

# 东方红货币市场基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2023 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本基金于 2019 年 9 月 5 日新增 C 类份额，本报告中本基金 C 类份额的“基金合同生效日”特指 2019 年 9 月 5 日；本基金于 2020 年 4 月 27 日新增 D 类份额，本报告中本基金 D 类份额的“基金合同生效日”特指 2020 年 4 月 27 日。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	20
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	23
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 债券回购融资情况.....	50
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	51
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.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	52

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	52
7.8 期末按实际利率计算的账面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.....	53
7.9 投资组合报告附注.....	53
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	60
10.9 其他重大事件.....	60
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</b>
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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红货币市场基金				
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	16,235,675,129.75 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 C	东方红货币 D	东方红货币 E
下属分级基金的交易代码	005056	005057	007864	007865	005058
报告期末下属分级基金的份额总额	75,061,802.32 份	9,976,139,227.64 份	4,779,383,016.35 份	1,391,384,512.03 份	13,706,571.41 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	周陶	郭明
	联系电话	021-53950806	010-66105799
	电子邮箱	service@dfham.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009200808	95588
传真		021-63326381	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		杨斌	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A、B、E 类份额：中国证券登记结算有限责任公司 C、D 类份额：上海东方证券资产管理有限公司	A、B、E 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号 C、D 类份额：上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

## § 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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)				
	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 C	东方红货币 D	东方红货币 E

指标					
本期已实现收益	586,331.33	144,130,385.82	59,911,924.03	9,813,417.92	136,838.42
本期利润	586,331.33	144,130,385.82	59,911,924.03	9,813,417.92	136,838.42
本期净值收益率	0.9628%	1.0830%	0.9627%	1.0380%	1.0374%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)				
期末基金资产净值	75,061,802.32	9,976,139,227.64	4,779,383,016.35	1,391,384,512.03	13,706,571.41
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)				
累计净值收益率	14.8655%	16.4885%	7.8690%	6.8608%	15.8741%

注：1、本基金不同类别份额适用不同的销售服务费率。

2、本基金收益分配从为按日结转份额。

3、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	份额净值收益率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	0.1601%	0.0008%	0.0288%	0.0000%	0.1313%	0.0008%
过去三个月	0.4796%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.3923%	0.0005%
过去六个月	0.9628%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	0.7892%	0.0005%
过去一年	1.7543%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.4043%	0.0009%
过去三年	6.0588%	0.0009%	1.0500%	0.0000%	5.0088%	0.0009%
自基金合同生效起至今	14.8655%	0.0022%	2.0482%	0.0000%	12.8173%	0.0022%

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
过去一个月	0.1798%	0.0008%	0.0288%	0.0000%	0.1510%	0.0008%
过去三个月	0.5396%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.4523%	0.0005%
过去六个月	1.0830%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	0.9094%	0.0005%
过去一年	1.9985%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.6485%	0.0009%
过去三年	6.8248%	0.0009%	1.0500%	0.0000%	5.7748%	0.0009%
自基金合同生效起至今	16.4885%	0.0022%	2.0482%	0.0000%	14.4403%	0.0022%

东方红货币 C



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	0.1598%	0.0008%	0.0288%	0.0000%	0.1310%	0.0008%
过去三个月	0.4794%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.3921%	0.0005%
过去六个月	0.9627%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	0.7891%	0.0005%
过去一年	1.7538%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.4038%	0.0009%
过去三年	6.0589%	0.0009%	1.0500%	0.0000%	5.0089%	0.0009%
自基金合同生效起至今	7.8690%	0.0010%	1.3377%	0.0000%	6.5313%	0.0010%

