

# 东方红货币市场基金 2019 年半年度报告（摘要）

2019 年 6 月 30 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 8 月 27 日

## § 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。本半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 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## § 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      | 1,406,208,523.06 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 | 48,834,893.55 份    | 1,295,917,787.80 份 | 61,455,841.71 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               |
|         | 联系电话           | 021-63325888      |
|         | 电子邮箱           | service@dfham.com |
| 客户服务电话  | 4009200808     | 95588             |
| 传真      | 021-63326981   | 010-66105798      |

### 2.4 信息披露方式

|                      |  |
|----------------------|--|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.dfham.com                          |
| 基金半年度报告备置地点          | 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(2019年1月1日-2019年6月30日) |                  |               |
|---------------|---------------------------|------------------|---------------|
|               | 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       | 606,760.28                | 23,610,192.08    | 761,373.91    |
| 本期利润          | 606,760.28                | 23,610,192.08    | 761,373.91    |
| 本期净值收益率       | 1.2177%                   | 1.3383%          | 1.2932%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日)          |                  |               |
|               | 东方红货币 A                   | 东方红货币 B          | 东方红货币 E       |
| 期末基金资产净值      | 48,834,893.55             | 1,295,917,787.80 | 61,455,841.71 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                    | 1.0000           | 1.0000        |

注:1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2019 年 6 月 30 日；“本期”指 2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月      | 0.1759%  | 0.0011%     | 0.0288%    | 0.0000%       | 0.1471% | 0.0011% |
| 过去三个月      | 0.5470%  | 0.0009%     | 0.0873%    | 0.0000%       | 0.4597% | 0.0009% |
| 过去六个月      | 1.2177%  | 0.0013%     | 0.1736%    | 0.0000%       | 1.0441% | 0.0013% |
| 过去一年       | 2.6109%  | 0.0014%     | 0.3500%    | 0.0000%       | 2.2609% | 0.0014% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.0900%  | 0.0022%     | 0.6473%    | 0.0000%       | 5.4427% | 0.0022% |

东方红货币 B

| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月          | 0.1957%      | 0.0011%             | 0.0288%        | 0.0000%               | 0.1669% | 0.0011% |
| 过去三个月          | 0.6072%      | 0.0009%             | 0.0873%        | 0.0000%               | 0.5199% | 0.0009% |
| 过去六个月          | 1.3383%      | 0.0013%             | 0.1736%        | 0.0000%               | 1.1647% | 0.0013% |
| 过去一年           | 2.8577%      | 0.0014%             | 0.3500%        | 0.0000%               | 2.5077% | 0.0014% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 6.5608%      | 0.0022%             | 0.6473%        | 0.0000%               | 5.9135% | 0.0022% |

东方红货币 E

| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月          | 0.1883%      | 0.0011%             | 0.0288%        | 0.0000%               | 0.1595% | 0.0011% |
| 过去三个月          | 0.5847%      | 0.0009%             | 0.0873%        | 0.0000%               | 0.4974% | 0.0009% |
| 过去六个月          | 1.2932%      | 0.0013%             | 0.1736%        | 0.0000%               | 1.1196% | 0.0013% |
| 过去一年           | 2.7651%      | 0.0014%             | 0.3500%        | 0.0000%               | 2.4151% | 0.0014% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 6.3845%      | 0.0022%             | 0.6473%        | 0.0000%               | 5.7372% | 0.0022% |

注：1、自基金合同生效日起至今指 2017 年 8 月 25 日-2019 年 6 月 30 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；

