

---

# 东方红货币市场基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

### 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。本年度报告由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	东方红货币		
基金主代码	005056		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017 年 8 月 25 日		
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,039,198,331.43 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 E
下属分级基金的交易代码:	005056	005057	005058
报告期末下属分级基金的份额总额	56,678,601.59 份	1,937,170,097.50 份	45,349,632.34 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在本金安全的前提下，确保基金资产的高流动性，追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	当期银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

### 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		上海东方证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李云亮	郭明
	联系电话	021-63325888	010-66105798
	电子邮箱	service@dfham.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009200808	95588
传真		021-63326981	010-66105799

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的互联网网址	www.dfham.com
基金年度报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

期间数据和指标	2018 年			2017 年 8 月 25 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日		
	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 E	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 E
本期已实现收益	1,945,666.83	54,051,413.91	2,235,463.15	273,851.78	18,036,691.27	227,352.85
本期利润	1,945,666.83	54,051,413.91	2,235,463.15	273,851.78	18,036,691.27	227,352.85
本期净值收益率	3.3888%	3.6366%	3.5435%	1.3782%	1.4637%	1.4320%
期末数据和指标	2018 年末			2017 年末		
	56,678,601.59	1,937,170,097.50	45,349,632.34	18,942,137.48	899,338,738.57	25,601,178.49

净值						
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2018 年 12 月 31 日；“本期”指 2018 年 1 月 1 日- 2018 年 12 月 31 日。

2、东方红货币 A、东方红货币 B 与东方红货币 E 适用不同的销售服务费率。

3、本基金收益分配从为按日结转份额。

4、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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.6555%	0.0014%	0.0882%	0.0000%	0.5673%	0.0014%
过去六个月	1.3765%	0.0014%	0.1764%	0.0000%	1.2001%	0.0014%
过去一年	3.3888%	0.0021%	0.3500%	0.0000%	3.0388%	0.0021%
自基金合同生效起至今	4.8137%	0.0020%	0.4737%	0.0000%	4.3400%	0.0020%

东方红货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.7166%	0.0014%	0.0882%	0.0000%	0.6284%	0.0014%
过去六个月	1.4993%	0.0014%	0.1764%	0.0000%	1.3229%	0.0014%
过去一年	3.6366%	0.0021%	0.3500%	0.0000%	3.2866%	0.0021%
自基金合同生效起至今	5.1536%	0.0020%	0.4737%	0.0000%	4.6799%	0.0020%

东方红货币 E

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 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	0.6937%	0.0014%	0.0882%	0.0000%	0.6055%	0.0014%
过去六个月	1.4531%	0.0014%	0.1764%	0.0000%	1.2767%	0.0014%
过去一年	3.5435%	0.0021%	0.3500%	0.0000%	3.1935%	0.0021%
自基金合同 生效起至今	5.0263%	0.0020%	0.4737%	0.0000%	4.5526%	0.0020%

注：1、自基金合同生效日起至今指 2017 年 8 月 25 日-2018 年 12 月 31 日。

根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=当期银行活期存款利率（税后）。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（benchmark<sub>t</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 100\% * [\text{t 日当期银行活期存款利率（税后）} / 365];$$

