
东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划

2022年第2季度报告

2022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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2022年07月20日

§ 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及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责任。

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2022年07月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年04月01日起至2022年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东证融汇添添益中短债
基金主代码	970132
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年02月10日
报告期末基金份额总额	4,906,542,588.69份
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、固定收益类投资策略，包括利率预测、信用策略、收益曲线策略、跨市场套利策略；3、资产支持证券投资策略，将对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。
业绩比较基准	中债综合财富（1-3年）指数收益率*90%+一年期定期存款利率（税后）*10%
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	东证融汇添添益中短债A	东证融汇添添益中短债C
下属分级基金的交易代码	970132	970133
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 659, 247, 110. 42份	3, 247, 295, 478. 27份

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。东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划简称“本集合计划”。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2022年04月01日 - 2022年06月30日)	
	东证融汇添添益中短债A	东证融汇添添益中短债C
1. 本期已实现收益	12, 018, 478. 43	13, 645, 061. 17
2. 本期利润	18, 380, 611. 07	18, 753, 173. 39
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0149	0. 0109
4. 期末基金资产净值	1, 705, 303, 984. 40	3, 312, 032, 486. 68
5. 期末基金份额净值	1. 0278	1. 0199

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或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。

3.2 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

东证融汇添添益中短债A净值表现

阶段	净值增长率①	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	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	1.69%	0.02%	0.92%	0.02%	0.77%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.57%	0.05%	0.98%	0.02%	1.59%	0.03%

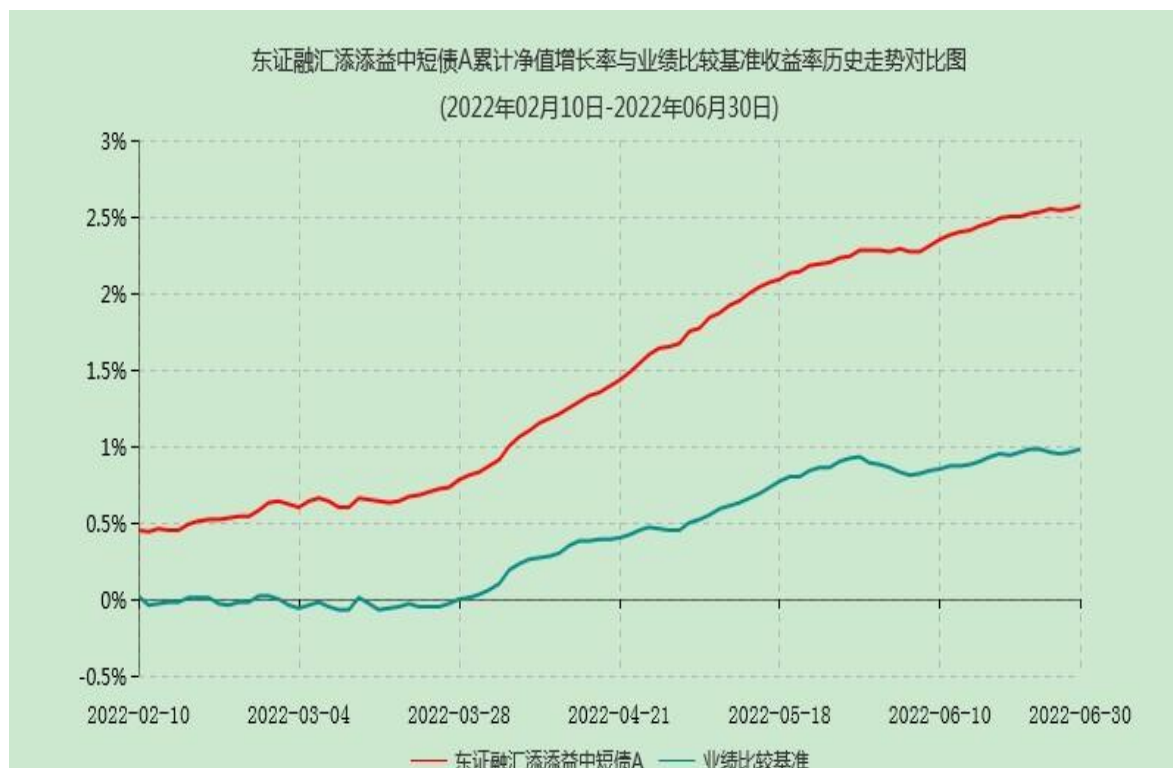
注：本集合计划合同于 2022 年 02 月 10 日生效，于 2022 年 02 月 14 日开放申购，截至本报告期末未满一年。

东证融汇添添益中短债C净值表现

阶段	净值增长率①	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	1.60%	0.02%	0.92%	0.02%	0.68%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.99%	0.02%	1.01%	0.02%	0.98%	0.00%

注：本集合计划合同于 2022 年 02 月 10 日生效，于 2022 年 02 月 14 日开放申购，截至本报告期末未满一年。本集合计划 C 类份额于 2022 年 02 月 15 日首次申购确认，2022 年 02 月 10 日至 2022 年 02 月 14 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



