

东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划

2026 年第二季度管理报告

管理人：东方财富证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司杭州分行

2026 年 07 月

一、重要提示

资管计划管理人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。

资管计划托管人已复核本报告中的财务指标和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

资管计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资管计划资产，但不保证资管计划一定盈利，也不保证最低收益。

资管计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本资管计划的风险揭示书。

本报告仅供报告期末持有本计划份额的投资者查阅，未经许可，不得传播和转发，也不得对本报告进行任何形式的复制或修改。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

二、资产管理计划概况

（一）名称：东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”、“资管计划”）

（二）产品类型：固定收益类

（三）产品成立日：2024-12-10

（四）存续期限：10[年]

（五）管理人：东方财富证券股份有限公司

（六）托管人：招商银行股份有限公司杭州分行

三、管理人履职报告

（一）投资经理简介（截至本报告期末）

鲍兵，男，复旦大学管理学院金融工程硕士。曾任兴业国际信托有限公司资产管理部投资经理、东亚前海证券有限责任公司资产管理部投资经理。2023 年 2 月加入东方财富证券资产管理总部，现任东方财富证券资产管理总部投资经理。

刘洋，女，武汉大学金融学硕士。曾任长江证券固定收益总部投顾助理、长江期货资管业务总部投资经理，拥有丰富的债券交易、研究和投资经验。2023

年3月加入东方财富证券资产管理总部，现任东方财富证券资产管理总部投资经理。

（二）投资经理工作报告

2026年第二季度债券市场整体运行平稳偏强，行情主要受到资金价格低位运行、宏观数据结构性偏弱等因素驱动，长短端收益率总体震荡下行。其中，10年期国债在1.7%-1.8%区间附近震荡，整体呈现下行态势。信用债方面，整体收益率与国债收益率波动趋同、震荡下行，且低等级、长久期信用债收益率下行幅度更为显著。信用利差方面，各等级信用利差延续收窄态势，但结构分化明显，1年期高等级利差小幅走阔，3年期和5年期各等级利差继续收窄，中低等级利差收窄幅度整体高于高等级。

产品操作层面，针对部分债券标的进行了止盈操作，另外随着产品规模的上升，债券整体仓位被动下降。实际运作结果来看，产品整体运行平稳。

往后看，基本面方面，当前实体经济内部分化，制造业PMI等景气度指数连续多月在荣枯线附近，高科技创新型等新动能板块与出口外需板块增长强劲，但内需方面尚未边际扭转，整体中短期宏观基本面对于债市的利空较为有限。货币政策方面，央行或仍维持稳健宽松的政策立场，只是降息空间或相对受限，可能仍倾向于通过结构性货币政策工具精准滴灌实体经济。因此，利率整体预计呈现窄幅震荡走势，特别是10年以内曲线的国债品种，预计上下空间较小。30年及其他更长久期国债可作为波动操作的品种，在市场情绪较为极端时进行反向操作，以此争取快速获得资本利得。

信用债方面，在当前信用利差较窄的背景下，未来信用方面操作会更加审慎，预计以优质信用主体为主要配置方向，同时辅以波段操作，保持中性久期。

（三）管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，本计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《东方财富证券添安ESG债券3M1号集合资产管理计划资产管理合同》的规定，本着诚实守信、审慎尽责、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，在严格控制风险的基础上，为本计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本计划运作整体合法合规，没有损害份额持有人利益。本计划的投

资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的规定。

（四）管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

1、公平交易制度和控制方法

本计划管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》以及有关法律法规的规定，建立了公平交易制度及异常交易监控机制，公平对待所管理的不同资产，对投资交易行为进行监控、分析、评估、核查，监督投资交易的过程和结果。

2、公平交易制度的执行情况

本报告期内，本计划管理人严格执行《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》以及有关法律法规的规定，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待所管理的所有资管计划。

3、异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本计划存在异常交易行为。

四、托管人履职报告

本报告期内，本托管人在东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划托管协议》（如有）和其他有关规定，不存在损害投资者利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，本托管人按照国家有关规定、《东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划托管协议》（如有）和其他有关规定，对受托资产的投资运作方面进行了监督，未发现管理人有损害投资者利益的行为。

本托管人复核审查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。

五、主要财务指标和投资表现情况

主要财务指标 单位：人民币元

主要财务指标	本期间
本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	5,167,718.29
本期利润	6,334,647.91
其中：本期公允价值变动损益	1,166,929.62
加权平均份额本期利润	0.0090
加权平均净值利润率	0.8480%
本期单位净值增长率	1.0166%
期末可分配利润	64,366,561.81
期末可供分配份额利润	0.0526
期末资产净值	1,301,591,804.89
期末单位资产净值	1.0632
单位累计净值增长率	7.0954%