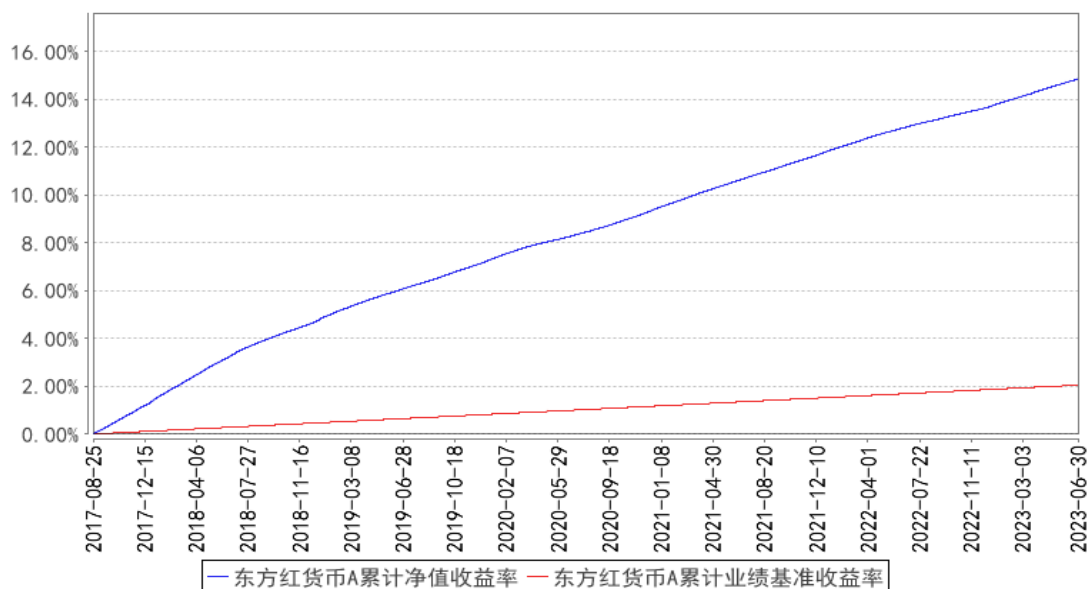
东方红货币 D

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	0.1724%	0.0008%	0.0288%	0.0000%	0.1436%	0.0008%
过去三个月	0.5172%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.4299%	0.0005%
过去六个月	1.0380%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	0.8644%	0.0005%
过去一年	1.9069%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.5569%	0.0009%
过去三年	6.5380%	0.0009%	1.0500%	0.0000%	5.4880%	0.0009%
自基金合同生效起	6.8608%	0.0010%	1.1123%	0.0000%	5.7485%	0.0010%

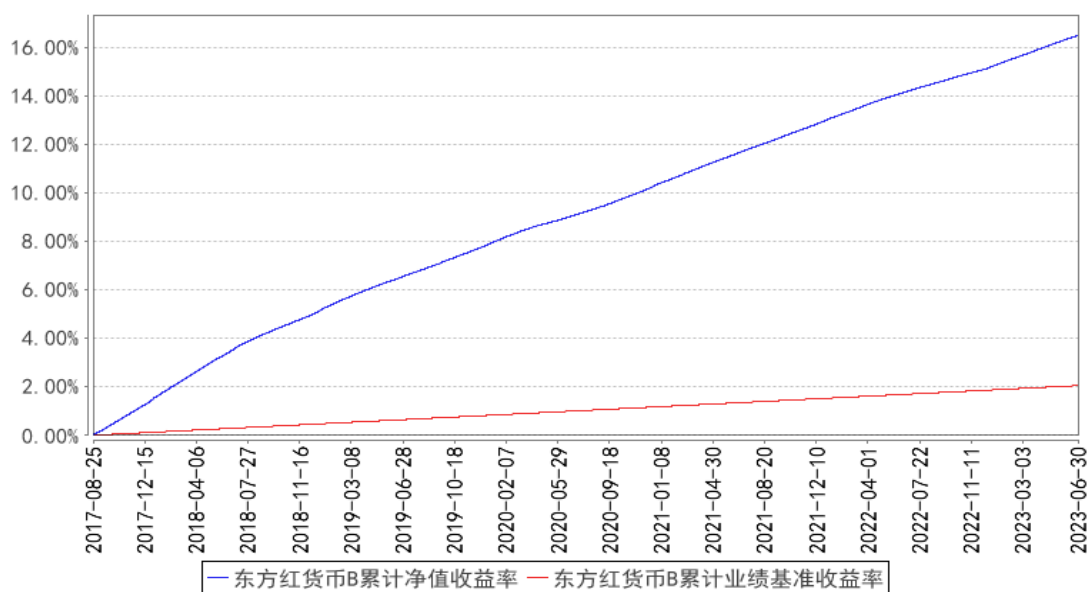
东方红货币 E						
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	0.1718%	0.0007%	0.0288%	0.0000%	0.1430 %	0.0007 %
过去三个月	0.5166%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.4293 %	0.0004 %
过去六个月	1.0374%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	0.8638 %	0.0005 %
过去一年	1.9062%	0.0009%	0.3500%	0.0000%	1.5562 %	0.0009 %
过去三年	6.5337%	0.0009%	1.0500%	0.0000%	5.4837 %	0.0009 %
自基金合同生效起 至今	15.8741 %	0.0022%	2.0482%	0.0000%	13.825 9%	0.0022 %

