

东财基金管理有限公司

关于东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更为东财禧悦 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金相关业务安排的公告

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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）等法律法规的规定和《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》的有关约定，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“集合计划”）已经中国证监会 2025 年 10 月 22 日证监许可〔2025〕2344 号文准予变更注册。集合计划以通讯方式召开了集合计划份额持有人大会，并于 2025 年 11 月 24 日表决通过了《关于东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更管理人并变更为东财禧悦 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金有关事项的议案》。

自本公告日起（即 2025 年 12 月 8 日），集合计划的管理人由东证融汇证券资产管理有限公司变更为东财基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”或“东财基金”）；集合计划变更为东财禧悦 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）。

现将相关事宜公告如下：

一、集合计划份额持有人大会会议情况

集合计划以通讯方式召开了集合计划份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2025 年 10 月 25 日起至 2025 年 11 月 23 日 17:00 止。会议审议了《关于东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更管理人并变更为东财禧悦 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”），并由参与本次集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人或其代理人对本次会议议案进行表决。根据《关于东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决结果暨决议生效的公

告》，本次集合计划份额持有人大会于 2025 年 11 月 24 日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效。

二、本次变更主要内容

本次变更的主要内容包括但不限于：

1. 名称变化：由“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”变更为“东财禧悦 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金”。

2. 管理人变化：由“东证融汇证券资产管理有限公司”变更为“东财基金管理有限公司”。

3. 产品类别变化：由“债券型集合资产管理计划”变更为“债券型证券投资基金”。

4. 存续期限变化：由“本集合计划存续期限自本合同变更生效日起至 2025 年 12 月 31 日。本集合计划自 2025 年 12 月 31 日后，按照中国证监会相关规定执行”变更为“不定期”。

5. 投资范围变化：新增“次级债”、“国债期货”。

6. 投资策略变化：新增“国债期货交易策略”并调整“债券投资策略”。

7. 投资限制变化：投资限制原第（2）条由“本集合计划持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不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；”变更为“每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；”；投资限制原第（9）条由“本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。”变更为“本基金应投资于信用级别评级为 AA+以上(含 AA+)的资产支持证券。”；删除投资限制原第（10）条“本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；”；新增投资限制第（11）条“本基金参与国债期货交易，应当遵守下列要求：本基金在任何交易日日终，本基金持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；本基金在任何交易日内

交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；”。

8. 估值方法变化：根据中国证券投资基金业协会《关于固定收益品种的估值处理标准》等相关规定相应调整估值方法。

9. 争议处理机制变化：仲裁机构由“上海国际经济贸易仲裁委员会”变更为“中国国际经济贸易仲裁委员会”；仲裁地由“上海”变更为“北京市”。

10. 估值与核算服务机构变化：由“东北证券股份有限公司”变更为“东财基金管理有限公司”。

最后，根据最新的法律法规的修订情况、集合计划实际运作情况、变更后的基金特点，对法律文件的相关内容一并进行了修订。

三、其他需要提示的事项

1. 自本公告日起（即 2025 年 12 月 8 日），《东财禧悦 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）生效，《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》同时失效。

2. 自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

3. 自 2025 年 12 月 9 日起，本基金开放申购、赎回、定期定额投资业务。基金管理人不再另行公告。本基金定期定额申购业务的单笔最低金额为 10 元，在此最低金额基础之上，以各销售机构的具体规定为准。

4. 对于在赎回选择期未赎回集合计划份额的投资者，其持有的集合计划 A 类份额或 C 类份额在基金合同生效日（即 2025 年 12 月 8 日）自动转换为本基金 A 类基金份额或 C 类基金份额。

本基金对于每份基金份额，设定 90 天的滚动运作期。

（1）每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请

对于每份基金份额，第一个运作期指第一个运作期起始日至第一个运作期到期日。第二个运作期指第二个运作起始日至第二个运作到期日。以此类推。其中：

运作期起始日是指：1）对于投资者依据原《东北证券元伯 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》获得的东北证券元伯 2 号集合资产管理计划份额而

言，第一个运作期起始日为《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资产管理合同》生效日；2）对于投资者依据《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资产管理合同》获得的东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额而言，第一个运作期起始日指该集合计划份额申购确认日；3）对于投资者依据基金合同申购获得的每份基金份额，第一个运作期起始日指基金份额申购确认日。对于上一运作期到期日未赎回或赎回被确认失败的每份基金份额的下一运作期起始日，指该基金份额上一运作期到期日后的下一日。

运作期到期日：1）对于投资者依据原《东北证券元伯 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》获得的东北证券元伯 2 号集合资产管理计划份额而言，第一个运作期到期日指《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》生效日后的第 90 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），第二个运作期到期日为《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资产管理合同》生效日后的第 180 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），以此类推；2）对于投资者依据《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资产管理合同》获得的东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额而言，第一个运作期到期日指该集合计划份额申购申请日后的第 90 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），第二个运作期到期日为该集合计划份额申购申请日后的第 180 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），以此类推；3）对于投资者依据基金合同申购获得的每份基金份额，第一个运作期到期日指基金份额申购申请日后的第 90 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），第二个运作期到期日为基金份额申购申请日后的第 180 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），以此类推。

（2）每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请

对于各类基金份额，基金管理人仅在每个运作期到期日为基金份额持有人办理赎回。

每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则自该运作期到期日次一日起该基金份额进入下一个运作期。

5. 对于通过原集合计划的销售机构购买、但该销售机构未与本基金管理人签订基金销售服务协议的投资人，截至 2025 年 12 月 5 日（含）其仍然持有的集合计划份额，将在 2025 年 12 月 8 日统一变更为东财禧悦 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金份额，并暂时登记至东财基金在基金登记机构开立的临时账户。投资者可登录东财基金官方网站（www.dongcaijijin.com）查询所持有基金的基金净值和持有份额等信息。

投资者在 12 月 8 日起可通过本基金管理人指定的销售机构提交基金账户开立申请，基金账户开立成功后，对应份额将确认至投资者的基金账户上。份额确认后，基金份额持有人方可依据本基金基金合同约定及披露的公告，对相应基金份额进行赎回及其他交易。

6. 投资者可以登录东财基金管理有限公司网站（www.dongcaijijin.com）或拨打东财基金管理有限公司客户服务热线（400-9210-107）进行相关咨询。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。敬请投资人注意投资风险。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同和招募说明书等法律文件，确认已知悉基金产品资料概要，全面认识基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况及销售机构适当性匹配意见的基础上，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

特此公告。

东财基金管理有限公司

2025 年 12 月 8 日