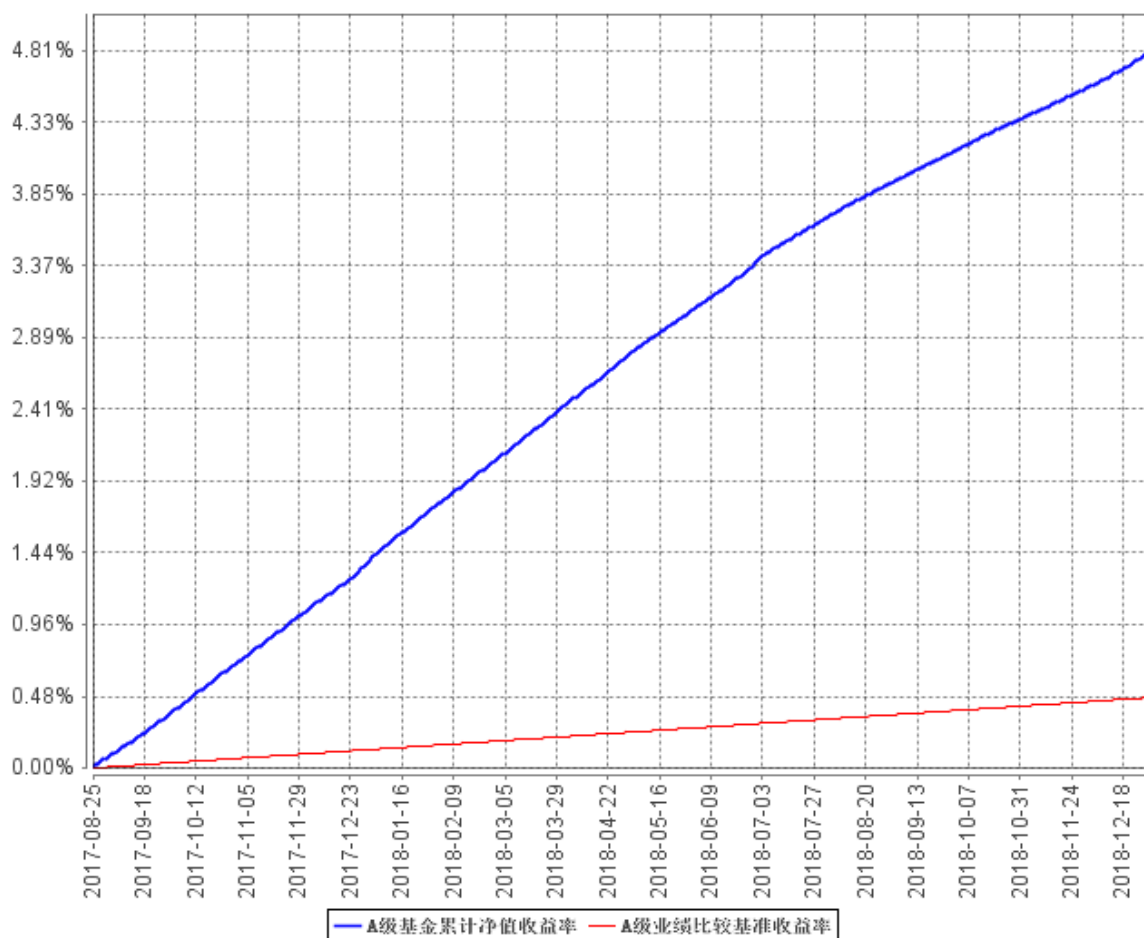
其中，t=1, 2, 3, ... T, T 表示时间截至日；

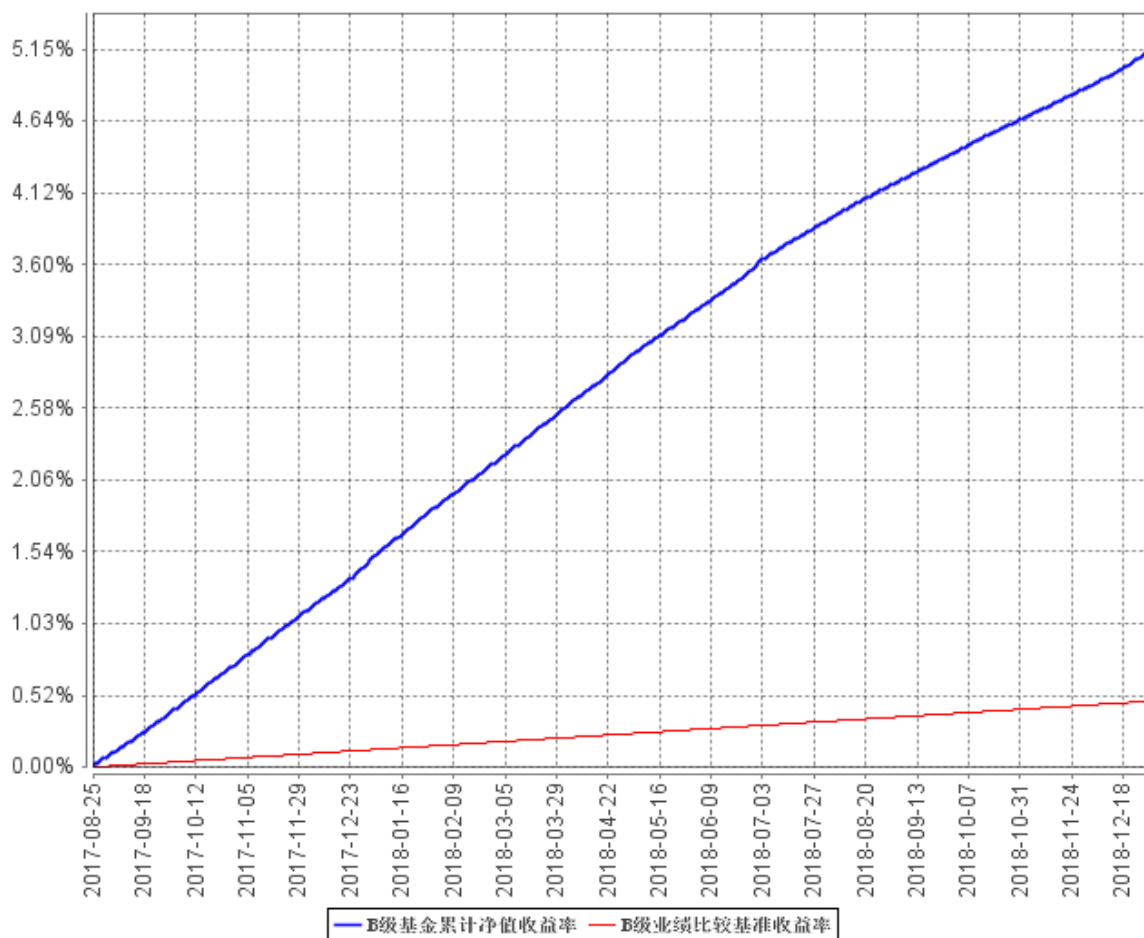
t 日至 T 日的期间收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_{Tt} = [\prod_{t=T}^t (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

