,723,529,693.00
本期赎回（以“-”号填列）	-4,690,049,209.51	-4,690,049,209.51
本期末	9,940,485,650.67	9,935,963,938.31

东证融汇禧悦 90 天滚动 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	5,061,031,482.38	5,061,031,482.38
本期申购	2,299,985,441.24	2,299,985,441.24
本期赎回（以“-”号填列）	-2,075,161,820.69	-2,075,161,820.69
本期末	5,285,855,102.93	5,285,855,102.93

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

东证融汇禧悦 90 天滚动 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	958,500,439.35	-27,869,258.20	930,631,181.15
本期期初	958,500,439.35	-27,869,258.20	930,631,181.15
本期利润	167,790,951.62	10,260,910.40	178,051,862.02
本期基金份额交易产生的变动数	-5,476,687.47	-302,393.93	-5,779,081.40
其中：基金申购款	486,592,657.44	-8,730,768.80	477,861,888.64
基金赎回款	-492,069,344.91	8,428,374.87	-483,640,970.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,120,814,703.50	-17,910,741.73	1,102,903,961.77

东证融汇禧悦 90 天滚动 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	385,924,950.50	47,053,572.19	432,978,522.69
本期期初	385,924,950.50	47,053,572.19	432,978,522.69
本期利润	78,867,722.01	5,095,839.98	83,963,561.99
本期基金份额交易产生的变动数	16,477,348.86	2,300,493.18	18,777,842.04
其中：基金申购款	191,567,152.87	23,715,648.44	215,282,801.31
基金赎回款	-175,089,804.01	-21,415,155.26	-196,504,959.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	481,270,021.37	54,449,905.35	535,719,926.72

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	50,662.40
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	8,367.60
其他	389.45
合计	59,419.45

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期内无基金投资收益。

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	265,045,149.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,940,139.03
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	261,105,010.15

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	15,526,010,366.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,215,514,348.60
减：应计利息总额	314,321,381.82
减：交易费用	114,774.76
买卖债券差价收入	-3,940,139.03

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

6.4.7.13.1 资产支持证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
资产支持证券投资收益——利息收入	12,286,696.78
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-182,150.81
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-

合计	12,104,545.97
----	---------------

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出资产支持证券成交总额	385,250,749.23
减：卖出资产支持证券成本总额	374,055,196.28
减：应计利息总额	11,377,703.76
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-182,150.81

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

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

本集合计划本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

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	15,738,001.77
——股票投资	-
——债券投资	13,720,955.49
——资产支持证券投资	2,017,046.28
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	381,251.39
合计	15,356,750.38

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	-
投资债券的认购款利息收入	194.44
合计	194.44

6.4.7.19 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

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	26,852.28
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	59,673.23
账户维护费	18,600.00
合计	164,797.85

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
招商银行	集合计划托管人、集合计划销售机构
东证融汇艾华集团 FOF6 号单一资产管理计划	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
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

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股票交易。

6.4.10.1.2 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。

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	1,255,354,370.58	100.00%	1,586,001,060.82	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东北证券	2,247,521,136.00	100.00%	2,014,086,300.00	100.00%

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

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	25,947,568.39	14,198,580.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,884,486.28	6,965,324.99
应支付基金管理人的净管理费	13,063,082.11	7,233,255.54

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$G = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

G 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	4,324,594.74	2,366,430.11

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$T = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

T 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 联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东证融汇禧悦 90 天 滚动 A	东证融汇禧悦 90 天 滚动 C	合计
东北证券	-	2,215,614.02	2,215,614.02
招商银行	-	15,623.43	15,623.43
合计	-	2,231,237.45	2,231,237.45
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		
	东证融汇禧悦 90 天 滚动 A	东证融汇禧悦 90 天 滚动 C	合计
东北证券	-	699,229.30	699,229.30
东证融汇	-	103,606.53	103,606.53
合计	-	802,835.83	802,835.83

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 0.2%，销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

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

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。

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

东证融汇禧悦 90 天滚动 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 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	58,094,787.85	58,094,787.85
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	58,094,787.85	58,094,787.85
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.58%	0.64%