注：1、本处“本期公允价值变动损益”已扣除暂估附加税。
 2、所述业绩指标不包括持有人认购或交易本计划的各项费用，计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。

截至 2026 年 6 月 30 日，本计划单位净值为 1.0632 元。

六、投资组合报告

(一) 报告期末资管计划资产组合情况 单位：人民币元

序号	项目	金额	占资管计划总资产的比例 (%)
1	权益投资		
	其中：股票		
2	基金		
3	固定收益投资	819,340,691.01	62.89
	其中：债券	819,340,691.01	62.89
	资产支持证券		
4	金融衍生品投资		
5	买入返售金融资产	476,893,191.30	36.61

	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	6,485,867.87	0.50
7	其他资产	6,564.45	
8	合计	1,302,726,314.63	100.00

注：因四舍五入，期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

（二）运用杠杆情况

本报告期末，本计划资产净值为 1,301,591,804.89 元，资产总值为 1,302,726,314.63 元，杠杆比率为 100.09%。

七、财务会计报告

（一）资管计划资产负债表

单位：人民币元

资产	期末余额	上年年末余额
资 产：		
货币资金	6,416,464.12	136,789.18
结算备付金	69,403.75	6,216.62
存出保证金	6,564.45	2,875.65
衍生金融资产	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	3,970,000.00
买入返售金融资产	476,893,191.30	3,571,437.78
发放贷款和垫款		
交易性金融资产	819,340,691.01	63,736,102.04
债权投资	0.00	0.00
其他债权投资		
其他权益工具投资		
长期股权投资	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	1,302,726,314.63	71,423,421.27

资管计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债和净资产	期末余额	上年年末余额
负 债：		

短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	8,805,424.57
应付管理人报酬	741,212.79	71,003.34
应付托管费	9,265.19	887.59
应付销售服务费	0.00	0.00
应付投资顾问费	0.00	0.00
应交税费	232,252.20	19,021.21
应付清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	151,779.56	23,224.90
负债合计	1,134,509.74	8,919,561.61
净资产：		
实收资金	1,224,219,524.75	59,740,097.34
其他综合收益		
未分配利润	77,372,280.14	2,763,762.32
净资产合计	1,301,591,804.89	62,503,859.66
负债和净资产总计	1,302,726,314.63	71,423,421.27

(二) 资管计划经营业绩表

单位：人民币元

项目	本期金额	上期金额
一、营业总收入	7,230,191.44	1,748,674.35
利息收入	780,551.04	53,356.52
投资收益（损失以“-”填列）	5,278,494.65	1,053,943.90
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	1,171,145.75	641,373.93
汇兑损益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
其他业务收入	0.00	0.00
二、营业总支出	895,543.53	404,679.34
管理人报酬	801,457.92	351,795.64
其中：暂估管理人报酬	0.00	0.00
托管费	9,265.19	1,401.46
销售服务费	0.00	0.00
投资顾问费	0.00	0.00
利息支出	47,067.08	35,092.96
信用减值损失	0.00	0.00

税金及附加	22,655.98	6,102.88
其他费用	15,097.36	10,286.40
三、利润总额	6,334,647.91	1,343,995.01
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列	6,334,647.91	1,343,995.01
五、其他综合收益的税后净额		
六、综合收益总额	6,334,647.91	1,343,995.01

八、投资收益分配情况

本报告期内，未发生投资收益分配情况。

九、管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

本报告期内，本计划的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式均按资产管理合同及相关补充文件（如有）的约定执行。

十、涉及投资者权益的事项说明

（一）重大事项

1、投资经理变更情况

本报告期内，未发生投资经理变更。

2、重大关联交易情况

本报告期内，未发生重大关联交易。

3、其它涉及投资者权益的重大事项情况

本报告期内，未发生其它涉及投资者权益的重大事项。

（二）其他事项

1、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与情况

截至本报告期末，管理人及管理人子公司持有本计划份额合计47,223,271.63份，占产品总份额的3.86%。

2、证券期货经营机构董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与情况

截至本报告期末，管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的情况如下：

类型	数量	合计持有份额（份）	占总份额比例
关联公司	0	0.00	0%
关联自然人	0	0.00	0%
同一管理人管理的资产管理计划	1	65,900,075.87	5.38%
从业人员及其配偶	2	565,984.42	0.05%

注：如某一关联方为“从业人员及其配偶”且为“关联自然人”，则统一计入“从业人员及其配偶”，不做重复统计。

十一、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、《东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划说明书》；
- 3、《东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划风险揭示书》；
- 4、《东方财富证券添安 ESG 债券 3M1 号集合资产管理计划托管协议》（如有）；
- 5、资管计划管理人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

文件存放地点：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

信息披露网址：<http://www.18.cn/>

信息披露电话：95357

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东方财富证券股份有限公司。

东方财富证券股份有限公司

2026 年 07 月