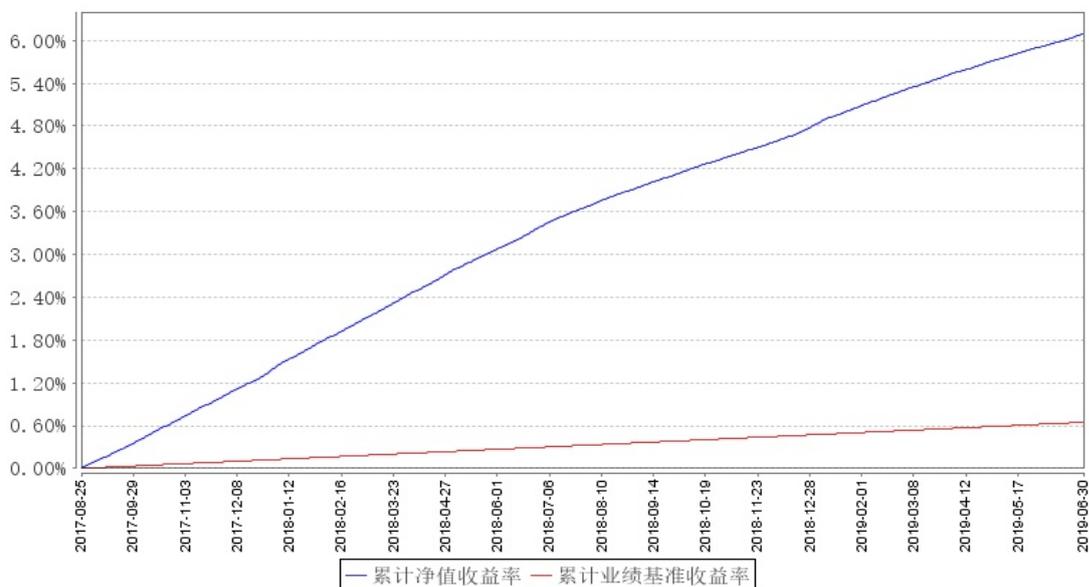
t 日至 T 日的期间收益率（benchmark<sub>Tt</sub>）按下列公式计算：

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

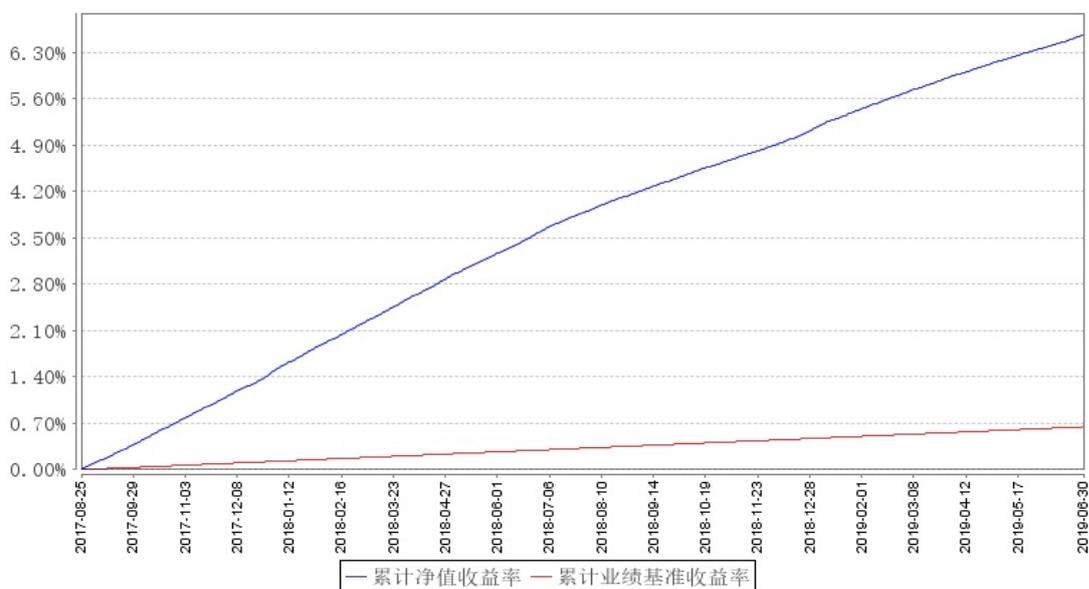
其中，T=2, 3, 4, . . . ;  $\prod_{t=T}^t (1 + \text{benchmark}_t)$  表示 t 日至 T 日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