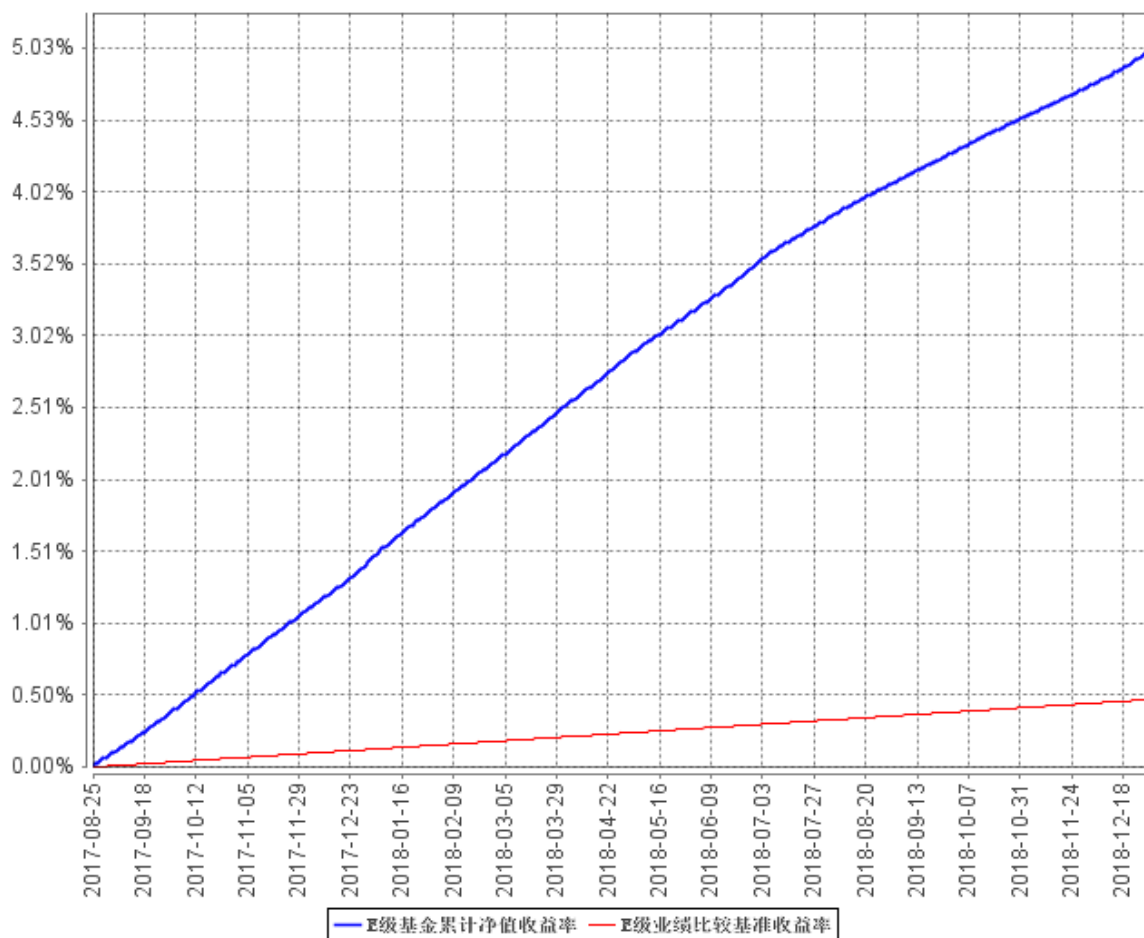
其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=T}^t (1 + \text{benchmark}_t)$  表示 t 日至 T 日的 (1+benchmark<sub>t</sub>) 数学连乘。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较