注：（1）净值表现所取数据截至 2022 年 06 月 30 日。

（2）本集合计划合同于 2022 年 02 月 10 日生效，于 2022 年 02 月 14 日开放申购，截至本报告期末未满一年。本集合计划 A 类份额相关数据和指标按照实际存续期（2022 年 02 月 10 日至 2022 年 06 月 30 日）计算，本集合计划 C 类份额于 2022 年 02 月 15 日首次申购确认，2022 年 02 月 10 日至 2022 年 02 月 14 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（2022 年 02 月 15 日至 2022 年 06 月 30 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、东证融汇禧悦90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	2022-02-10	—	8 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, 8年以上固定收益领域交易投资及产品管理经验, 3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。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内, 应洁茜管理的大集合资产管理计划“东北证券现金管家集合资产管理计划”已经中国证监会批准, 于2022年06月17日正式变更为“东证融汇现金管家货币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资产管理合同》于2022年06月17日起生效, 原《东北证券现金管家集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。截至本报告期末, 应洁茜未兼任私募资产管理计划投资经理。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

上半年债券市场面对的形势错综复杂，年初我国经济发展首先是面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，随后债券市场又遇到俄乌、疫情、美联储加息三大扰动，微观主体在面临经济的三重压力叠加三大扰动的制约下导致融资需求不足并引发四月份信贷“坍塌”。货币政策方面：考虑到上半年经济疲弱，企业融资需求不足，叠加财政前置发力但并未造成超额供给，货币政策上半年维持较为宽松的环境。

针对上半年震荡行情的研判，本集合计划坚持久期中性及票息策略，精挑个券同时择机参与利率债波段交易，在严控风险的前提下，兼顾了一定的收益稳定性及组合流动性，在报告期内本投资组合策略运行良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东证融汇添益中短债A基金份额净值为1.0278元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.69%，同期业绩比较基准收益率为0.92%；截至报告期末东证融汇添益中短债C基金份额净值为1.0199元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.60%，同期业绩比较基准收益率为0.92%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	4,498,329,589.37	86.66
	其中：债券	4,458,380,087.99	85.89
	资产支持证券	39,949,501.38	0.77
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	506,156,336.43	9.75
	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	156,541,116.66	3.02
8	其他资产	29,480,361.66	0.57
9	合计	5,190,507,404.12	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)
1	国家债券	109,958,042.86	2.19
2	央行票据	—	—

3	金融债券	758,089,357.22	15.11
	其中：政策性金融债	502,445,138.04	10.01
4	企业债券	1,303,694,861.90	25.98
5	企业短期融资券	1,154,922,656.16	23.02
6	中期票据	1,131,715,169.85	22.56
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,458,380,087.99	88.86

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	220201	22国开01	1,700,000	171,798,087.67	3.42
2	220301	22进出01	1,100,000	110,644,178.08	2.21
3	220206	22国开06	1,100,000	110,039,087.67	2.19
4	2203670	22进出670	1,100,000	109,963,784.62	2.19
5	229914	22贴现国债14	1,100,000	109,958,042.86	2.19

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	183346	招融5优	290,000	29,768,857.54	0.59
2	183626	汴京01优	100,000	10,180,643.84	0.20

本集合计划本报告期末持有2只资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本集合计划本报告期末未投资股指期货。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。在报告编制日前一年内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体中：国家开发银行被中国银行保险监督管理委员会处以行政处罚；中国进出口银行被中国银行保险监督管理委员会处以行政处罚；交通银行股份有限公司被中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行、国家外汇管理局上海市分局处以行政处罚；宁波银行股份有限公司被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局、中国人民银行宁波市中心支行、国家外汇管理局宁波市分局处以行政处罚；广发证券股份有限公司被国家外汇管理局广东省分局处以行政处罚。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	79,687.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,400,674.33
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	29,480,361.66

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	东证融汇添添益中短债 A	东证融汇添添益中短债 C
报告期期初基金份额总额	783,259,977.05	54,055,942.39
报告期期间基金总申购份额	1,365,010,772.77	5,661,982,671.99
减：报告期期间基金总赎回份额	489,023,639.40	2,468,743,136.11
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,659,247,110.42	3,247,295,478.27

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	东证融汇添添益中短 债A	东证融汇添添益中短 债C
报告期期初管理人持有的本基金份额	103,352,146.23	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	103,352,146.23	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	6.23	0.00

注：（1）其中买入/申购含红利再投、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

（2）报告期期末持有的本集合计划份额占集合计划总份额比例的分母采用报告期末各类集合计划对应类别份额总额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本集合计划管理人未运用固有资金投资本集合计划。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划由东北证券6号核心优势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6号核心优势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，《东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》于2022年2月10日起生效，原《东北证券6号核心优势集合资产管理计划管理合同》同日起失效，“东北证券6号核心优势集合资产管理计划”正式更名为“东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划”。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意变更的文件。
- 2、东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同。
- 3、东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划托管协议。
- 4、东证融汇添添益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、东证融汇添添益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。

9.2 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。

9.3 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

2022年07月20日