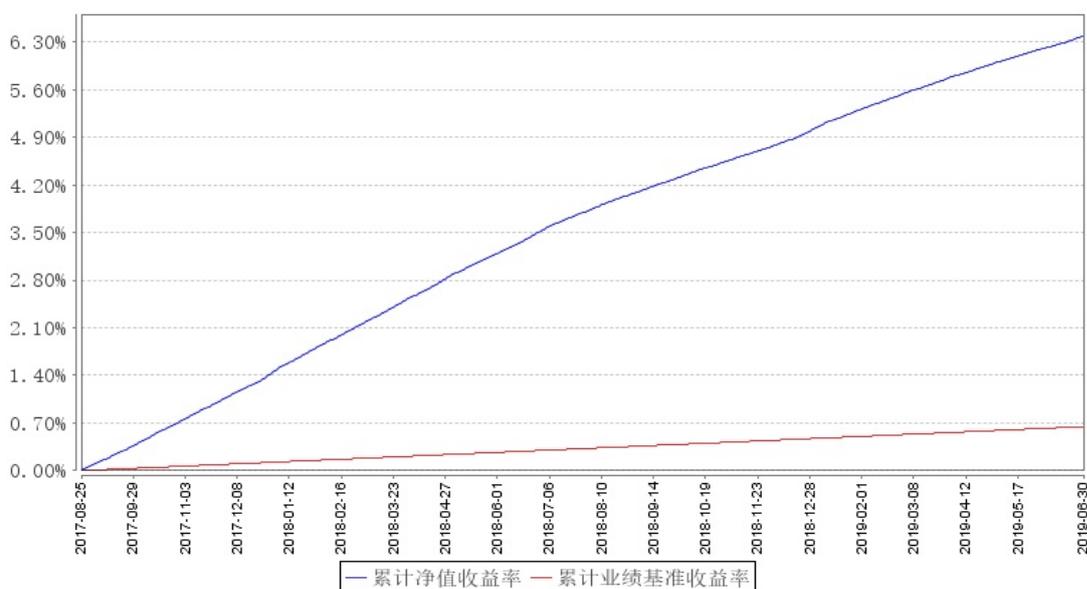
东方红货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红货币E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:截止日期为 2019 年 6 月 30 日。

## § 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 2019 年 6 月 30 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)、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、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 6 个月定期开放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、东方红睿轩三年定期开放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（LOF）、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、东方红恒元五年定期开放灵活配置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）<br>期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|----|---|---------------------|------|--------|---|
|    |   | 任职日期                | 离任日期 |        |   |
| 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、东方红配置精选混合 | 2017年9月15日          | -    | 12     | 硕士，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 |

|    |                                     |                  |   |    |   |
|----|-------------------------------------|------------------|---|----|---|
|    | 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。 |                  |   |    | 国籍。   |
| 李燕 | 东方红货币市场基金经理。                        | 2017 年 10 月 25 日 | - | 18 | 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经理。                        | 2018 年 11 月 23 日 | - | 7  | 硕士，曾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遵规守信情况的说明

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。

#### 4.3.2 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

一季度在社融增速大幅回升，基建企稳，中美贸易争端有所缓和等因素带动下，经济基本面相较于去年四季度边际上有所企稳，3 月份官方制造业 PMI 回升至 50.5，回升幅度明显；然而二季度则受到中美贸易摩擦反复、4 月份货币政策边际收紧等影响，复苏趋势未能延续，经济增长重回跌势，5 月、6 月官方 PMI 均报在 49.4 重回枯荣线以下，生产、订单、价格均有所走弱。通胀整体可控，CPI 温和抬升，PPI 则低位运行；海外主要经济体基本面均呈现下行态势，全球宽松预期强化。货币政策整体保持宽松，并通过定向降准、TMLF 等方式向银行投放低成本资金，流动性保持合理充裕，货币市场利率整体下行，但 5 月底“包商银行事件”打破同业刚兑，引发同业及信用收缩，并导致较为严重流动性分层问题。

操作上，上半年在做好流动性管理的前提下，积极应对市场变化，防控组合风险的同时，充分把握资金面的波动，挖掘市场机会，进行灵活有效配置，增配高流动性资产，适时调整组合久期和杠杆，力争为投资者获取较为稳健的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 类份额净值收益率为 1.2177%，B 类份额净值收益率为 1.3383%，E 类份额净值收益率为 1.2932%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济依然面临较大的下行压力。在三四线城市棚改效应消退、地产新开工增速下行以及因城施策的调控政策下，预计下半年地产销售和投资增速将逐渐下行；需求不振、制造业企业利润难以改善的情况下，制造业投资预计仍将处于低位；贸易战不确定性和外需疲软仍将压制出口表现。通胀方面，预计 CPI 依然温和，PPI 维持低位甚至转负，难以对货币政策形成掣肘。全球新一轮降息周期背景下，面对经济下行压力及外部的不确定性，预计财政及货币政策均将积极应对，货币政策仍将保持宽松，货币市场利率仍将维持低位。不过下半年宏观经济虽面临下行压力，但也不存在失速下行的风险，货币政策在稳增长的基础上依然需要兼顾控杠杆、防风险、调结构，在市场宽松预期较为充分的情况下，杠杆率的提升，将导致货币市场利率的波动可能加大，同时流动性分层问题也可能对货币市场利率带来扰动。因此，下半年在操作上将继续采取灵活配置策略，充分把握市场波动，努力提升组合回报。

