

东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 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。本年度报告由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 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 2020 年 07 月 24 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日。

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	5
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	39

8.1 期末基金资产组合情况	39
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
8.3 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	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	40
8.7 期末按摊余成本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	41
8.8 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	41
8.9 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	41
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
8.11 投资组合报告附注	41
§ 9 基金份额持有人信息	42
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
9.3 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	42
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	42
§ 10 开放式基金份额变动	42
§ 11 重大事件揭示	43
11.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
11.4 基金投资策略的改变	43
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
11.8 其他重大事件	44
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	46
12.1 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	46
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 13 备查文件目录	46
13.1 备查文件目录	46
13.2 存放地点	46
13.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	东方红鑫泰 66 个月定开债券
基金主代码	009834
基金运作方式	契约型，定期开放式，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式
基金合同生效日	2020 年 7 月 24 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	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,980,050,029.92 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全的基础上谨慎投资，采用买入并持有到期投资策略，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。
投资策略	1、封闭期内，本基金采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期。投资的资产到期日（或回售日）不得晚于该封闭期到期日。本基金在投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间不晚于该封闭期到期日；债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。在封闭期内，如本基金持有的金融品种的信用风险显著增加时，为减少信用损失，基金管理人可以基于基金份额持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的金融品种进行处置。 2、开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款利率（税后）+1.25%
风险收益特征	本基金是一只债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

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		上海东方证券资产管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李云亮	胡波
	联系电话	021-53952828	021-61618888
	电子邮箱	service@dfham.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4009200808	95528
传真		021-63326381	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	上海市中山东一路 12 号

办公地址	上海市黄浦区外马路 108 号 7 层 -11 层	上海市北京东路 689 号
邮政编码	200010	200001
法定代表人	宋雪枫	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号 7 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 普华永道中心 11 楼
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、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

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 7 月 24 日 (基金合同生效日) -2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	116,913,809.20
本期利润	116,913,809.20
加权平均基金份额本期利润	0.0147
本期加权平均净值利润率	1.46%
本期基金份额净值增长率	1.47%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	22,749,219.01
期末可供分配基金份额利润	0.0029
期末基金资产净值	8,002,799,248.93
期末基金份额净值	1.0029
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	1.47%

注：1、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金合同于 2020 年 7 月 24 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

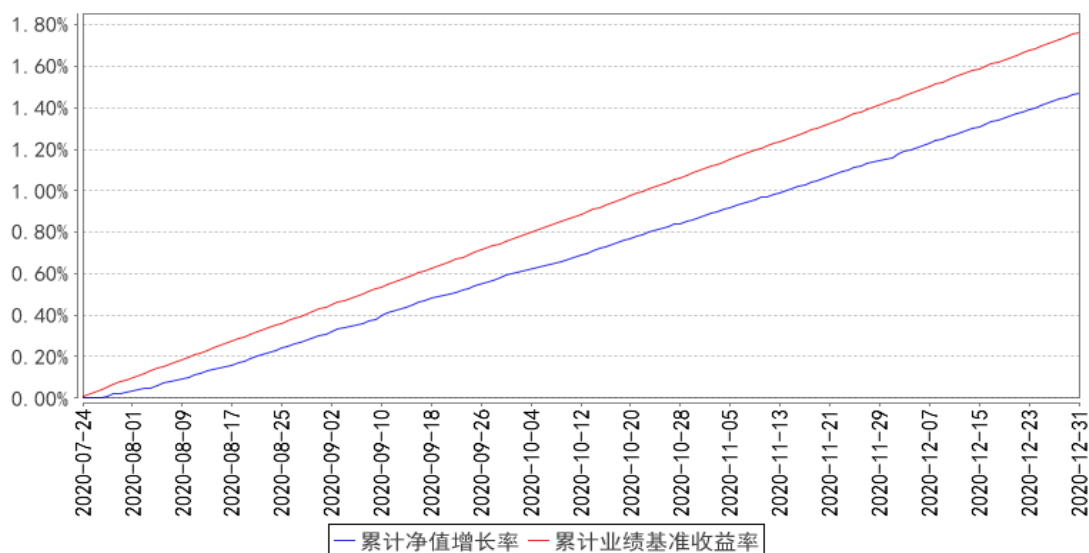
3.2 基金净值表现

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

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	0.88%	0.01%	1.01%	0.01%	-0.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.47%	0.01%	1.76%	0.01%	-0.29%	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