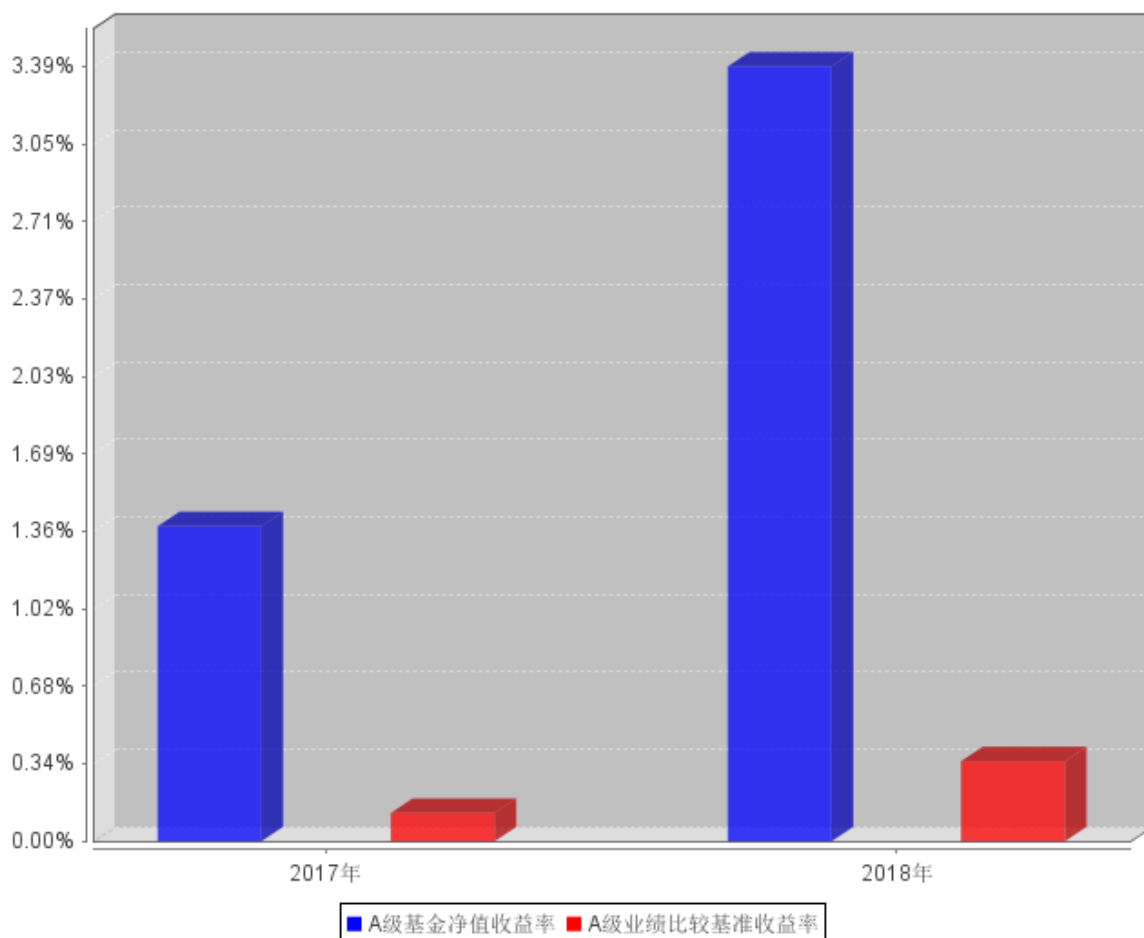


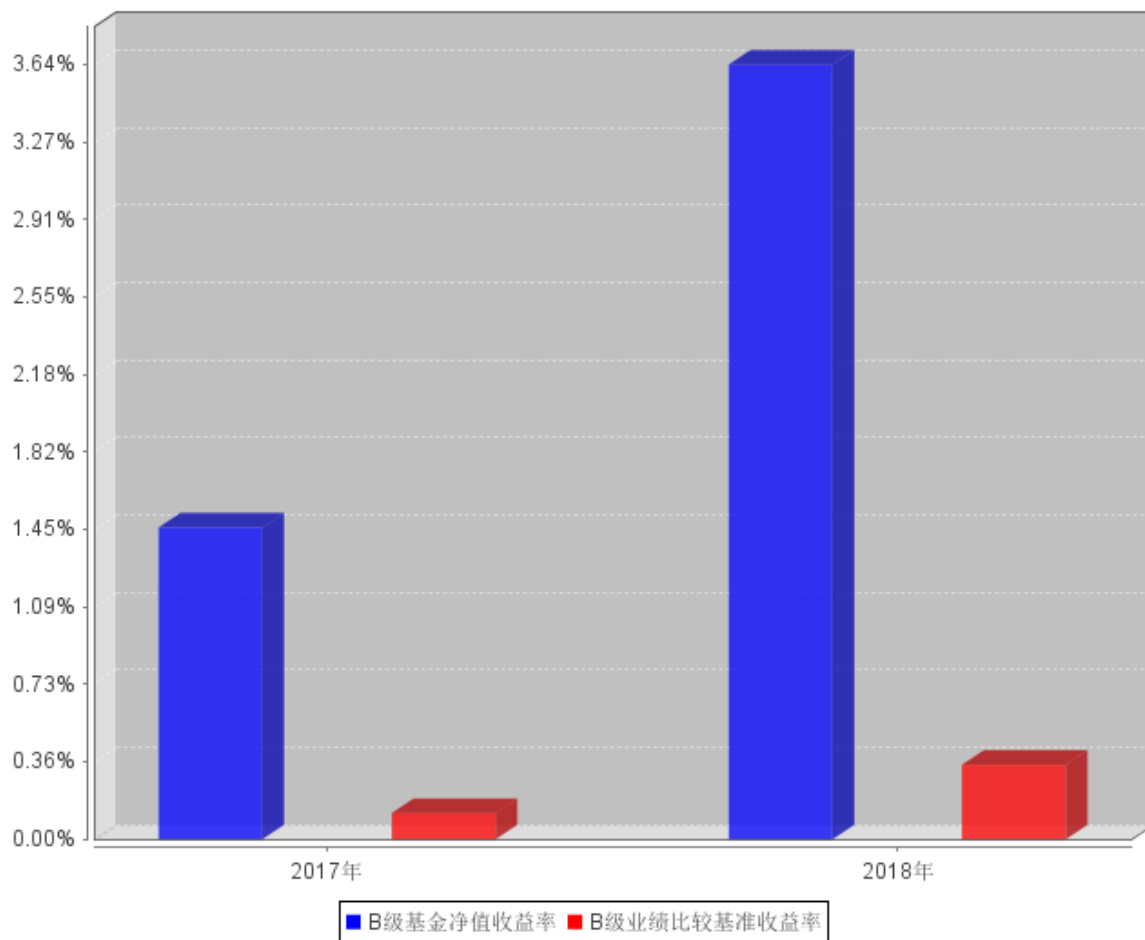
注：1、截止日期为 2018 年 12 月 31 日。

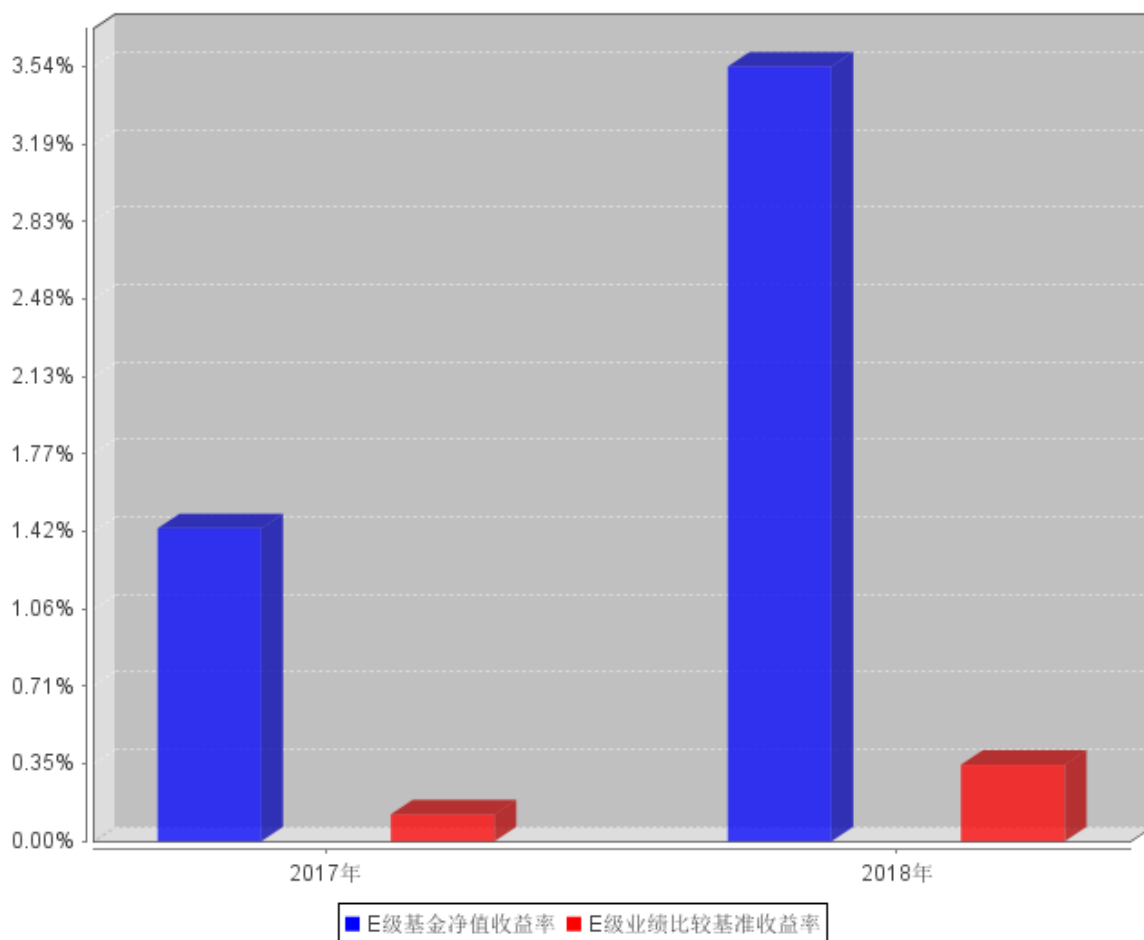
2、本基金合同于 2017 年 8 月 25 日生效。

3、本基金建仓期 6 个月，即从 2017 年 8 月 25 日起至 2018 年 2 月 25 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较







注：本基金合同生效日为 2017 年 8 月 25 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

东方红货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	1,900,437.47	29,402.66	15,826.70	1,945,666.83	
2017	260,027.37	5,595.79	8,228.62	273,851.78	
合计	2,160,464.84	34,998.45	24,055.32	2,219,518.61	

单位：人民币元

东方红货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	52,864,812.83	721,773.46	464,827.62	54,051,413.91	
2017	17,393,513.16	234,743.39	408,434.72	18,036,691.27	
合计	70,258,325.99	956,516.85	873,262.34	72,088,105.18	

单位：人民币元

东方红货币 E					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	2,187,323.79	39,581.24	8,558.12	2,235,463.15	
2017	212,263.80	3,651.37	11,437.68	227,352.85	
合计	2,399,587.59	43,232.61	19,995.80	2,462,816.00	

## § 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

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金三十五只证券投资基金。

#### 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）期限	证券从业年限	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
纪文静	上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理、兼任东方红领先精选混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红战略精选沪港深	2017 年 8 月 25 日	2018 年 11 月 23 日	12 年	硕士，曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理，德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理，上海东方证券资产管理有限公司固定收益部副总监；现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理兼任东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红 6 个月定开纯债、东方红收益增强债券、东方红信用债债券、东方红稳添利纯债、东方红战略精选混合、东方红价值精选混合、东方红益鑫纯债债券、东方红智逸沪港深定开混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