#### 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 24,978,326.27 元，实际分配收益 25,602,453.85 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

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

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 托管人对本半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 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：东方红货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |                        |                          |
| 银行存款       | 150,711,633.57         | 400,865,049.08           |
| 结算备付金      | 1,805,765.00           | 1,879,090.91             |
| 存出保证金      | -                      | -                        |
| 交易性金融资产    | 836,719,182.25         | 1,094,290,946.15         |
| 其中：股票投资    | -                      | -                        |
| 基金投资       | -                      | -                        |
| 债券投资       | 836,719,182.25         | 1,094,290,946.15         |
| 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        | 497,393,746.09    | 723,611,260.95     |
| 应收证券清算款         | 5,008,054.79      | 20,086,493.30      |
| 应收利息            | 2,757,783.91      | 8,096,394.35       |
| 应收股利            | -                 | -                  |
| 应收申购款           | 1,077,621.21      | -                  |
| 递延所得税资产         | -                 | -                  |
| 其他资产            | -                 | -                  |
| 资产总计            | 1,495,473,786.82  | 2,248,829,234.74   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>        | <b>上年度末</b>        |
|                 | <b>2019年6月30日</b> | <b>2018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       | 83,279,718.36     | 187,749,158.36     |
| 应付证券清算款         | 5,000,000.00      | 20,000,000.00      |
| 应付赎回款           | 127,440.98        | 64,443.64          |
| 应付管理人报酬         | 309,593.96        | 463,522.34         |
| 应付托管费           | 82,558.41         | 123,605.98         |
| 应付销售服务费         | 24,265.45         | 31,791.64          |
| 应付交易费用          | 43,616.06         | 56,936.10          |
| 应交税费            | 12,025.06         | 12,784.11          |
| 应付利息            | 10,093.76         | 72,034.06          |
| 应付利润            | 293,185.88        | 917,313.46         |
| 递延所得税负债         | -                 | -                  |
| 其他负债            | 82,765.84         | 139,313.62         |
| 负债合计            | 89,265,263.76     | 209,630,903.31     |
| <b>所有者权益:</b>   |                   |                    |
| 实收基金            | 1,406,208,523.06  | 2,039,198,331.43   |
| 未分配利润           | -                 | -                  |
| 所有者权益合计         | 1,406,208,523.06  | 2,039,198,331.43   |
| 负债和所有者权益总计      | 1,495,473,786.82  | 2,248,829,234.74   |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,406,208,523.06 份，其中东方红货币 A 基金份额总额为 48,834,893.55 份，基金份额净值 1；东方红货币 B 基金份额总额为 1,295,917,787.80 份，基金份额净值 1；东方红货币 E 基金份额总额为 61,455,841.71 份，基金份额净值 1。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                        | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
| 一、收入                   | 29,339,016.49                   | 29,509,291.43                   |
| 1. 利息收入                | 29,178,822.99                   | 29,332,306.99                   |
| 其中：存款利息收入              | 5,678,922.30                    | 13,397,802.60                   |
| 债券利息收入                 | 13,936,936.40                   | 6,116,040.62                    |
| 资产支持证券利息收入             | -                               | -                               |
| 买入返售金融资产收入             | 9,562,964.29                    | 9,818,463.77                    |
| 其他利息收入                 | -                               | -                               |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 160,193.50                      | 176,984.44                      |
| 其中：股票投资收益              | -                               | -                               |
| 基金投资收益                 | -                               | -                               |
| 债券投资收益                 | 160,193.50                      | 176,984.44                      |
| 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）     | -                               | -                               |
| 减：二、费用                 | 4,360,690.22                    | 2,951,606.28                    |
| 1. 管理人报酬               | 2,757,320.13                    | 1,912,049.64                    |
| 2. 托管费                 | 735,285.37                      | 509,879.94                      |
| 3. 销售服务费               | 177,966.27                      | 147,719.45                      |
| 4. 交易费用                | -                               | -                               |
| 5. 利息支出                | 548,712.89                      | 253,637.66                      |
| 其中：卖出回购金融资产支出          | 548,712.89                      | 253,637.66                      |
| 6. 税金及附加               | 4,597.59                        | 89.29                           |
| 7. 其他费用                | 136,807.97                      | 128,230.30                      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    | 24,978,326.27                   | 26,557,685.15                   |
| 减：所得税费用                | -                               | -                               |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      | 24,978,326.27                   | 26,557,685.15                   |