东方红鑫泰66个月定开债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

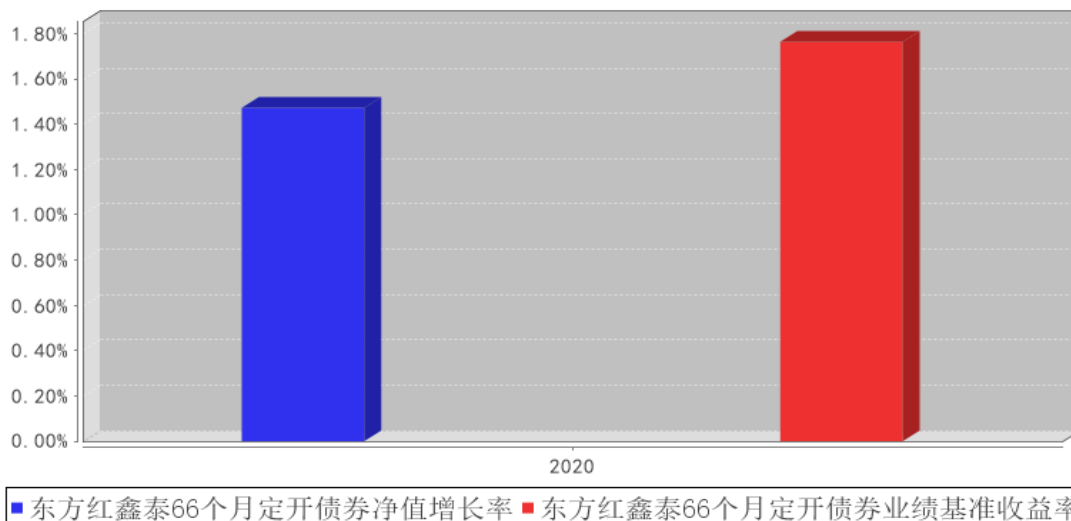


注：1、本基金合同于 2020 年 7 月 24 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2020 年 7 月 24 日起至 2021 年 1 月 23 日，至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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

东方红鑫泰66个月定开债券基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日期为 2020 年 7 月 24 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

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	0.1180	94,164,553.38	36.84	94,164,590.22	-
合计	0.1180	94,164,553.38	36.84	94,164,590.22	-

§ 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 2020 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（LOF）、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 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、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、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金共计 57 只公开募集证券投资基金。

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		
丁锐	本基金基金经理	2020 年 7 月 24 日	-	8 年	2018 年 11 月至今任东方红货币市场基金基金经理、2020 年 07 月至今任东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、2020 年 08 月至今任东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 09 月至今任东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。牛津大学理学硕士。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。具备证券投资基金从业资格。

注：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。

4.1.3 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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理本报告期末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

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。对于反向交易，原则上禁止组合间的日内反向交易，完全按照有关指数构成比例进行投资的投资组合除外。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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共 1 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

资金方面，2020 年下半年货币政策较上半年的超常规操作边际有所收紧，整体仍处于宽松的状态，特别是 11 月永煤事件爆发后，银行间资金面尤为宽松。债券方面，收益率三季度上行，四季度下行，下半年处于震荡行情中。组合在货币资金宽松的条件下，通过杠杆增厚整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.0029 元，份额累计净值为 1.0147 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.47%，业绩比较基准收益率为 1.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，从宏观环境来看，尽管新冠疫情仍然存在不确定性，但在消费修复、投资持续改善和出口复苏的驱动下，预计未来一段时间宏观经济大概率仍能维持复苏态势。从流动性来看，随着经济的复苏，货币政策也将以稳货币、稳信用为主，流动性政策边际收紧，从一月份的资金面可见。基本面向好和流动性政策边际收紧，给利率债带来压力。预计 21 年杠杆带来的收益有限，组合以防守为主，融资操作上需要更加谨慎，兼顾资金成本和流动性安全。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司日常监察稽核工作主要由合规与风险管理部承担，2020 年开展了如下主要工作：

(1) 切实履行了日常合规管理职责。

①顺利完成了日常的合规审查、合规宣导、合规培训、合规报告、合规咨询等工作。②持续加强员工执业行为管理，督促和指导员工及时完成投资申报工作、加强即时通讯工具管控等。③提升反洗钱工作的有效性，持续推动反洗钱系统的改造升级。④稳步跟进各类法律事务。⑤深入开展合规专题研究。