	混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。				
徐觅	东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金	2017 年 9 月 15 日	-	12 年	本科，曾任长信基金管理有限责任公司基金事务部基金会计、交易管理部债券交易员，广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员，富国基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司私募固定收益投资部投资经理。现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部基金经理兼任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红益鑫纯债债券、东方红货币、东方红目标优选定开混合、东方红配置精选混合、东方红核心优选定开混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。



	金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。				
李燕	东方红货币市场基金基金经理。	2017 年 10 月 25 日	-	18 年	硕士，曾任国信证券股份有限公司电子商务部职员，富国基金管理有限公司运营部基金会计、基金会计主管、总监助理、副总监，上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部业务总监，现任东方红货币市场基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
丁锐	东方红货币市场基金基金经理	2018 年 11 月 23 日	-	7 年	硕士，历任交通银行股份有限公司资产管理业务中心投资经理，交银施罗德基金管理有限公司专户投资部投资经理助理，上海东方证券资产管理有限公司私募固定收益投资部投资经理助理；现任东方红货币市场基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，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》、基金合同以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基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统中的公平交易模块进行交易执行和分配，合规与风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析，校验公平交易执行情况。对于同向交易，合规与风险管理部侧重于对公司管理的不同产品（包含了公募产品、私募产品）的整体收益率差异、投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差按两两组合进行显著性检验，并根据显著性检验结果，对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录，通过逐笔检查或抽样分析的方法，分析相应交易行为的公平性。对同一投资人员管理的不同产品，则持续监控和跟踪其同向交易价差，如价差显著不为零，则在逐笔分析相关交易记录的基础上，对投资人员进行访谈，要求其进行相关的解释和说明，以更为审慎地判断其合理性。对于反向交易，除程序化交易外原则上禁止组合内部及组合之间的日内反向交易，如有投资策略或流动性等特殊需要的，需由投资经理提供投资依据，经投资决策委员会审慎审批后留档备查。本年度未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，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，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金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。

