

东财禧悦 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:东财基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月27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、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金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基金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2026年01月01日起至06月30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	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金	
基金简称	东财禧悦90天滚动持有中短债	
基金主代码	026010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年12月08日	
基金管理人	东财基金管理有限公司	
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	3,100,594,164.48份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财禧悦90天滚动持有中短债A	东财禧悦90天滚动持有中短债C
下属分级基金的交易代码	026010	026011
报告期末下属分级基金的份额总额	2,197,325,025.35份	903,269,139.13份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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	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 4、可转换债券（含分离交易可转换债券）和可交换债券投资策略 5、国债期货交易策略
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	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

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		东财基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾勇	张姗
	联系电话	021-23526999	400-61-95555
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-9210-107	400-61-95555
传真		021-23526940	0755-83195201
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼2层01室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200030	518040
法定代表人		戴彦	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金中期报告置备地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

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 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	东财禧悦90天滚动 持有中短债A	东财禧悦90天滚动 持有中短债C
本期已实现收益	21,855,755.54	8,262,885.66
本期利润	25,601,288.60	9,887,172.24
加权平均基金份额本期利润	0.0112	0.0099
本期加权平均净值利润率	0.98%	0.88%
本期基金份额净值增长率	0.98%	0.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	333,122,745.42	117,852,289.83
期末可供分配基金份额利润	0.1516	0.1305
期末基金资产净值	2,526,673,488.46	1,025,984,398.48
期末基金份额净值	1.1499	1.1359
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.07%	0.96%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、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。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用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。