### 6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                              |
|----|---------------------------------|
|    | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）                        | 2,039,198,331.43                | -              | 2,039,198,331.43  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 24,978,326.27  | 24,978,326.27     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -632,989,808.37                 | -              | -632,989,808.37   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 3,568,492,751.57                | -              | 3,568,492,751.57  |
| 2. 基金赎回款                               | -4,201,482,559.94               | -              | -4,201,482,559.94 |
| 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） | -                               | -24,978,326.27 | -24,978,326.27    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,406,208,523.06                | -              | 1,406,208,523.06  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30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）               | -                               | 26,557,685.15  | 26,557,685.15     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | 621,156,299.64                  | -              | 621,156,299.64    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 3,607,559,699.21                | -              | 3,607,559,699.21  |
| 2. 基金赎回款                               | -2,986,403,399.57               | -              | -2,986,403,399.57 |
| 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） | -                               | -26,557,685.15 | -26,557,685.15    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,565,038,354.18                | -              | 1,565,038,354.18  |

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：

潘鑫军

任莉

詹朋

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 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)。

#### 6.4.2 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》和其他中国证监会、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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、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、会计估计与最近一期年度报告相一致

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 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 |
| 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           |

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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                           | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                           |
|-------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 东方证券  | 4,344,610,000.00           | 100.00                    | 926,500,000.00                  | 100.00                    |

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,757,320.13                   | 1,912,049.64                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 31,958.16                      | 28,629.64                           |

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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 735,285.37                     | 509,879.94                          |

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。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各<br>关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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         |
| 东方证券               | 2,499.73                                   | -         | -         | 2,499.73   |
| 东证资管               | 27,185.66                                  | 85,753.48 | 29,619.47 | 142,558.61 |
| 合计                 | 29,685.39                                  | 85,753.48 | 29,619.47 | 145,058.34 |
| 获得销售服务费的各<br>关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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               | 12,567.21                                  | 55,930.12 | 32,568.95 | 101,066.28 |
| 东方证券               | 5,715.72                                   | 2,081.72  |           | 7,797.44   |
| 合计                 | 18,282.93                                  | 58,011.84 | 32,568.95 | 108,863.72 |

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。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注:本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.8.4.2 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

份额单位:份

东方红货币 B

| 关联方名称 | 本期末<br>2019年6月30日 |                             | 上年度末<br>2018年12月31日 |                             |
|-------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额       | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例(%) | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例<br>(%) |
| 东方证券  | 100,451,387.10    | 7.7514                      | 170,388,465.54      | 8.7957                      |

### 6.4.8.5 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30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 | 711,633.57                 | 16,269.43 | 1,368,120.43                    | 18,125.65 |

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。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 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 83, 279, 718. 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           |
|-----------|---------------|----------------|--------|----------|------------------|
| 111906172 | 19 交通银行 CD172 | 2019 年 7 月 1 日 | 99. 42 | 680, 000 | 67, 603, 315. 46 |
| 111920073 | 19 广发银行 CD073 | 2019 年 7 月 1 日 | 99. 38 | 190, 000 | 18, 882, 556. 15 |
| 合计        |               |                |        | 870, 000 | 86, 485, 871. 61 |

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止, 本基金无因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。