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

东证融汇禧悦 90 天滚动 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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
东证融汇艾华集团 FOF6 号 单一资产管理计划	359,103.18	0.01%	416,897.25	0.01%

注：（1）上述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。

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
招商银行	3,863,360.90	50,662.40	21,641,170.42	33,399.22

注：本集合计划上述银行存款由本集合计划托管人招商银行保管，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内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

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。

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 169,234,767.12 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	-------	-------	--------

			价		
230411	23 农发 11	2024-07-01	100.05	1,600,000	160,080,000.00
240301	24 进出 01	2024-07-01	100.21	200,000	20,042,000.00
合计				1,800,000	180,122,000.00

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、交易对手库制度和分散化投资方式防范信用风险。

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	93,829,301.51	117,569,462.09
A-1 以下	-	-
未评级	9,845,739,107.41	8,055,690,760.98
合计	9,939,568,408.92	8,173,260,223.07

注：未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的短期融资券、短期证券公司债、短期中期票据。债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

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	645,779,416.28	298,420,868.75
合计	645,779,416.28	298,420,868.75

注：同业存单投资以全价列示。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	2,217,070,966.02	1,400,430,330.02
AAA 以下	1,181,985,065.68	1,433,449,041.90
未评级	2,296,330,599.07	1,979,908,304.62
合计	5,695,386,630.77	4,813,787,676.54

注：未评级债券为未有第三方机构评级的中期票据、公司债。债券投资以全价列示。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	374,287,495.80	196,404,970.72
AAA 以下	183,564,755.21	251,168,948.52
未评级	-	-
合计	557,852,251.01	447,573,919.24

注：资产支持证券投资以全价列示。

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于每个运作期到期后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。

6.4.13.3.1 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 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 20 24	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
-------------------------	--------	--------	----------	-------	------------------	-----	----

年 06 月 30 日							
资产							
货币资金	3,863,360 .90	-	-	-	-	-	3,863,360. 90
结算备付金	4,034.92	-	-	-	-	-	4,034.92
存出保证金	42,906.24	-	-	-	-	-	42,906.24
交易性金融资产	2,592,301 ,557.59	4,717,375 ,374.00	7,581,903 ,203.56	1,947,006 ,571.83	-	-	16,838,586 ,706.98
买入返售金融资产	115,063,4 89.51	-	-	-	-	-	115,063,48 9.51
应收清算款	-	-	-	-	-	80,000,0 00.00	80,000,000 .00
应收申	-	-	-	-	-	27,395,3 46.47	27,395,346 .47

购款							
其他资产	-	-	-	-	-	4,680,000.00	4,680,000.00
资产总计	2,711,275,349.16	4,717,375,374.00	7,581,903,203.56	1,947,006,571.83	-	112,075,346.47	17,069,635,845.02
负债							
卖出回购金融资产款	169,234,767.12	-	-	-	-	-	169,234,767.12
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,224,403.59	30,224,403.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,197,540.86	4,197,540.86
应付托管费	-	-	-	-	-	699,590.14	699,590.14
应付销售服务	-	-	-	-	-	960,722.23	960,722.23

费							
应交税费	-	-	-	-	-	3,676,630.90	3,676,630.90
其他负债	-	-	-	-	-	199,260.45	199,260.45
负债总计	169,234,767.12	-	-	-	-	39,958,148.17	209,192,915.29
利率敏感度缺口	2,542,040,582.04	4,717,375,374.00	7,581,903,203.56	1,947,006,571.83	-	72,117,198.30	16,860,442,929.73
上年度末 2023 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							
货币资金	1,046,284.10	-	-	-	-	-	1,046,284.10
结算备付金	653,296.37	-	-	-	-	-	653,296.37
存出	36,346.37	-	-	-	-	-	36,346.37

保证金							
交易性金融资产	2,167,251,943.15	3,350,550,487.57	5,989,789,319.49	2,225,450,937.39	-	-	13,733,042,687.60
买入返售金融资产	2,530,472,212.26	-	-	-	-	-	2,530,472,212.26
应收申购款	-	-	-	-	-	71,940,015.33	71,940,015.33
资产总计	4,699,460,082.25	3,350,550,487.57	5,989,789,319.49	2,225,450,937.39	-	71,940,015.33	16,337,190,842.03
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	644,600.03	644,600.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,060,854.34	4,060,854.34
应付托	-	-	-	-	-	676,809.02	676,809.02

