

东证融汇添添益中短债债券型集合资产 管理计划清算报告

管理人：东证融汇证券资产管理有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二五年八月十二日

报告公告日期：二〇二五年八月十四日

一、重要提示

东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由东北证券6号核心优势集合资产管理计划变更而来。根据中国证券监督管理委员会(以下简称“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,中国证监会已批准东北证券6号核心优势集合资产管理计划变更为本集合计划。经中国证监会批准,自2022年2月10日起,“东北证券6号核心优势集合资产管理计划”正式变更为“东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划”。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。本集合计划管理人为东证融汇证券资产管理有限公司,托管人为中国建设银行股份有限公司。

《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》(以下简称“《资产管理合同》”)中关于集合计划存续期限约定,“本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续至2025年8月11日。本集合计划自2025年8月11日后,按照中国证监会相关规定执行。2025年8月11日后,不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的,无须召开集合计划份额持有人大会”。东证融汇证券资产管理有限公司依据法律法规的规定及《资产管理合同》的约定履行财产清算程序并终止《资产管理合同》,此事项无需召开集合计划份额持有人大会。本集合计划的最后运作日为2025年8月11日。

本集合计划于2025年8月12日进入清算程序,由本集合计划管理人东证融汇证券资产管理有限公司、集合计划托管人中国建设银行股份有限公司、安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所组成集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序,并由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、集合计划概况

集合计划名称	东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划
--------	-----------------------

集合计划简称	东证融汇添添益中短债	
集合计划主代码	970132	
集合计划运作方式	契约型开放式	
集合计划合同生效日	2022 年 2 月 10 日	
集合计划管理人	东证融汇证券资产管理有限公司	
集合计划托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属各类份额的简称	东证融汇添添益中短债 A	东证融汇添添益中短债 C
下属各类份额的交易代码	970132	970133
最后运作日（2025 年 8 月 11 日）集合计划份额总额	345,049,339.96 份	
最后运作日（2025 年 8 月 11 日）下属各类份额总额	146,232,505.05 份	198,816,834.91 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	1、资产配置策略 本集合计划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。 本集合计划主要根据不同类别资产的收益率水平、流动性指标、市场偏好、收益目标等决定不同类别资产的目标配置比率。管理人在充分考虑各类资产的收益率、流动性、规模及风险的基础上，优先选择资产规模大、赎回到账速度快、收益率较高的资产。通过建立资产池，灵活调整投资组合中的投资品种及投资比例，在保证投资组合流动性的基础上，力争实现投资增值。 2、固定收益类投资策略 本集合计划将通过分析宏观经济形势、政策预期和资金供给，并结合债券久期策略和收益率曲线结构的变化趋势来构建债券投资组合，把握利率债行情。在此基础上，积极采用信用策略，发掘市场上价值被低估的高收益信用债，获取较好的信用收益，力争达到产品债券组合安全性与收益性的统一。 （1）利率预测 本集合计划通过对影响债券投资的宏观经济形势进行分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，作为管理人调整利率久期，构建债券组合的基础。本集合计划主要关注的宏观经济因素有 GDP、通货膨胀、固定资产投资、对外贸易情况、全球经济形势等。通过对宏观经济形势的深度分析，形成对利率的科学预测，实现对债券投资组合久期的正确把握。 （2）信用策略 本集合计划依托于内部信用评级体系，研究企业债券信用。根据国民经济运行的周期阶段，分析企业背景、企业	

	的市场地位、企业盈利模式、企业管理水平、企业财务状况、信息披露状况、外部流动性支持能力和债券担保增信状况，综合评价出债券发行人信用风险、评价债券的信用等级，作为信用产品投资的研究支持基础；通过全面的信用分析，挖掘风险收益匹配度极佳的投资品种，为实时交易提供参考；通过研究信用市场环境的变化，掌握并预测信用利差波动的规律，作为信用品种配置时机的重要依据。本集合计划将投资信用评级不低于 AA+级的信用债，其中 AA+级信用债占持仓信用债的比例为 0-50%，AAA 级信用债占持仓信用债的比例为 50%-100%。 本集合计划对信用债评级的认定参考管理人选定的评级机构出具的信用评级，依据的评级机构不包括中债资信。本集合计划投资的短期融资券、超短期融资券的信用评级参照评级机构出具的主体信用评级；其他信用债的信用评级参照评级机构出具的债项信用评级，无债项信用评级的参照主体信用评级。 （3）收益曲线策略 本集合计划将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、息票率、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，通过模型进行估值，重点选择较高到期收益率、预期信用质量将改善以及价值尚未被市场充分发现的个券。 （4）跨市场套利策略 鉴于同一债券品种在银行间市场和交易所市场、同期限同信用评级品种在一、二级市场由于市场交易方式、投资者结构或市场流动性的不同而可能出现收益率的差异，本集合计划将依据内部固定收益模型，推理套利充分可行的基础上，寻找合适交易时点，进行跨市场套利。 3、资产支持证券投资策略 本集合计划将重点对市场利率、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。
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，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。

三、集合计划最后运作日财务会计报告（经审计）

资产负债表
会计主体：东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划
报告截止日：2025年8月11日（集合计划最后运作日）