(2) 切实履行了日常风险管理职责。

①加强事前、事中、事后的风险管理，对公司旗下产品、业务及相关制度等进行事前审核，对新股网下申购审核、流通受限证券投资等事项进行事中审核，事后完成静态风险监控，按需做出相关风险提示。②持续加强风控系统化水平，在新规发布后和产品成立前及时做好风控系统相关指标设置，推进投资交易流程系统化工作等。③顺利完成各类风控报告及风控数据报送。④深入梳理内部风控规则及操作流程。⑤持续提升风险管理水平。

4.7 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，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进

行估值测算或者调整的投资品种，并提交估值委员会审议。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，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，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、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。

报告期内，本基金实施利润分配 1 次，利润分配合计为 94,164,590.22 元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.9 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次

利润分配，分配金额分别为 94,164,590.22 元。

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

本报告期内，由上海东方证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 24114 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“东方红鑫泰 66 个月定开债券基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年 7 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 7 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方红鑫泰 66 个月定开债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	东方红鑫泰 66 个月定开债券基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有

	<p>关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估东方红鑫泰 66 个月定开债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算东方红鑫泰 66 个月定开债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督东方红鑫泰 66 个月定开债券基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东方红鑫泰 66 个月定开债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方红鑫泰 66 个月定开债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>陈熹 叶尔甸</p>

会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 03 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	863,291.89
结算备付金		30,761,609.20
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	-
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	246,505,317.38
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	11,737,645,804.67
资产总计		12,015,776,023.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		4,008,946,673.60
应付证券清算款		443,168.90
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,019,386.68
应付托管费		339,795.54
应付销售服务费		-

应付交易费用	7.4.7.7	110,978.28
应交税费		-
应付利息		1,935,771.21
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	181,000.00
负债合计		4,012,976,774.21
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	7,980,050,029.92
未分配利润	7.4.7.10	22,749,219.01
所有者权益合计		8,002,799,248.93
负债和所有者权益总计		12,015,776,023.14

注：1. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 07 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间，无上年度末可比数据。

2. 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0029 元，基金份额总额 7,980,050,029.92 份。

3. 资产负债表中其他资产为分类为持有至到期投资的债券投资。

7.2 利润表

会计主体：东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 7 月 24 日（基金合同 生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		159,066,092.27
1. 利息收入		159,066,092.27
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,074,199.26
债券利息收入		154,121,950.91
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,869,942.10
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-

股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
减：二、费用		42,152,283.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,959,788.20
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,753,800.74
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	-
5. 利息支出		34,245,173.15
其中：卖出回购金融资产支出		34,245,173.15
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	193,520.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		116,913,809.20
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		116,913,809.20

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 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）	7,980,049,993.11	-	7,980,049,993.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	116,913,809.20	116,913,809.20
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）	36.81	0.03	36.84
其中：1. 基金申购款	36.81	0.03	36.84
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-94,164,590.22	-94,164,590.22

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	7,980,050,029.92	22,749,219.01	8,002,799,248.93

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：

任莉

汤琳

陈培

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

东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金(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[2020]1136 号《关于准予东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，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《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，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 7,980,049,991.11 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(2020)第 0639 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,980,049,993.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 2.00 份基金份额；本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为基金合同生效日所对应的第 66 个月月度对日前的倒数第一日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日，结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第 66 个月月度对应日前的倒数第一日，依次类推。本基金自封闭期结束之日或暂停运作后恢复运作的下一个工作日（即每个开放期首日为每个封闭期起始之日的第 66 个月月度对日，包括该日）起进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市的国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、可分离交易可转债的纯债部

分、中央银行票据、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不可以买入股票,也不参与新股申购和新股增发,可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%;但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每个开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内,基金投资不受上述比例限制。在开放期内,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款利率(税后)+1.25%。

本财务报表由本基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司于 2021 年 3 月 26 日批准报出。

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<年度报告和中期报告>》、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》、《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》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 2020 年 7 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 7 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 7 月 24 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无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及可供出售金融资产。

本基金采用买入持有至到期投资策略投资的债券投资和资产支持证券投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。应收款项、持有至到期投资和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

对于应收款项、持有至到期投资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。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

对于单项金额重大的应收款项，单独进行减值测试。当存在客观证据表明本基金将无法按应收款项的原有条款收回款项时，根据其预计未来现金流量现值低于其账面价值的差额，计提坏账准备。

对于单项金额非重大的应收款项，与经单独测试后未减值的应收款项一起按信用风险特征划分为若干组合，根据以前年度与之具有类似信用风险特征的应收账款组合的实际损失率为基础，结合现时情况确定应计提的坏账准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和