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

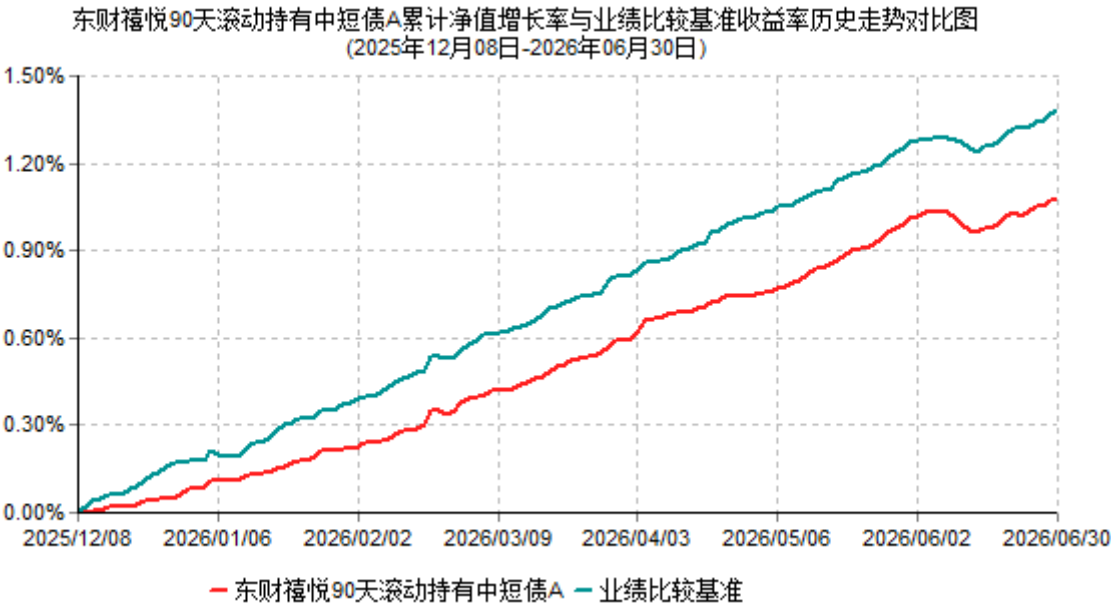
东财禧悦90天滚动持有中短债A

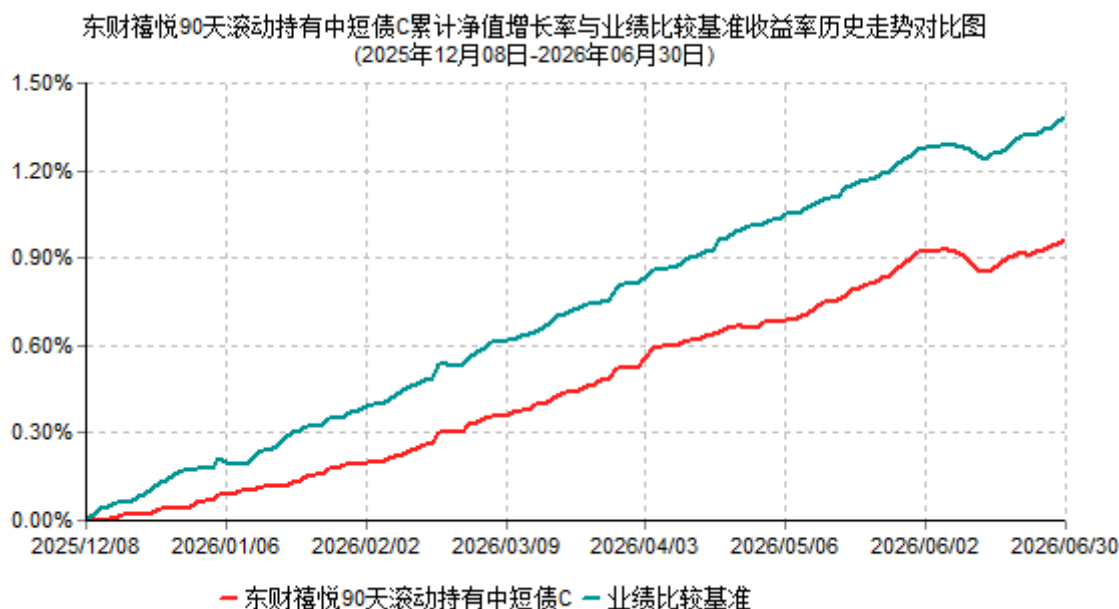
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.48%	0.01%	0.56%	0.01%	-0.08%	0.00%
过去六个月	0.98%	0.01%	1.19%	0.01%	-0.21%	0.00%
自基金合同 生效起至今	1.07%	0.01%	1.38%	0.01%	-0.31%	0.00%

东财禧悦90天滚动持有中短债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	0.43%	0.01%	0.56%	0.01%	-0.13%	0.00%
过去六个月	0.89%	0.01%	1.19%	0.01%	-0.30%	0.00%
自基金合同 生效起至今	0.96%	0.01%	1.38%	0.01%	-0.42%	0.00%

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





注：1、本基金基金合同于2025年12月8日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、按本基金基金合同约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§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

东财基金管理有限公司成立于2018年10月26日，是由东方财富证券股份有限公司全资设立的子公司，公司坚持投资人利益优先原则，致力于在合规管理、风险控制的基础上，以市场变化和客户需求为导向，努力发展成为一家有先进经营理念、清晰发展战略、优秀经营团队、前瞻性产品规划、严谨投资流程和强烈使命感的基金管理公司，为投资者提供高品质的专业资产管理服务。

截至2026年6月30日，公司旗下管理62只证券投资基金--东财上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、东财量化精选混合型发起式证券投资基金、东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、东财中证银行指数型发起式证券投资基金、东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国

证龙头家电指数型发起式证券投资基金、东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金、东财中证云计算与大数据主题指数增强型发起式证券投资基金、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金、东财中证食品饮料指数增强型发起式证券投资基金、东财中证新能源指数增强型证券投资基金、东财数字经济优选混合型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、东财稳健配置六个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞利债券型证券投资基金、东财中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、东财慧心优选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金、东财中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、东财卓越成长混合型发起式证券投资基金、东财景气驱动混合型发起式证券投资基金、东财中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金、东财北证50成份指数型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证50交易型开放式指数证券投资基金、东财中证1-3年国债交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金、东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、东财30天滚动持有债券型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金、东财创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财启和混合型证券投资基金、东财北证50成份指数增强型发起式证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞兴债券型证券投资基金、东财新兴产业锐选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板100指数型证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金、东财中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金。