## 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

2018 年国内宏观经济在内部紧信用、外部中美贸易摩擦的双重影响下，呈现下行态势，GDP 增速逐季回落，18 年 4 季度单季同比增速回落至 6.4%，全年增速 6.6%，18 年 12 月中采制造业 PMI 跌破荣枯线至 49.4，创 16 年 2 月以来新低；CPI 受食品价格影响小幅回升，PPI 则明显回落，通胀整体仍处于低位。政策方面，受经济下行的影响，货币政策明显放松，稳增长成为政策主要目标，去杠杆转为稳杠杆，央行全年四次降准，流动性趋于宽松。货币市场利率明显下行，DR007、R007 日均加权均价分别为 2.71%、3.02%，较 2017 年下行 11BP、33BP，年末股份制银行 3 个月同业存单发行利率更是较 2017 年末大幅下行近 200BP。

回顾全年操作，本基金在做好流动性管理的前提下，根据对资金面的预判，灵活配置资产，合理安排并适时调整组合剩余期限和杠杆水平，其中一季度、三季度组合整体保持较短的剩余期限和较低的杠杆水平，二季度、四季度则适度拉长组合剩余期限、提高组合杠杆水平，较好地把握了市场时机。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期东方红货币 A 的基金份额净值收益率为 3.3888%，本报告期东方红货币 B 的基金份额净值收益率为 3.6366%，本报告期东方红货币 E 的基金份额净值收益率为 3.5435%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

## 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 2019 年，经济基本面方面，内外需仍面临较大的下行压力，GDP 实际增速预计将继续呈下行态势；通胀方面，2019 年 CPI 中枢预计略微上行，PPI 中枢则将继续回落，整体通胀预计处于低位；海外方面，经济景气度预计将继续下行，美联储加息预期减弱；政策方面，经济下行背景下，“稳增长”仍将为政策首要目标，财政政策将更加积极，货币政策将进一步宽松，并推动宽货币向宽信用传导。资金面预计将保持宽松，货币市场利率将维持低位。

综上，2019 年本基金在操作上仍将以做好流动性管理为目标，充分把握市场波动，择机灵活配置，精选个券，控制风险，保持适度杠杆及中短久期，努力为持有人获取稳健的收益。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额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。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一种投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员由投资、研究、运营、合规、风控等相关业务分管领导组成，运营业务分管领导为估值委员会主任委员，运营部是估值委员会的日常办事机构，运营部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。对于基金特殊估值调整事项，由估值委员会下设的估值业务工作小组提出调整方案并提交估值委员会审议，保证基金估值的公平合理，保持估值政策和程序的一贯性。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金合同约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。

本报告期内应分配收益 58,232,543.89 元, 实际分配收益 57,743,331.45 元, 符合本基金基金合同的相关规定。

#### **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**

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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，本报告期内，本基金托管人在对东方红货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

托管人声明，本报告期内，东方红货币市场基金的管理人——上海东方证券资产管理有限公司在东方红货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对上海东方证券资产管理有限公司编制和披露的东方红货币市场基金 2018 年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师陈熹、叶尔甸签字出具了普华永道中天审字(2019)第 21702 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方红货币市场基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	400,865,049.08	422,832,303.76
结算备付金	1,879,090.91	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,094,290,946.15	249,025,889.21
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,094,290,946.15	249,025,889.21
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	723,611,260.95	268,773,123.17
应收证券清算款	20,086,493.30	-
应收利息	8,096,394.35	4,258,741.31
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,248,829,234.74	944,890,057.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	187,749,158.36	-
应付证券清算款	20,000,000.00	-
应付赎回款	64,443.64	90,281.37
应付管理人报酬	463,522.34	307,849.45
应付托管费	123,605.98	82,093.13
应付销售服务费	31,791.64	17,350.28
应付交易费用	56,936.10	23,327.66
应交税费	12,784.11	-

应付利息	72,034.06	-
应付利润	917,313.46	428,101.02
递延所得税负债	-	-
其他负债	139,313.62	59,000.00
负债合计	209,630,903.31	1,008,002.91
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	2,039,198,331.43	943,882,054.54
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,039,198,331.43	943,882,054.54
负债和所有者权益总计	2,248,829,234.74	944,890,057.45

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,039,198,331.43 份，其中 A 类基金份额总额 56,678,601.59 份，基金份额净值 1.0000 元；B 类基金份额总额 1,937,170,097.50 份，基金份额净值 1.0000 元；E 类基金份额总额 45,349,632.34 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	66,443,885.83	20,723,148.69
1.利息收入	65,801,915.47	20,631,004.30
其中：存款利息收入	22,662,886.38	12,560,816.43
债券利息收入	20,689,113.59	3,884,139.09
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	22,449,915.50	4,186,048.78
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	641,970.36	92,144.39
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	641,970.36	92,144.39
资产支持证券投资	-	-
收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损	-	-