### 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

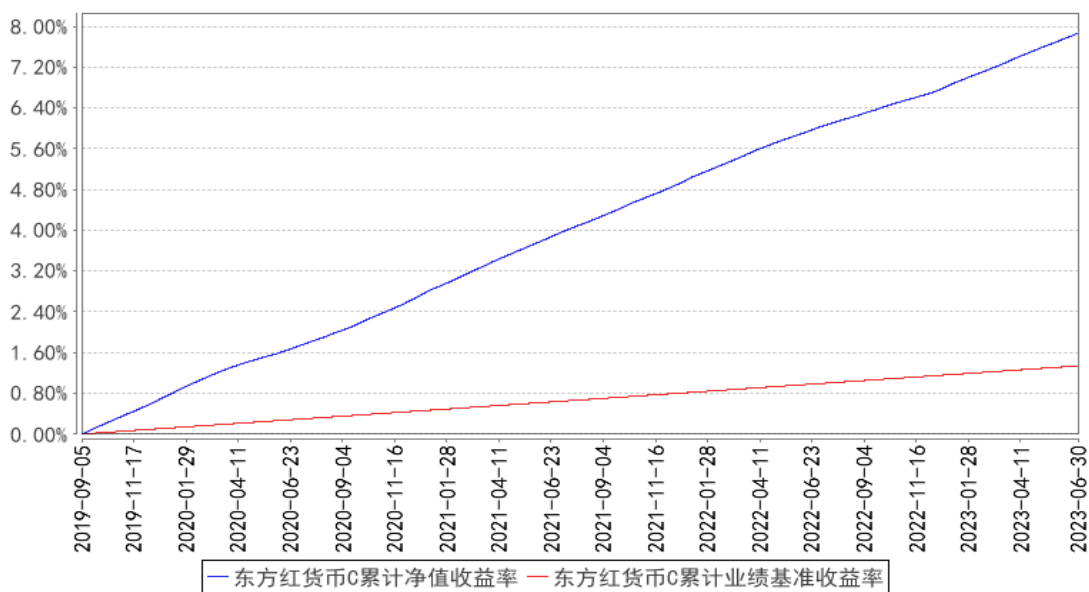
东方红货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



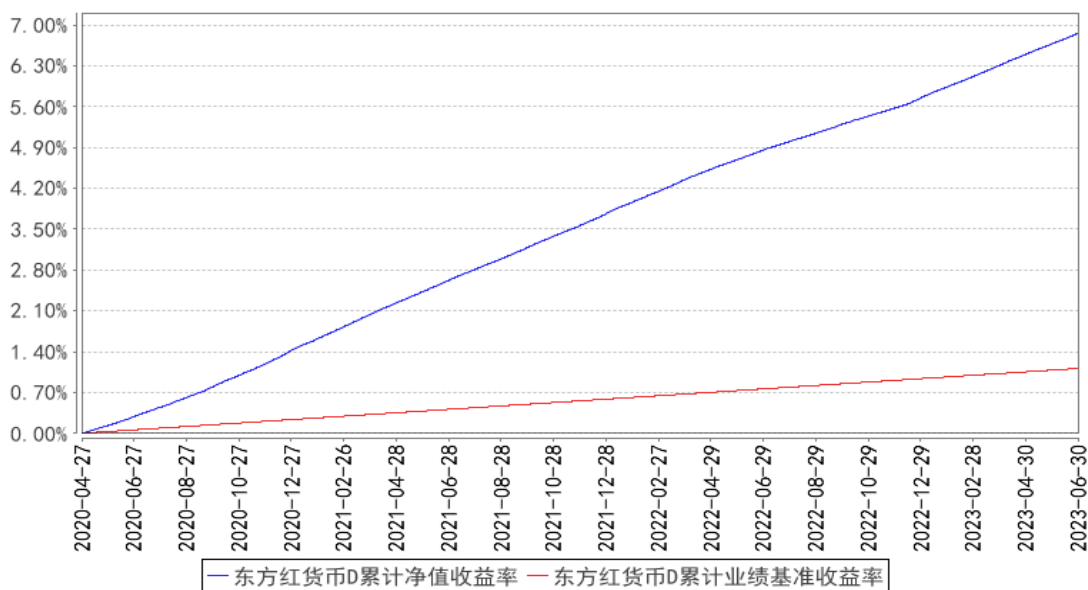
东方红货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