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）	证券 从业	说明
----	----	-------------------	----------	----

		期限		年限	
		任职日期	离任日期		
宝音	本基金基金经理	2025-12-08	-	13年	美国哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中国金融期货交易所助理经理、江苏昆山农村商业银行股份有限公司投资经理、华福证券有限责任公司高级投资经理、东方财富证券股份有限公司利率交易部负责人，现任东财基金管理有限公司总经理助理、固收投资部总监、基金经理。
楚芸	本基金基金经理	2025-12-18	-	7年	香港中文大学理学硕士。曾任平安科技（深圳）有限公司数据分析师、东方金诚国际信用评估有限公司信评分析师，现任东财基金管理有限公司基金经理。
应洁茜	本基金基金经理	2026-02-06	-	13年	美国北卡罗来纳州立大学会计管理学硕士，浙江大学财务管理学士。曾任浙江浙商证券资产管理有限公司基金经理，东证融汇证券资产管理有限公司公募投资管理部负责人兼投资经理，现任东财基金管理有限公司基金经理。
郑铮	本基金基金经理	2026-02-06	-	9.5年	管理学学士。曾任金元顺安基金债券交易员、光大保德信基金债券交易员、东证融汇证券资产管理有限公司公募投资经理，现任东财基

					金管理有限公司基金经理。
高佳贝	本基金基金经理助理	2026-01-26	-	8年	北京理工大学管理学硕士。曾任西藏东方财富投资管理有限公司投资助理、高级投资经理，现任东财基金管理有限公司基金经理助理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

4.1.3 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

本基金基金经理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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，基金管理人公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易管理要求的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易

行为进行监督检查，未发现本基金存在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

2026年上半年，国内债券收益率在基本面走弱、风险偏好剧烈波动、输入性通胀预期反复以及流动性阶段性波动的多重因素博弈中震荡下行。10年期国债活跃券收益率自2025年末的1.86%附近震荡下行至1.72%附近。1月，权益市场延续强势行情、地方债供给启动叠加降息预期落空，10年期国债活跃券收益率上行至1.90%关口。春节前后，大行配置盘积极入场带动收益率回落至1.80%以下。2月中下旬至3月，中东地缘冲突爆发推升国际油价、通胀预期升温，10年期国债收益率再度回升至1.80%上方。4月信贷投放偏弱叠加配置力量回归，10年期国债收益率逐步回落。5月，内需数据走弱强化基本面定价逻辑，债市多头情绪持续升温，6月初10年期国债活跃券收益率一度下行至1.70%附近，30年期特别国债收益率盘中跌破2.2%关口。6月中下旬，受PPI涨幅扩大引发的通胀预期扰动及跨季资金面边际收敛影响，收益率小幅回调。

整体来看，2026年上半年利率债收益率震荡下行，期限利差在历史高分位数震荡，信用债利差继续压缩。本报告期内，本基金秉持既定的投资思路，在坚持中短久期策略的基础上，密切跟踪资金面、宏观运行情况和机构行为变化，顺应曲线形态判断适时优化持仓结构，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2026年06月30日，东财禧悦90天滚动持有中短债A份额净值为1.1499元，报告期内基金份额净值增长率为0.98%，同期业绩比较基准收益率为1.19%；东财禧悦90天滚动持有中短债C份额净值为1.1359元，报告期内基金份额净值增长率为0.89%，同期业绩比较基准收益率为1.19%。