失以“-”号填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)	-	-
<b>减：二、费用</b>	8,211,341.94	2,185,252.79
1. 管理人报酬	5,165,755.51	1,353,022.01
2. 托管费	1,377,534.79	360,805.85
3. 销售服务费	377,685.87	66,899.06
4. 交易费用	-	80.46
5. 利息支出	1,022,593.62	318,422.36
其中：卖出回购金融资产支出	1,022,593.62	318,422.36
6. 税金及附加	4,013.04	-
7. 其他费用	263,759.11	86,023.05
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>	58,232,543.89	18,537,895.90
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>	58,232,543.89	18,537,895.90

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：东方红货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	943,882,054.54	-	943,882,054.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	58,232,543.89	58,232,543.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	1,095,316,276.89	-	1,095,316,276.89
其中：1. 基金申购款	8,186,339,029.32	-	8,186,339,029.32
2. 基金赎回款	-7,091,022,752.43	-	-7,091,022,752.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-58,232,543.89	-58,232,543.89

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	2,039,198,331.43	-	2,039,198,331.43
项目	上年度可比期间 2017年8月25日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,318,025,863.23	-	1,318,025,863.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,537,895.90	18,537,895.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-374,143,808.69	-	-374,143,808.69
其中：1. 基金申购款	1,671,077,395.59	-	1,671,077,395.59
2. 基金赎回款	-2,045,221,204.28	-	-2,045,221,204.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-18,537,895.90	-18,537,895.90
五、期末所有者权益（基金净值）	943,882,054.54	-	943,882,054.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>潘鑫军</u>	<u>任莉</u>	<u>詹朋</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东方红货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]635号《关于准予东方红货币市场基金注册的批复》核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,318,025,863.23元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字[2017]第840号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红货币市场基金基金合同》

于 2017 年 8 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,318,025,863.23 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《东方红货币市场基金基金合同》和《东方红货币市场基金招募说明书》的规定,本基金根据销售方式或基金份额持有人持有本基金的份额数量进行基金份额类别划分。本基金分设 A 类、B 类和 E 类三类基金份额,三类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,三类基金份额单独设置基金代码,并单独公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于流动性高、信用风险低、价格波动小的短期金融工具,包括现金;期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券。法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场工具的,在不改变基金投资目标、投资策略,不改变基金风险收益特征的前提下,在履行适当程序后,本基金可参与其他货币市场工具的投资。具体投资比例限制按照相关法律法规和监管规定执行,但须与基金托管人协商一致后方可纳入基金托管人投资监督范围。本基金的业绩比较基准为:当期银行活期存款利率(税后)。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2018 年度的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《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[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、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。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 8 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
东方证券	3,632,417,000.00	100.00%	1,107,300,000.00	100.00%

##### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 8 月 25 日(基金合同生效 日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,165,755.51	1,353,022.01
其中：支付销售机构的客户维护费	181,077.18	5,100.36

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 8 月 25 日(基金合同生效 日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,377,534.79	360,805.85

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 7.4.8.2.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 E	合计
东证资管	48,840.38	148,453.47	64,628.84	261,922.69
工商银行	-	-	-	-
东方证券	7,973.33	2,640.04	-	10,613.37
合计	56,813.71	151,093.51	64,628.84	272,536.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 E	合计
东证资管	1,726.64	44,156.87	5,330.39	51,213.90
工商银行	-	-	-	-
东方证券	7,134.72	-	-	7,134.72
合计	8,861.36	44,156.87	5,330.39	58,348.62

注：本基金 E 类基金份额的年销售服务费为 0.1%/年。

本基金 A 类基金份额的年销售服务率为 0.25%/年，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。

B 类基金份额的年销售服务率为 0.01%/年，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。

A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.8.4.2 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

东方红货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
东方证券	170,388,465.54	8.7957%	-	-

#### 7.4.8.5 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 名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	865,049.08	37,654.84	832,303.76	47,626.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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 187,749,158.36 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
180201	18 国开 01	2019 年 1 月 2 日	100.12	400,000	40,048,000.00
180207	18 国开 07	2019 年 1 月 2 日	100.24	500,000	50,120,000.00
180404	18 农发 04	2019 年 1 月 2 日	100.26	500,000	50,130,000.00
111815144	18 民生银行 CD144	2019 年 1 月 2 日	99.16	26,000	2,578,160.00
111815144	18 民生银行 CD144	2019 年 1 月 2 日	99.16	162,000	16,063,920.00
111806216	18 交通银行 CD216	2019 年 1 月 2 日	99.28	330,000	32,762,400.00
合计				1,918,000	191,702,480.00

#### 7.4.9.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,094,290,946.15 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 249,025,889.21 元，无第一或第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	固定收益投资	1,094,290,946.15	48.66
	其中: 债券	1,094,290,946.15	48.66
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	723,611,260.95	32.18
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	402,744,139.99	17.91
4	其他各项资产	28,182,887.65	1.25
5	合计	2,248,829,234.74	100.00

注: 本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.02	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	187,749,158.36	9.21
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	40.04	10.19
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	10.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	47.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	6.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	4.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.88	10.19

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	40.04	10.19
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	10.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	47.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	6.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	4.38	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.88	10.19