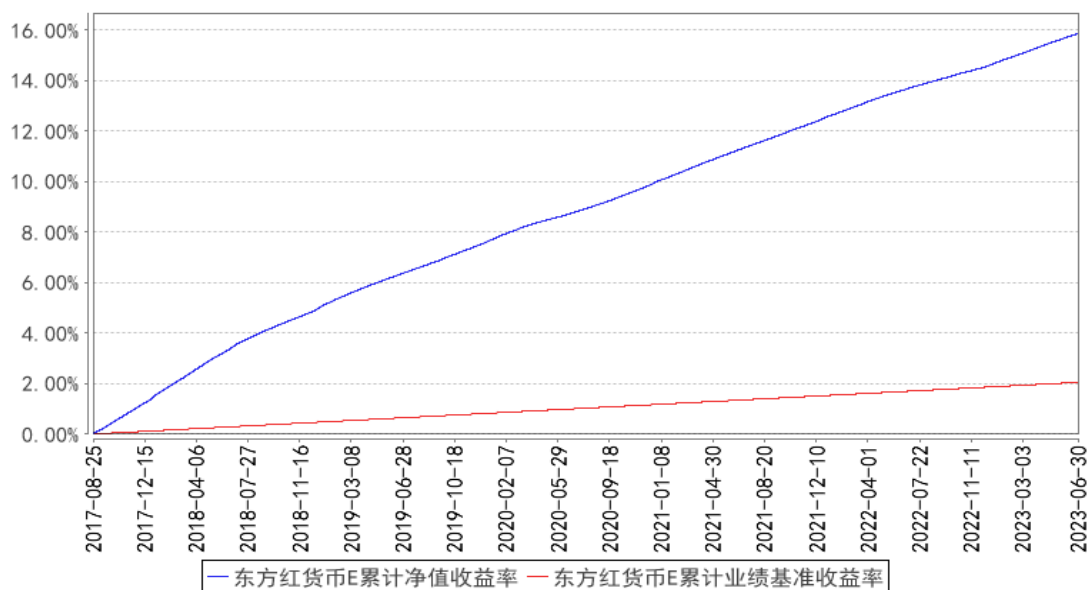
东方红货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红货币D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



## § 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

本基金管理人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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、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、东方红沪港深灵活配置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、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置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、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、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、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深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、东方红创新优选三年定期开放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、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红汇阳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 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红益鑫纯债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、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期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、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、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、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、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）、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红智远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）、东方红鑫泰 66 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、东方红鑫安 39 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、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红新海混合型证券投资基金、东方红新源三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金、东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红智华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启兴三年持有期混合型证券投资基金、东方红智选三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿和三年定期开放混合型证券投资基金、东方红中证东方红红利低波动指数证券投资基金、东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金、东方红 ESG 可持续投资混合型证券投资基金、东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红医疗升级股票型发起式证券投资基金、东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红短债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、东方红中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、东方红锦惠甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红共赢甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红先进制造混合型证券投资基金、东方红颐安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红 30 天滚动持有纯债债券型证券投资基金共计 92 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		
李燕	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2017 年 10 月 25 日	-	22 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2017 年 10 月至今任东方红货币市场基金基金经理、2022 年 05 月至今任东方红短债债券型证券投资基金基金经理、2022 年 12 月至今任东方红中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。东北财经大学金融学硕士。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。具备证券投资基金从业资格。

丁锐	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2018年11月23日	-	10年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，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、2022年03月至今任东方红短债债券型证券投资基金基金经理、2023年06月至今任东方红30天滚动持有纯债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投资经理助理。具备证券投资基金从业资格。
高德勇	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2020年5月11日	-	16年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2020年05月至今任东方红货币市场基金基金经理、2021年01月至今任东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2021年07月至2023年02月任东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021年12月至今任东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、2022年03月至今任东方红锦融甄选18个月持有期混合型证券投资基金基金经理、2023年01月至今任东方红锦惠甄选18个月持有期混合型证券投资基金基金经理。南京大学理学学士。曾任上海农商银行金融市场部货币市场科负责人、国泰君安证券股份有限公司资金同业部金融同业总监、华鑫证券销售交易部部门总经理。具备证券投资基金从业资格。