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2026年下半年，国内经济仍处于新旧动能转换期，投资与消费的修复力度有待观察，基本面偏弱对长端利率仍形成底部支撑；但PPI上行带来的通胀预期反复、超长期特别国债供给增加叠加海外流动性收紧预期，长端利率波动仍有放大可能。货币政策方面，央行明确保持流动性充裕，利率走廊收窄与隔夜逆回购机制落地进一步强化了短端利率的稳定预期，资金面呵护下短端品种确定性相对更高。综合来看，中短久期策略在当前环境下的配置价值依然突出：流动性环境有利于中短端品种的票息收益积累，同

业存单利率与信用利差为中短债提供结构性支撑，组合将继续以中短久期为主，兼顾流动性管理与波段增厚机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值、基金资产净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布基金份额净值。

本基金基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会。估值委员会会对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金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

托管人声明：

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：东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金
报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,210,668.38	2,118,183.05
结算备付金		20,002,857.21	-
存出保证金		-	38,752.27
交易性金融资产	6.4.7.2	3,656,610,159.21	3,587,062,299.68
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,656,610,159.21	3,587,062,299.68
资产支持证券 投资		-	-
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	-	660,137,806.68
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		61,078,751.48	2,055,639.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		3,738,902,436.28	4,251,412,681.46
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025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		159,906,814.91	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		24,867,397.03	3,481,152.00
应付管理人报酬		860,991.64	811,683.79
应付托管费		143,498.58	135,280.62
应付销售服务费		170,946.39	165,585.78
应付投资顾问费		-	-
应交税费		162,874.34	169,898.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	132,026.45	104,575.01
负债合计		186,244,549.34	4,868,175.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	3,096,819,882.17	3,737,818,183.81
未分配利润	6.4.7.8	455,838,004.77	508,726,322.03
净资产合计		3,552,657,886.94	4,246,544,505.84
负债和净资产总计		3,738,902,436.28	4,251,412,681.46

注：报告截止日2026年6月30日，东财禧悦90天滚动持有中短债A基金份额净值人民币1.1499元，基金份额总额2,197,325,025.35份；东财禧悦90天滚动持有中短债C基金份额净值人民币1.1359元，基金份额总额903,269,139.13份。基金份额总额合计为3,100,594,164.48份。

6.2 利润表

会计主体：东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至2026年0 6月30日
一、营业总收入		45,656,140.43
1.利息收入		704,086.31
其中：存款利息收入	6.4.7.9	77,680.34
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		626,405.97
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,582,234.48
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	39,637,894.22
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-55,659.74
股利收益	6.4.7.15	-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,369,819.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、营业总支出		10,167,679.59
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	5,591,338.18
2.托管费	6.4.10.2.2	931,889.67
3.销售服务费	6.4.10.2.3	1,121,110.42
4.投资顾问费		-
5.利息支出		2,272,634.82
其中：卖出回购金融资产支出		2,272,634.82

6.信用减值损失	6.4.7.18	-
7.税金及附加		109,825.29
8.其他费用	6.4.7.19	140,881.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,488,460.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,488,460.84
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		35,488,460.84

注：本基金基金合同生效日为2025年12月8日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026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	3,737,818,183.81	508,726,322.03	4,246,544,505.84
二、本期期初净资产	3,737,818,183.81	508,726,322.03	4,246,544,505.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-640,998,301.64	-52,888,317.26	-693,886,618.90
（一）、综合收益总额	-	35,488,460.84	35,488,460.84
（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）	-640,998,301.64	-88,376,778.10	-729,375,079.74

其中：1.基金申购款	483,439,246.27	69,941,542.69	553,380,788.96
2.基金赎回款	-1,124,437,547.91	-158,318,320.79	-1,282,755,868.70
（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	3,096,819,882.17	455,838,004.77	3,552,657,886.94

注：本基金基金合同生效日为2025年12月8日，无上年度可比期间数据。

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：

顾勇	侯福岩	陆文澄
_____	_____	_____
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