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限超过 240 天的情况。

#### 8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,097,359.91	6.87
	其中：政策性金融债	140,097,359.91	6.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	170,140,244.83	8.34
6	中期票据	-	-
7	同业存单	784,053,341.41	38.45
8	其他	-	-
9	合计	1,094,290,946.15	53.66
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,097,359.91	6.87
	其中：政策性金融债	140,097,359.91	6.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	170,140,244.83	8.34
6	中期票据	-	-
7	同业存单	784,053,341.41	38.45
8	其他	-	-
9	合计	1,094,290,946.15	53.66
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111809276	18 浦发银行 CD276	800,000	79,442,751.80	3.90
2	180404	18 农发 04	500,000	50,066,776.27	2.46
3	180207	18 国开 07	500,000	50,015,425.55	2.45
4	111804095	18 中国银行 CD095	500,000	49,691,166.66	2.44
5	111818359	18 华夏银行 CD359	500,000	49,647,824.61	2.43
6	111893578	18 杭州银行 CD018	500,000	49,636,371.86	2.43
7	111810616	18 兴业银行 CD616	500,000	49,611,199.70	2.43
8	180201	18 国开 01	400,000	40,015,158.09	1.96
9	111806216	18 交通银行 CD216	400,000	39,696,283.69	1.95
10	111809289	18 浦发银行 CD289	400,000	39,691,120.40	1.95

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0960%
报告期内偏离度的最低值	-0.0153%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0275%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 8.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑买入时的溢价和折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

### 8.9.2 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

2018 年期间，本基金持有的 18 华夏银行 CD359（代码：111818359）发行主体华夏银行股份有限公司的贵阳分行等分支机构被中国银监会派出机构处罚共计 8 次，被处罚款合计 250 万元；其银川分行等分支机构被中国人民银行分支机构处罚共计 3 次，被给予警告并被处没收违法所得和罚款合计 56.82 万元；其聊城分行等分支机构被国家外管局派出机构处罚共计 2 次，被处没收违法所得和罚款合计 84.78 万元。

本基金持有的 18 兴业银行 CD616（代码：111810616）发行主体兴业银行股份有限公司，因存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等十二项违法违规行为，中国银保监会于 2018 年 4 月 19 日对公司作出行政处罚决定（银保监银罚决字〔2018〕1 号），处以 5870 万元罚款。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未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。

### 8.9.3 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	应收证券清算款	20,086,493.30
3	应收利息	8,096,394.35
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	28,182,887.65
---	----	---------------

#### 8.9.4 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，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
东方红货币 A	4,955	11,438.67	26,192,647.82	46.21%	30,485,953.77	53.79%
东方红货币 B	27	71,747,040.65	1,904,019,287.76	98.29%	33,150,809.74	1.71%
东方红货币 E	3,210	14,127.61	0.00	0.00%	45,349,632.34	100.00%
合计	8,192	248,925.58	1,930,211,935.58	94.66%	108,986,395.85	5.34%

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	基金类机构	201,405,275.87	9.88%
2	其他机构	200,196,145.58	9.82%
3	券商类机构	170,388,465.54	8.36%
4	银行类机构	151,375,148.23	7.42%
5	基金类机构	102,214,129.79	5.01%
6	其他机构	101,346,494.99	4.97%
7	基金类机构	101,202,126.01	4.96%
8	券商类机构	100,117,317.14	4.91%
9	其他机构	100,021,065.69	4.90%
10	信托类机构	72,224,906.66	3.54%

### 9.3 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	东方红货币 A	23,186.47	0.0409%
	东方红货币 B	0.00	0.0000%
	东方红货币 E	2,251,195.95	4.9641%
	合计	2,274,382.42	0.1115%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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）。

#### 9.4 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的情况

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	东方红货币 A	0~10
	东方红货币 B	0
	东方红货币 E	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红货币 A	0
	东方红货币 B	0
	东方红货币 E	10~50
	合计	10~50

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 E
基金合同生效日(2017年8月25日)基金份额总额	18,161,374.56	1,293,000,000.00	6,864,488.67
本报告期期初基金份额总额	18,942,137.48	899,338,738.57	25,601,178.49
本报告期期间基金总申购份额	472,612,434.43	7,390,526,932.10	323,199,662.79
减:本报告期期间基金总赎回份额	434,875,970.32	6,352,695,573.17	303,451,208.94
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	56,678,601.59	1,937,170,097.50	45,349,632.34

	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 E
基金合同生效日(2017年8月25日)基金份额总额	18,161,374.56	1,293,000,000.00	6,864,488.67
本报告期期初基金份额总额	18,942,137.48	899,338,738.57	25,601,178.49
本报告期期间基金总申购份额	472,612,434.43	7,390,526,932.10	323,199,662.79
减:本报告期期间基金总赎回份额	434,875,970.32	6,352,695,573.17	303,451,208.94
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	56,678,601.59	1,937,170,097.50	45,349,632.34

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

本基金管理人于 2018 年 3 月 8 日发布公告，陈光明同志辞去公司董事长职务，由潘鑫军同志担任公司董事长；于 2018 年 5 月 11 日发布公告，同意林鹏同志担任公司副总经理；于 2018 年 11 月 14 日发布公告，同意汤琳同志担任公司副总经理。

本基金管理人于 2018 年 7 月 21 日发布公告，唐涵颖同志离任公司督察长职务，由任莉同志代为履行公司督察长职务，于 2018 年 12 月 12 日发布公告，同意李云亮同志担任公司督察长，公司总经理任莉不再代行督察长职务。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无发生基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 3 万元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

本报告期内本基金未有租用证券公司交易单元进行股票投资。

### 11.7.2 基金租用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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	3,632,417,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期没有发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

上海东方证券资产管理有限公司

2019年3月27日