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	915,781.49	915,781.49
应交税费	-	-	-	-	-	3,442,004.18	3,442,004.18
其他负债	-	-	-	-	-	326,151.93	326,151.93
负债总计	-	-	-	-	-	10,066,200.99	10,066,200.99
利率敏感度缺口	4,699,460,082.25	3,350,550,487.57	5,989,789,319.49	2,225,450,937.39	-	61,873,814.34	16,327,124,641.04

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	19,433,068.06	16,529,080.99
	市场利率上升 25 个基点	-19,338,463.89	-16,434,424.92

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固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本集合计划资产净值无重大影响。

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	-	-
第二层次	16,838,586,706.98	13,733,042,687.60
第三层次	-	-
合计	16,838,586,706.98	13,733,042,687.60

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,838,586,706.98	98.65
	其中：债券	16,280,734,455.97	95.38
	资产支持证券	557,852,251.01	3.27
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	115,063,489.51	0.67
	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	3,867,395.82	0.02
8	其他各项资产	112,118,252.71	0.66
9	合计	17,069,635,845.02	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

本集合计划本报告期末未持有股票。

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

本集合计划本报告期末未持有股票。

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

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

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

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

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	129,824,284.62	0.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,792,529,229.66	10.63
	其中：政策性金融债	774,617,396.62	4.59
4	企业债券	1,808,744,049.46	10.73
5	企业短期融资券	8,785,841,514.94	52.11
6	中期票据	3,118,015,961.01	18.49
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	645,779,416.28	3.83
9	其他	-	-
10	合计	16,280,734,455.97	96.56

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	190409	19 农发 09	1,600,000	164,912,786.89	0.98
2	230411	23 农发 11	1,600,000	162,973,639.34	0.97
3	190208	19 国开 08	1,100,000	113,784,721.31	0.67
4	240401	24 农发 01	1,100,000	110,743,491.80	0.66
5	2404105	24 农发贴现 05	1,100,000	109,799,582.42	0.65

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	261894	金租 2A1	400,000	40,344,438.36	0.24
2	261661	24YD1A1	500,000	31,132,540.55	0.18
3	261695	24 远航 12	300,000	30,284,136.99	0.18
4	261662	24YD1A2	260,000	26,352,852.06	0.16
5	179765	PR 源水	300,000	22,351,986.17	0.13
6	180289	华发 RH1A	200,000	21,162,558.90	0.13
7	260166	黄投 02 优	200,000	21,096,054.79	0.13
8	143529	庐陵二 2A	200,000	20,620,312.33	0.12
9	261257	23 电 4 优	200,000	20,429,079.45	0.12
10	261692	24 华发 1A	200,000	20,333,534.25	0.12
11	261886	24 华发 2A	200,000	20,204,136.99	0.12
12	261845	东煜 7A2	200,000	20,127,616.44	0.12
13	143912	熠安 01A2	200,000	19,946,173.41	0.12
14	260324	汴二 02 优	150,000	15,930,246.58	0.09
15	199070	周口 02 优	150,000	15,715,072.60	0.09
16	135655	新源 4 优	150,000	15,488,478.08	0.09
17	260856	金租 1A1	300,000	14,278,392.66	0.08
18	261532	泰山 1 优	120,000	12,231,593.43	0.07
19	261842	睿海 06 优	120,000	12,131,066.30	0.07
20	261711	鸿安 3A2	240,000	11,420,435.32	0.07
21	261881	晋建 3A2	110,000	11,081,565.75	0.07
22	261589	东煜 4A2	200,000	10,568,855.96	0.06
23	260860	汴二 03 优	100,000	10,294,972.60	0.06
24	199388	23 海创 1A	100,000	10,162,383.56	0.06
25	260044	盐西 02 优	100,000	10,092,095.89	0.06
26	144087	招实 03 优	100,000	10,029,469.86	0.06
27	112238	22 赣租 A2	300,000	9,908,121.86	0.06
28	261715	东煜 5A2	100,000	9,537,046.01	0.06