东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金由东证融汇禧悦90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更而来。

根据《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》等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，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变更管理人，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；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。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的变更已经中国证监会2025年10月22日证监许可〔2025〕2344号文准予变更注册。

2025年10月25日至2025年11月23日，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通讯方式召开集合计划份额持有人大会，并于2025年11月24日审议通过了《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》，同意东证融汇禧悦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，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；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；并调整存续期、投资范围、投资策略、投资限制、估值方法、争议解决条款等内容。上述集合计划份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。

自2025年12月8日起，《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》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》同日起失效。本基金的基金管理人为东财基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《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》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金主要投资于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、次级债、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、国债期货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。本基金不投资于股票，但可持有因可转换债券转股、可交换债券换股所形成的股票。因所持可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票，本基金将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。本基金的投资组合比例为：本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短期债券的比例不低于非现金资产的80%；本基金投资可转换债券（含分离交易可转换债券）和可交换债券比例合计不超过基金资产的20%。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。本基金的业绩比较基准为：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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2026年1月1日至2026年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

（2）金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易

日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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，基金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）当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数；

（3）经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

（2）投资收益

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

（3）公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）信用减值损失

本基金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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

(5) 其他收入

在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资者选择将现金红利自动转为基金份额进行再投资，红利再投资取得的份额，其运作期的起始日和到期日与原份额相同；

(3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位各类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各类基金份额对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金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：

根据中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；2027年12月31日前，公募证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

（2）对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行

的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

（3）对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

（4）本基金的城市维护建设税、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 2026年06月30日
活期存款	1,090,209.28
等于：本金	1,089,439.75
加：应计利息	769.53
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	120,459.10
等于：本金	120,443.79
加：应计利息	15.31
减：坏账准备	-
合计	1,210,668.38

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026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	330,483,304.38	2,466,218.07	333,925,218.07	975,695.62
	银行间市场	3,292,326,368.98	23,339,041.14	3,322,684,941.14	7,019,531.02
	合计	3,622,809,673.36	25,805,259.21	3,656,610,159.21	7,995,226.64
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,622,809,673.36	25,805,259.21	3,656,610,159.21	7,995,226.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026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	33,766.30
其中：交易所市场	-
银行间市场	33,766.30
应付利息	-
预提费用-审计费	29,752.78
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	9,000.00
合计	132,026.45

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东财禧悦90天滚动持有中短债A

金额单位：人民币元

项目 (东财禧悦90天滚动持有中短 债A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,587,528,901.49	2,583,079,785.17
本期申购	388,278,780.32	387,615,746.42
本期赎回（以“-”号填列）	-778,482,656.46	-777,144,788.55
本期末	2,197,325,025.35	2,193,550,743.04

6.4.7.7.2 东财禧悦90天滚动持有中短债C

金额单位：人民币元

项目 (东财禧悦90天滚动持有中短 债C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,154,738,398.64	1,154,738,398.64
本期申购	95,823,499.85	95,823,499.85
本期赎回（以“-”号填列）	-347,292,759.36	-347,292,759.36

本期末	903,269,139.13	903,269,139.13
-----	----------------	----------------

注：1、本基金合同生效日的基金份额和账面金额由本基金合同生效前一日的集合计划份额和账面金额结转而来。

2、申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东财禧悦90天滚动持有中短债A

单位：人民币元

项目 (东财禧悦90天滚动持有中短债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	385,010,626.65	-21,683,863.66	363,326,762.99
本期期初	385,010,626.65	-21,683,863.66	363,326,762.99
本期利润	21,855,755.54	3,745,533.06	25,601,288.60
本期基金份额交易产生的变动数	-58,886,936.24	3,081,630.07	-55,805,306.17
其中：基金申购款	60,103,658.08	-2,727,216.19	57,376,441.89
基金赎回款	-118,990,594.32	5,808,846.26	-113,181,748.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	347,979,445.95	-14,856,700.53	333,122,745.42