#### 6.4.10 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 2019 年 6 月 30 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 836,719,182.25 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次 1,094,290,946.15 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 2019 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（2018 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)除公允价值外，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  | 固定收益投资                | 836,719,182.25   | 55.95         |
|    | 其中：债券                 | 836,719,182.25   | 55.95         |
|    | 资产支持证<br>券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产              | 497,393,746.09   | 33.26         |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                | -             |
| 3  | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 152,517,398.57   | 10.20         |
| 4  | 其他各项资产                | 8,843,459.91     | 0.59          |
| 5  | 合计                    | 1,495,473,786.82 | 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。

## 7.2 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 | 2.81          |               |
|    | 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 | 83,279,718.36 | 5.92          |
|    | 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

注：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%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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    | 45 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 54 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 9  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：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。

### 7.3.2 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                 | 50.83              | 6.28               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 20.59              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 24.07              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 5.64               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 4.94               | -                  |

|  |                            |        |      |
|--|----------------------------|--------|------|
|  | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
|  | 合计                         | 106.08 | 6.28 |

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：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。

#### 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                 | 摊余成本           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券                 | 29,905,328.73  | 2.13         |
| 2  | 央行票据                 | -              | -            |
| 3  | 金融债券                 | 50,070,599.29  | 3.56         |
|    | 其中：政策性金融债            | 50,070,599.29  | 3.56         |
| 4  | 企业债券                 | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 140,035,151.60 | 9.96         |
| 6  | 中期票据                 | -              | -            |
| 7  | 同业存单                 | 616,708,102.63 | 43.86        |
| 8  | 其他                   | -              | -            |
| 9  | 合计                   | 836,719,182.25 | 59.50        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -              | -            |

#### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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  | 111906172 | 19 交通银行 CD172 | 700,000 | 69,591,648.27 | 4.95         |
| 2  | 111810505 | 18 兴业银行 CD505 | 500,000 | 49,924,728.54 | 3.55         |
| 3  | 111808295 | 18 中信银行 CD295 | 500,000 | 49,833,032.56 | 3.54         |
| 4  | 111809283 | 18 浦发银行 CD283 | 500,000 | 49,701,691.23 | 3.53         |
| 5  | 111815637 | 18 民生银行 CD637 | 500,000 | 49,689,983.09 | 3.53         |
| 6  | 111811286 | 18 平安银行 CD286 | 500,000 | 49,597,085.92 | 3.53         |
| 7  | 111818340 | 18 华夏银行 CD340 | 500,000 | 49,484,396.78 | 3.52         |
| 8  | 111815574 | 18 民生银行 CD574 | 400,000 | 39,891,822.71 | 2.84         |
| 9  | 180312    | 18 进出 12      | 300,000 | 30,037,221.51 | 2.14         |
| 10 | 011901000 | 19 苏交通 SCP005 | 300,000 | 30,002,904.56 | 2.13         |

#### 7.7 “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 | -        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0917%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0118% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0272%  |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：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

注：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。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.9 投资组合报告附注

##### 7.9.1

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。

##### 7.9.2

本基金持有的 18 平安银行 CD286（代码：111811286YH）发行主体平安银行股份有限公司，因未按照规定履行客户身份识别义务，未按照规定保存客户身份资料和交易记录，未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，中国人民银行于 2018 年 7 月 26 日作出处罚决定对平安银行合计处以 140 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九名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。

##### 7.9.3 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 | 5,008,054.79 |
| 3  | 应收利息    | 2,757,783.91 |
| 4  | 应收申购款   | 1,077,621.21 |
| 5  | 其他应收款   | -            |
| 6  | 待摊费用    | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 8,843,459.91 |

##### 7.9.4 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。

## § 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 (%) |
| 东方红货币 A | 3,788     | 12,892.00     | 23,863,763.99    | 48.87      | 24,971,129.56 | 51.13      |
| 东方红货币 B | 31        | 41,803,799.61 | 1,295,917,787.80 | 100.00     | -             | -          |
| 东方红货币 E | 3,203     | 19,186.96     | -                | -          | 61,455,841.71 | 100.00     |
| 合计      | 7,022     | 200,257.55    | 1,319,781,551.79 | 93.85      | 86,426,971.27 | 6.15       |