资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

于持有至到期投资处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。发生减值的客观证据包括评估日该金融工具可观察的市场价值出现严重下跌，发行方发生严重财

务困难使该金融资产无法在活跃市场继续交易、无法履行合同条款(例如,无法按期偿付利息或本金)等。在进行判断的过程中,本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	863,291.89
定期存款	-
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	-
合计	863,291.89

7.4.7.2 交易性金融资产

注：本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	121.30
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	13,842.70
应收债券利息	246,491,353.38
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-

其他	-
合计	246,505,317.38

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
其他应收款	-
待摊费用	-
持有至到期投资	11,737,645,804.67
合计	11,737,645,804.67

注：1. 于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持有至到期投资为债券投资，其中交易所市场债券 1,299,427,036.14 元，银行间市场债券 10,438,218,768.53 元。

2. 上述持有至到期投资均未计提减值准备。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	110,978.28
合计	110,978.28

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	-
预提费用	181,000.00
合计	181,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,980,049,993.11	7,980,049,993.11
本期申购	36.81	36.81
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	7,980,050,029.92	7,980,050,029.92
-----	------------------	------------------

注：1. 本基金自 2020 年 7 月 20 日至 2020 年 7 月 22 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 7,980,049,991.11 元，折合为 7,980,049,991.11 份基金份额。根据《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 2.00 元在本基金成立后，折合为 2.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金为定期开放基金，每 66 个月开放一次，每次开放期不少于 5 个工作日并且最长不超过 20 个工作日。投资人在开放日办理基金份额的申购与赎回，封闭期内不办理申购与赎回业务。

3. 申购含红利再投份额、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	116,913,809.20	-	116,913,809.20
本期基金份额交易产生的变动数	0.03	-	0.03
其中：基金申购款	0.03	-	0.03
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-94,164,590.22	-	-94,164,590.22
本期末	22,749,219.01	-	22,749,219.01

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	787,150.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	287,049.09
其他	-
合计	1,074,199.26

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动损益。

7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期内无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	121,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	7,720.98
账户维护费	4,600.00
其他	200.00
合计	193,520.98

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2021 年 3 月 19 日宣告 2021 年度第一次分红，向截至 2021 年 3 月 23

日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.10 元。

7.4.9 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
东方证券	599,450,169.80	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东方证券	53,967,758,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,959,788.20
其中：支付销售机构的客户维护费	113,063.41

注：支付基金管理人东证资管的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,753,800.74

注：支付基金托管人上海浦东发展银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

注：本基金本报告期内未有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。

7.4.10.4.2 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

注：本基金本报告期内未有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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本报告期内未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 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 (%)
浦发银行	2,999,999,000.00	37.5937

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.6 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

关联方名称	本期 2020 年 7 月 24 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行	863,291.89	787,150.17

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份 额分红 数	现金形式 发放总额	再投资 形式 发放总 额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					

1	2020 年 12 月 11 日	-	2020 年 12 月 11 日	0.1180	94,164,553.38	36.84	94,164,590.22	-
合计	-	-	-	0.1180	94,164,553.38	36.84	94,164,590.22	-

7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 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 2,991,646,673.60 元，是以如下债券作为抵押：

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
160405	16 农发 05	2021 年 1 月 4 日	99.90	11,587,000	1,157,538,264.34
180214	18 国开 14	2021 年 1 月 4 日	103.49	4,000,000	413,947,814.31
160405	16 农发 05	2021 年 1 月 5 日	99.90	6,380,000	637,360,328.51
150314	15 进出 14	2021 年 1 月 6 日	101.89	2,000,000	203,783,105.30
160405	16 农发 05	2021 年 1 月 7 日	99.90	5,270,000	526,471,619.32
160405	16 农发 05	2021 年 1 月 8 日	99.90	2,085,000	208,290,953.75
合计				31,322,000	3,147,392,085.53

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,017,300,000.00 元，截至 2021 年 1 月 15 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案等。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人上海浦东发展银行，因而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以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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 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 2020 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	11,737,645,804.67
合计	11,737,645,804.67

注：未评级债券为政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来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。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内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。