6.4.7.8.2 东财禧悦90天滚动持有中短债C

单位：人民币元

项目 (东财禧悦90天滚动持有中短债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	141,030,527.81	4,369,031.23	145,399,559.04
本期期初	141,030,527.81	4,369,031.23	145,399,559.04
本期利润	8,262,885.66	1,624,286.58	9,887,172.24
本期基金份额交易产生的变动数	-31,441,123.64	-1,130,348.29	-32,571,471.93
其中：基金申购款	12,089,389.97	475,710.83	12,565,100.80

基金赎回款	-43,530,513.61	-1,606,059.12	-45,136,572.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,852,289.83	4,862,969.52	122,715,259.35

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	21,176.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-2,014.87
结算备付金利息收入	58,516.95
其他	1.85
合计	77,680.34

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

本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	39,257,322.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	380,571.80
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	39,637,894.22
----	---------------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,189,000,773.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,158,866,437.72
减：应计利息总额	29,708,641.02
减：交易费用	45,123.32
买卖债券差价收入	380,571.80

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
期货投资	-55,659.74

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	5,369,819.64
——股票投资	-
——债券投资	5,369,819.64
——资产支持证券投资	-
——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	-
合计	5,369,819.64

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

汇划手续费	28,521.06
账户维护费-中债登	9,000.00
账户维护费-上清所	14,100.00
合计	140,881.21

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期间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
东财基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商
上海天天基金销售有限公司（“天天基金”）	与管理人受同一实际控制人控制的公司、基金销售机构

注：下述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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
东财证券	241,880,989.31	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 2026年01月01日至2026年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
东财证券	5,850,700,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30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
东财证券	247.32	100.00%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2026年01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,591,338.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,769,015.30
应支付基金管理人的净管理费	2,822,322.88

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	931,889.67

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

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 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财禧悦90天滚动持有中短债 A	东财禧悦90天滚动持有中短 债C	合计
	天天基金	0.00	5,977.36

			6
合计	0.00	5,977.36	5,977.36

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期未发生与关联方的银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

- 1、本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。
- 2、本基金基金合同生效日为2025年12月8日，本期是指2026年1月1日至2026年6月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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	本期
------	----

称	2026年01月01日至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行- 托管户	1,090,209.28	21,176.41
东财证券- 证券资金 户	120,459.10	-2,014.87

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于东财证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026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

本基金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

本基金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2026年6月30日止，本基金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50,002,054.79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	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	--------	-------	--------

09260401	26农发清发01	2026-07-01	100.14	540,000	54,074,667.94
合计				540,000	54,074,667.94

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额109,904,760.12元，于2026年7月1日、2026年7月3日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为债券型基金，其预期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、合规审计委员会、风险管理委员会、督察长、合规审计部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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	上年度末
--------	-----	------

	2026年06月30日	2025年12月31日
A-1	20,021,950.68	100,356,100.28
A-1以下	-	-
未评级	686,219,089.86	1,897,054,702.64
合计	706,241,040.54	1,997,410,802.92

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资
无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资
无。

6.4.13.2.4 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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	831,893,964.37	152,600,878.36
AAA以下	193,981,094.81	20,302,849.32
未评级	1,805,083,773.81	1,217,005,735.93
合计	2,830,958,832.99	1,389,909,463.61

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资
无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-

AAA以下	-	-
未评级	119,410,285.68	199,742,033.15
合计	119,410,285.68	199,742,033.15

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指开放式基金未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因投资品种交易不活跃而出现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投资。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情 况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。 本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，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，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理 办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立 健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性 制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管 理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中 度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压 力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投 资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的 匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金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，有效保障基金持 有人利益。本基金所持的所有证券均在银行间同业市场交易，因此，除本基金于期末持 有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖 出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券 资产的公允价值。