	单位：人民币元
	最后运作日 2025 年 8 月 11 日
资 产：	
货币资金	404,007,918.03
结算备付金	614,908.34
存出保证金	21,112.00
资产总计	404,643,938.37
负 债：	
应付赎回款	22,443,189.62
应付管理人报酬	48,791.88
应付托管费	13,011.17
应付销售服务费	22,531.75
其他负债	130,255.50
负债合计	22,657,779.92
净资产：	
实收基金	345,049,339.96
未分配利润	36,936,818.49
净资产合计	381,986,158.45
负债和净资产总计	404,643,938.37

注：截至集合计划最后运作日2025年8月11日，集合计划A类份额单位净值1.1171元，份
额 总 额 146,232,505.05 份； 集 合 计 划 C 类 份 额 单 位 净 值 1.0997 元， 份 额 总 额
198,816,834.91份。集合计划份额总额合计为345,049,339.96份。

四、清算说明

本集合计划清算期为2025年8月12日，集合计划财产清算小组对本集合计划的资产、
负债进行清算，具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《资产管理合同》第十九部分“资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算”的规定，清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本集合计划最后运作日的货币资金为人民币404,007,918.03元，其中存放于托管账户人民币403,902,806.61元，应计银行存款利息人民币105,111.42元。截至2025年8月12日，货币资金为人民币381,572,357.60元，其中存放于托管账户人民币381,459,616.99元，应计银行存款利息人民币112,740.61元。

(2) 本集合计划最后运作日的结算备付金为人民币614,908.34元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币614,838.23元，应计结算备付金利息人民币70.11元。截至2025年8月12日，结算备付金为人民币614,914.32元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金人民币614,838.23元，应计结算备付金利息人民币76.09元。

(3) 本集合计划最后运作日的存出保证金为人民币21,112.00元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金人民币21,103.94元，应计存出保证金利息人民币8.06元。截至2025年8月12日，存出保证金为人民币21,112.21元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金人民币21,103.94元，应计存出保证金利息人民币8.27元。

3、负债清偿情况

(1) 本集合计划最后运作日应付赎回款为人民币22,443,189.62元，该款项已于2025年8月12日完成支付。

(2) 本集合计划最后运作日应付管理人报酬为人民币48,791.88元，该款项将于2025年8月12日后支付。

(3) 本集合计划最后运作日应付托管费为人民币13,011.17元，该款项将于2025年8月12日后支付。

(4) 本集合计划最后运作日应付销售服务费为人民币22,531.75元，该款项将于2025年8月12日后支付。

（5）本集合计划最后运作日其他负债为人民币130,255.50元，其中应付交易费用为人民币27,075.50元、应付律师费为人民币10,000.00元、预提审计费为人民币15,000.00元、预提信息披露费为人民币73,315.00元、预提账户维护费为人民币3,200.00元、预提银行汇划费为人民币1,665.00元，上述款项将于2025年8月12日之后支付。

4、清算期间的清算损益情况

单位：人民币元	
项目	2025年8月12日
一、清算收益	
1、利息收入（注1）	7,635.38
清算收益小计	7,635.38
二、清算费用	
1、其他费用（注2）	
清算费用小计	0.00
三、清算净收益（净损失以“-”号填列）	7,635.38

注1：利息收入系以当前适用的利率预估计提的2025年8月12日的利息收入，其中银行存款利息人民币7,629.19元、结算备付金利息人民币5.98元和存出保证金利息人民币0.21元。上述利息将于下一结息日之后划入托管账户。经集合计划管理人确认，如截至划付清算款前一日仍有未变现的资产（银行存款利息、结算备付金及其利息、存出保证金及其利息），将由集合计划管理人以自有资金先行垫付，垫付资金将于划付清算款前划入本集合计划托管账户。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元	
项目	金额
一、最后运作日2025年8月11日集合计划净资产	381,986,158.45
加：清算期间净收益（净损失以“-”号填列）	7,635.38
减：集合计划净赎回转出金额 （于2025年8月12日确认的投资者赎回转出申请）	36,562,973.40
二、2025年8月12日集合计划净资产	345,430,820.43

截至2025年8月12日，应付赎回款为人民币36,562,973.40元，该款项将于2025年8月12日后支付。

资产处置及负债清偿后，截至2025年8月12日，本集合计划总资产为人民币382,208,384.13元，净资产为人民币345,430,820.43元，根据本集合计划的《资产管理合同》约定，依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

2025年8月12日至清算款实际划出日前一日的收益归集合计划份额持有人所有。为保护集合计划份额持有人利益，加快清盘速度，管理人东证融汇证券资产管理有限公司将以自有资金先行垫付该笔款项，实际结息金额与垫付金额的尾差由管理人承担，管理人垫付资金到账日起孳生的利息归管理人所有。

截至2025年8月12日，经集合计划管理人以及集合计划托管人确认，本集合计划托管账户银行存款（不含应计利息）余额共计人民币381,459,616.99元。

6、财产清算报告的告知安排

本清算报告已经托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向本集合计划份额持有人公告。清算报告公告后，管理人将遵照法律法规、《资产管理合同》等规定及时进行分析。

五、备查文件

1、备查文件目录

（1）《东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划清算审计报告》

（2）上海市通力律师事务所关于《东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划清算报告》的法律意见

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。

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。

东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划集合计划财产清算小组

二〇二五年八月十四日