29	261807	泰山 2 优	90,000	9,152,479.73	0.05
30	143601	23 中集 4A	200,000	9,131,556.62	0.05
31	143958	熹焱 02A2	100,000	8,961,669.98	0.05
32	262037	德银 01A1	140,000	8,880,841.41	0.05
33	261775	熠安 3A2	120,000	7,768,646.14	0.05
34	261072	23 远航 71	300,000	7,524,566.92	0.04
35	261863	熠安 4A2	120,000	6,981,314.56	0.04
36	260664	泰山 04A1	190,000	3,120,035.25	0.02
37	260425	淮保安 01	100,000	2,046,352.13	0.01
38	260518	空港 01 优	200,000	720,265.56	0.00
39	260536	连瑞 23A1	130,000	309,305.56	0.00

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

本集合计划本报告期内未投资股指期货。

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的情形。在报告编制日前一年内，杭州银行股份有限公司被国家金融监督管理总局浙江监管局处以行政处罚；兴业银行股份有限公司被国家金融监督管理总局福建监管局处以行政处罚。

本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及集合计划合同的要求。除此以外，本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内未有受到公开谴责、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

本集合计划本报告期末未持有股票，不存在投资的前十名股票超出集合计划合同规定的备选股票库的情况。

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	42,906.24
2	应收清算款	80,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,680,000.00
5	应收申购款	27,395,346.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	112,118,252.71

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未持有股票。

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	持有人户数	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	持有份额	占总	持有份额	占		

别	(户)			总份 额比 例		份 额 比 例		总份 额比 例
东证融汇禧悦 90 天滚动 A	502,888	19,766.8	70,404,406.41	0.71%	9,870,081,244.26	99.29%	-	-
东证融汇禧悦 90 天滚动 C	146,071	36,186.89	93,654,300.18	1.77%	5,181,405,969.45	98.02%	10,794,833.3	0.20%
合计	648,959	23,462.72	164,058,706.59	1.08%	15,051,487,213.71	98.85%	10,794,833.3	0.07%

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	东证融汇禧悦 90 天滚动 A	1,191,891.51	0.0120%
	东证融汇禧悦 90 天滚动 C	416,316.86	0.0079%

	合计	1,608,208.37	0.0106%
--	----	--------------	---------

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	东证融汇禧悦 90 天滚动 A	10~50
	东证融汇禧悦 90 天滚动 C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	东证融汇禧悦 90 天滚动 A	0~10
	东证融汇禧悦 90 天滚动 C	-
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东证融汇禧悦 90 天滚动 A	东证融汇禧悦 90 天滚动 C
本报告期期初基金份额总额	9,907,005,167.18	5,061,031,482.38
本报告期基金总申购份额	4,723,529,693.00	2,299,985,441.24
减：本报告期基金总赎回份额	4,690,049,209.51	2,075,161,820.69
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	9,940,485,650.67	5,285,855,102.93

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，本集合计划管理人无重大人事变动、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到稽查或处罚。

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	-	-	-	-	-

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	成交金额	占当期	成	占	成	占

		债券成交总额的比例		债券回购成交总额的比例	交金额	当期权证成交总额的比例	交金额	当期基金成交总额的比例
东北证券	1,255,354,370.58	100.00%	2,247,521,136.00	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	东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券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	东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券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	东证融汇证券资产管理有限公司关于旗下部分资产管理计划在上海天天基金销售有限公司开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、网站	2024-02-02
5	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开放日常定期定额投资业务公告	规定报刊、网站	2024-02-08
6	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

7	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
8	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 2023 年年度报告	规定网站	2024-03-27
9	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 2023 年年度报告提示性公告	规定报刊	2024-03-27
10	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 2024 年第一季度报告	规定网站	2024-04-19
11	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 2024 年第一季度报告提示性公告	规定报刊	2024-04-19
12	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
13	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
14	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(A 类份额)基金产品资料概要更新(2024 年第 1 号)	规定网站	2024-06-27
15	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(C 类份额)基金产品资料概要更新(2024 年第 1 号)	规定网站	2024-06-27
16	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、东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同。
- 3、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托管协议。
- 4、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、东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券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