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金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，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,210,668.38	-	-	-	1,210,668.38
结算备付金	20,002,857.21	-	-	-	20,002,857.21
交易性金融资产	1,745,356,242.00	1,695,059,464.06	216,194,453.15	-	3,656,610,159.21
应收申购款	-	-	-	61,078,751.48	61,078,751.48
资产总计	1,766,569,767.59	1,695,059,464.06	216,194,453.15	61,078,751.48	3,738,902,436.28
负债					
卖出回购金融资产款	159,906,814.91	-	-	-	159,906,814.91
应付赎回款	-	-	-	24,867,397.03	24,867,397.03
应付管理人报酬	-	-	-	860,991.64	860,991.64
应付托管费	-	-	-	143,498.58	143,498.58

应付销售服务费	-	-	-	170,946.39	170,946.39
应交税费	-	-	-	162,874.34	162,874.34
其他负债	-	-	-	132,026.45	132,026.45
负债总计	159,906,814.91	-	-	26,337,734.43	186,244,549.34
利率敏感度缺口	1,606,662,952.68	1,695,059,464.06	216,194,453.15	34,741,017.05	3,552,657,886.94
上年度末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,118,183.05	-	-	-	2,118,183.05
存出保证金	-	-	-	38,752.27	38,752.27
交易性金融资产	2,967,372,898.44	619,689,401.24	-	-	3,587,062,299.68
买入返售金融资产	660,137,806.68	-	-	-	660,137,806.68
应收申购款	-	-	-	2,055,639.78	2,055,639.78
资产总计	3,629,628,888.17	619,689,401.24	-	2,094,392.05	4,251,412,681.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,481,152.00	3,481,152.00
应付管理人报酬	-	-	-	811,683.79	811,683.79

应付托管费	-	-	-	135,280.62	135,280.62
应付销售服务费	-	-	-	165,585.78	165,585.78
应交税费	-	-	-	169,898.42	169,898.42
其他负债	-	-	-	104,575.01	104,575.01
负债总计	-	-	-	4,868,175.62	4,868,175.62
利率敏感度缺口	3,629,628,888.17	619,689,401.24	-	-2,773,783.57	4,246,544,505.84

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	利率下降25个基点	16,469,175.75	5,915,275.75
	利率上升25个基点	-16,279,569.34	-5,875,296.90

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，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。

本基金通过对国内外宏观经济形势、市场利率走势和债券市场供求关系等因素的分析和判断，运用多种投资策略构建和调整基金投资组合，力争实现基金资产的稳健增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末无其他价格风险敞口。

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：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是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；

第三层次输入值是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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	3,656,610,159.21	3,587,062,299.68
第三层次	-	-
合计	3,656,610,159.21	3,587,062,299.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根

据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2025年12月31日：同）。

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货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

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，本基金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	3,656,610,159.21	97.80
	其中：债券	3,656,610,159.21	97.80
	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	21,213,525.59	0.57
8	其他各项资产	61,078,751.48	1.63

9	合计	3,738,902,436.28	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

本基金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

本基金本报告期内未进行股票投资。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	908,390,727.93	25.57
	其中：政策性金融债	248,132,268.21	6.98
4	企业债券	477,170,340.28	13.43
5	企业短期融资券	706,524,741.91	19.89
6	中期票据	1,445,114,063.41	40.68
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	119,410,285.68	3.36

9	其他	-	-
10	合计	3,656,610,159.21	102.93

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	2420017	24杭州银行小微债	1,000,000	100,919,945.21	2.84
2	09260401	26农发清发01	970,000	97,134,125.75	2.73
3	232380006	23中行二级资本债01A	800,000	83,394,064.66	2.35
4	2520004	25北京银行01	800,000	81,047,061.92	2.28
5	260411	26农发11	800,000	80,388,602.74	2.26

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金依据基金合同和风险控制原则，以套期保值为目的参与国债期货交易。对期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行密切跟踪，确保国债期货投资对基金总体风险可控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金参与国债期货的投资交易，符合法律法规规定和基金合同的投资限制，并遵守相关的业务规则，且对基金的总体风险相对可控。