### 8.2 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  | 其他机构  | 252,851,959.01 | 17.98      |
| 2  | 其他机构  | 204,975,885.75 | 14.58      |
| 3  | 保险类机构 | 101,253,074.14 | 7.20       |
| 4  | 券商类机构 | 100,451,387.10 | 7.14       |
| 5  | 券商类机构 | 100,000,000.00 | 7.11       |
| 6  | 信托类机构 | 51,301,091.20  | 3.65       |
| 7  | 券商类机构 | 50,341,813.37  | 3.58       |
| 8  | 券商类机构 | 50,159,028.47  | 3.57       |
| 9  | 银行类机构 | 50,029,283.26  | 3.56       |
| 10 | 券商类机构 | 50,025,920.67  | 3.56       |

### 8.3 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 | 24,494.33    | 0.0502       |
|                  | 东方红货币 B | -            | -            |
|                  | 东方红货币 E | 7,152,620.32 | 11.6386      |
|                  | 合计      | 7,177,114.65 | 0.5104       |

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）。

#### 8.4 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 | -                 |
|                                | 东方红货币 E | 0~10              |
|                                | 合计      | 0~10              |
| 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 | -                 |
|                                | 东方红货币 E | 10~50             |
|                                | 合计      | 10~50             |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 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                   | 56,678,601.59  | 1,937,170,097.50 | 45,349,632.34  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 102,450,838.40 | 3,342,921,505.30 | 123,120,407.87 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 110,294,546.44 | 3,984,173,815.00 | 107,014,198.50 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -              | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 48,834,893.55  | 1,295,917,787.80 | 61,455,841.71  |

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 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。

#### 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

本报告期内，卢强同志自 2019 年 5 月 21 日起辞去基金管理人副总经理职务；李云亮同志自 2019 年 5 月 29 日起兼任公司首席信息官职务。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

#### 10.5 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。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本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。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 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

注: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。

##### 10.7.2 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 |
| 国泰君安       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国盛证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中信建投<br>证券 | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国信证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 瑞银证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中信证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东吴证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 信达证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东兴证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东方证券       | -    | -            | 4,344,610,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 安信证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 西部证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 长江证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 申万宏源       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 平安证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国金证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 民生证券       | -    | -            | -                | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |

注： 1、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

2、报告期内本公司已取得上海证券交易所租用其他券商交易单元的资格并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜，后续将陆续切换租用的其他券商交易单元；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

3、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。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。

4、本期内本基金租用的券商交易单元变更情况：新增中金公司交易单元 2 个、方正证券交易单元 1 个、华创证券交易单元 1 个、广发证券交易单元 1 个、宏信证券交易单元 1 个、海通证券交易单元 1 个、光大证券交易单元 1 个、东北证券交易单元 1 个、中泰证券交易单元 1 个、民生证券交易单元 1 个、国金证券交易单元 1 个、平安证券交易单元 1 个、申万宏源交易单元 1 个、长江证券交易单元 1 个、西部证券交易单元 1 个、安信证券交易单元 1 个、东方证券交易单元 1 个、东兴证券交易单元 1 个、信达证券交易单元 1 个、东吴证券交易单元 1 个、中信证券交易单元 1 个、瑞银证券交易单元 1 个、国信证券交易单元 1 个、中信建投证券交易单元 2 个、国盛证券交易单元 1 个、国泰君安交易单元 1 个。

**10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况**

注：本基金本报告期没有发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## § 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

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |   |                |                |                | 报告期末持有基金情况     |          |
|---|----------------|---|----------------|----------------|----------------|----------------|----------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间                     | 期初份额           | 申购份额           | 赎回份额           | 持有份额           | 份额占比 (%) |
| 机构  | 1              | 20190319-20190415<br>;<br>20190422-20190426 | 101,346,494.99 | 403,629,390.76 | 300,000,000.00 | 204,975,885.75 | 14.58    |
|   | 2              | 20190529-20190626                           | 200,196,145.58 | 202,655,813.43 | 150,000,000.00 | 252,851,959.01 | 17.98    |
| 个人  | -              | -   | -              | -              | -              | -              | -        |
| 产品特有风险  |                |   |                |                |                |                |          |
| 本基金由于存在单一投资者份额集中度较高的情况，可能存在巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力；基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金份额集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。 |                |   |                |                |                |                |          |

注:上表列示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，分级基金按总份额占比计算。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

上海东方证券资产管理有限公司

2019 年 8 月 27 日