7.4.13.3.1 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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	863,291.89	-	-	-	-	-	863,291.89
结算备付金	30,761,609.20	-	-	-	-	-	30,761,609.20
应收利息	-	-	-	-	-	246,505,317.38	246,505,317.38
其他资产	-	-	-	5,963,440,947.61	5,774,204,857.06	-	11,737,645,804.67
资产总计	31,624,901.09	-	-	5,963,440,947.61	5,774,204,857.06	246,505,317.38	12,015,776,023.14
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,019,386.68	1,019,386.68
应付托管费	-	-	-	-	-	-339,795.54	339,795.54
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-443,168.90	443,168.90
卖出回购金融资产款	4,008,946,673.60	-	-	-	-	-	4,008,946,673.60
应付交易费用	-	-	-	-	-	-110,978.28	110,978.28
应付利息	-	-	-	-	-	1,935,771.21	1,935,771.21
其他负债	-	-	-	-	-	-181,000.00	181,000.00
负债总计	4,008,946,673.60	-	-	-	-	4,030,100.61	4,012,976,774.21
利率敏感度缺口	-3,977,321,772.51	-	-	5,963,440,947.61	5,774,204,857.06	242,475,216.77	8,002,799,248.93

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过

过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末未持有交易性权益类金融工具，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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。

(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、持有至到期投资和其他金融负债等。

除持有至到期投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持有至到期投资的账面价值为 11,737,645,804.67 元，

公允价值为 11,781,745,596.00 元。

持有至到期投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于2020年12月31日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次。

(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。

§ 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,737,645,804.67	97.69
	其中：债券	11,737,645,804.67	97.69
	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	31,624,901.09	0.26

8	其他各项资产	246,505,317.38	2.05
9	合计	12,015,776,023.14	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金不参与股票投资。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金不参与股票投资。

8.3 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

注：本基金不参与股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金不参与股票投资。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金不参与股票投资。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金不参与股票投资。

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	11,737,645,804.67	146.67
	其中：政策性金融债	11,737,645,804.67	146.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,737,645,804.67	146.67

8.6 期末按摊余成本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）	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	160405	16 农发 05	57,800,000	5,774,204,857.06	72.15
2	180214	18 国开 14	14,100,000	1,459,166,045.43	18.23

3	180411	18 农发 11	11,900,000	1,221,225,854.61	15.26
4	150314	15 进出 14	8,500,000	866,078,197.51	10.82
5	108610	国开 2008	7,000,000	700,000,000.00	8.75

8.7 期末按摊余成本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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：根据本基金基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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

本基金投资的前十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。

8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	246,505,317.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	246,505,317.38
---	----	----------------

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

8.11.6 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，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

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 (%)
227	35,154,405.42	7,979,989,000.00	100.00	61,029.92	0.00

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	15,836.10	0.00

9.3 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 7 月 24 日) 基金份额总额	7,980,049,993.11
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	36.81

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	7,980,050,029.92

注：本基金合同生效日为 2020 年 7 月 24 日。

§ 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

林鹏同志于 2020 年 5 月 15 日起不再担任本基金管理人的副总经理职务；任莉同志自 2020 年 10 月 26 日起代行本基金管理人的董事长职务；刘峰同志自 2020 年 11 月 20 日起担任本基金管理人的副总经理职务；宋雪枫同志自 2020 年 12 月 30 日起担任本基金管理人的董事长职务，同时任莉同志不再担任代行董事长职务。

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

报告期内无涉及基金管理人、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 12.1 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
东方证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、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。

3、本基金合同生效日为 2020 年 7 月 24 日，上述交易单元均为本报告期新增。

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	599,450,169.80	100.00%	53,967,758,000.00	100.00%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 05 月 16 日
2	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 07 月 17 日

3	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 07 月 17 日
4	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 07 月 17 日
5	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 07 月 17 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为代理销售机构的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 07 月 20 日
7	关于东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金提前结束募集的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 07 月 23 日
8	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 07 月 25 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于提醒直销平台投资者及时完善、更新身份资料信息的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 08 月 12 日
10	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金调低管理费率并修订基金合同的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 08 月 25 日
11	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 08 月 25 日
12	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 08 月 27 日
13	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2020 年第 1 号）	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 08 月 27 日
14	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 10 月 27 日
15	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 10 月 28 日
16	上海东方证券资产管理有限公司关于新增基金高级管理人员的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 11 月 21 日
17	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在直销平台开展费率优惠活动的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 11 月 27 日
18	东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 12 月 09 日
19	关于上海东方证券资产管理有限公司直销中心办公地址变更的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 12 月 24 日
20	上海东方证券资产管理有限公司关于董事与高级管理人员变更的公告	证券时报、公司官网、基金电子披露网站	2020 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20200724-20201231	-	2,999,999,000.00	-	2,999,999,000.00	37.59
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：

www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 3 月 31 日