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是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

2025年8月1日，国家金融监督管理总局对中国农业发展银行处以行政处罚。

2025年10月31日，国家金融监督管理总局对中国银行股份有限公司处以行政处罚。

2026年6月18日和2025年9月30日，国家金融监督管理总局北京监管局对北京银行股份有限公司处以行政处罚。2025年11月26日，中国人民银行对北京银行股份有限公司处以行政处罚。

2025年9月5日，国家金融监督管理总局对浙商银行股份有限公司处以行政处罚。

2026年6月5日，国家金融监督管理总局对中国工商银行股份有限公司处以行政处罚。2025年12月10日，中国人民银行对中国工商银行股份有限公司处以行政处罚。

基金管理人对上述主体发行的相关证券进行了深入了解和分析，执行了内部严格的投资决策流程，符合相关法律法规及基金合同的要求。除此以外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资范围不包括股票。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	61,078,751.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	61,078,751.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

本基金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

由于四舍五入的原因，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	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
东财禧悦90天滚动持有中短债A	23,828	9,221.38	248,116,493.58	11.29%	1,949,208,531.77	88.71%
东财禧悦90天滚动持有中短债C	53,293	16,949.11	5,929,924.87	0.66%	897,339,214.26	99.34%

合计	28 4,5 68	10,895.79	254,046,418.45	8.19%	2,846,547,746.03	91.81%
----	-----------------	-----------	----------------	-------	------------------	--------

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，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基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	东财禧悦90天滚动持有中短债A	19,737.06	0.00%
	东财禧悦90天滚动持有中短债C	-	-
	合计	19,737.06	0.00%

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	东财禧悦90天滚动持有中短债A	0~10
	东财禧悦90天滚动持有中短债C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东财禧悦90天滚动持有中短债A	0~10
	东财禧悦90天滚动持有中短债C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东财禧悦90天滚动持有 中短债A	东财禧悦90天滚动持有 中短债C
基金合同生效日(2025年12月08日)基金份额总额	2,629,862,333.52	1,171,580,703.81
本报告期期初基金份额总额	2,587,528,901.49	1,154,738,398.64
本报告期基金总申购份额	388,278,780.32	95,823,499.85
减：本报告期基金总赎回份额	778,482,656.46	347,292,759.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,197,325,025.35	903,269,139.13

§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，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人：（1）自2026年2月13日起，倪永彪新任基金管理人督察长，离任总经理助理；沙福贵不再代任督察长。（2）自2026年2月27日起，顾勇新任基金管理人总经理、财务负责人，离任副总经理；沙福贵离任总经理、财务负责人。（3）根据基金管理人2026年2月28日发布的《东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告》，基金管理人近12个月内进行了董事变更。

基金托管人：本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务的诉讼。本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
东财证券	2	-	-	247.32	100.00%	-

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力等因素的基础上，选择证券经纪商。
- 3、选择券商的程序：
 - (1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；
 - (2) 本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总	成交金额	占当期基金成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例		额的比例
东财证 券	241,880,989. 31	100.00%	5,850,700,000. 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	东财基金管理有限公司关于更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告	证监会规定网站及报刊	2026-01-29
2	东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-07
3	东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-02-10
4	东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2026-02-10
5	东财基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-14
6	东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
7	东财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
8	东财基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	证监会规定网站及报刊	2026-03-31
9	东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金2026年第1季度报告	证监会规定网站	2026-04-21
10	东财基金管理有限公司关于旗下证券投资基金投资资产	证监会规定网站及报刊	2026-05-13

	支持证券的公告		
11	东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-06-27
12	东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定网站	2026-06-27

§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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金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，本基金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

- 一、中国证监会准予东证融汇禧悦90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更注册的文件
- 二、《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》
- 三、《东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

东财基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日