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。

## 4.2 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

2023 年上半年国内经济整体呈复苏态势，GDP 同比增长 5.5%，但环比数据在 2 月上行至高点后有所回落，二季度表现更为明显，显示积压需求集中释放过后，经济复苏内生动能依然有待提升。具体看，基建投资、制造业投资、消费是拉动经济增长的主要力量，出口、房地产投资则成为经济增长的影响因素，通胀持续下行，6 月 CPI 同比为 0，PPI 同比-5.4%。货币政策稳健偏松，于 3 月降准 0.25%，6 月降息 10BP，并推动商业银行降低存款利率；资金面整体保持宽松，货币市场利率走势与经济走势基本保持一致，收益率先上后下。

本报告期内，本基金较好地把握了资金利率的波动和资产配置时机，组合久期和杠杆整体偏积极，在做好流动性管理的同时，为投资者获取了较为稳健的回报。

### 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 0.9628%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%；B 类份额净值收益率为 1.0830%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%；C 类份额净值收益率为 0.9627%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%；D 类份额净值收益率为 1.0380%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%；E 类份额净值收益率为 1.0374%，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，经济依然有待走出有效需求不足、内生动力偏弱的情境，7月底政治局会议后，市场将更加关注可能出台的宏观经济逆周期政策及政策落地的效果，预计前者对三季度债券市场的扰动更大，四季度市场将更加关注后者。政策的着力点预计主要在内需相关的房地产、消费、基建等领域，政策作用下，下半年内需可能企稳；外需方面则取决于海外去库存的进度，但四季度在低基数的作用下，出口同比增速有望出现改善。同时，稳增长背景下货币政策预计仍将维持宽松。

#### 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。本基金管理人估值委员和估值人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。

#### 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 214,578,897.52 元，实际分配收益 215,920,422.24 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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本基金 2023 年中期报告中财务指标、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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,647,298,687.74	3,625,152,127.39
结算备付金		10,434,573.40	28,050,655.43
存出保证金		-	112.93
交易性金融资产	6.4.7.2	11,746,424,627.17	9,788,038,621.08
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,746,424,627.17	9,788,038,621.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,872,040,514.85	3,149,139,988.44
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		111,591,476.00	61,742,220.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		18,387,789,879.16	16,652,123,725.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,144,180,505.50	645,095,163.42
应付清算款		-	-
应付赎回款		100,119.05	7,094.16
应付管理人报酬		3,674,281.32	2,973,605.93
应付托管费		1,102,284.41	892,081.75
应付销售服务费		1,520,575.26	1,413,055.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		89,964.38	88,280.74
应付利润		1,031,969.11	2,373,493.83
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	415,050.38	451,184.14
负债合计		2,152,114,749.41	653,293,959.08
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	16,235,675,129.75	15,998,829,766.20
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		16,235,675,129.75	15,998,829,766.20
负债和净资产总计		18,387,789,879.16	16,652,123,725.28

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 16,235,675,129.75 份，其中东方红货币 A 基金份额总额 75,061,802.32 份，基金份额净值 1.0000 元；东方红货币 B 基金份额总额 9,976,139,227.64 份，基金份额净值 1.0000 元；东方红货币 C 基金份额总额 4,779,383,016.35 份，基金份额净值 1.0000 元；东方红货币 D 基金份额总额 1,391,384,512.03 份，基金份额净值 1.0000 元；东方红货币 E 基金份额总额 13,706,571.41 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		258,129,716.55	210,690,215.23
1. 利息收入		120,392,955.36	101,746,717.75
其中：存款利息收入	6.4.7.13	63,240,387.03	57,534,375.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		57,152,568.33	44,212,342.62
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		137,736,761.19	108,943,497.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	137,736,761.19	108,943,497.48
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		43,550,819.03	35,803,351.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,553,830.77	16,973,736.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,166,149.17	5,092,120.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,993,530.70	8,256,577.32
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,597,610.40	5,205,580.03

其中：卖出回购金融资产支出		7,597,610.40	5,205,580.03
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		36,613.74	80,679.89
8. 其他费用	6.4.7.23	203,084.25	194,657.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		214,578,897.52	174,886,863.81
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		214,578,897.52	174,886,863.81
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		214,578,897.52	174,886,863.81

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东方红货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	15,998,829,766.20	-	-	15,998,829,766.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	15,998,829,766.20	-	-	15,998,829,766.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	236,845,363.55	-	-	236,845,363.55
（一）、综合收益总额	-	-	214,578,897.52	214,578,897.52
（二）、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）	236,845,363.55	-	-	236,845,363.55
其中：1. 基金申	81,859,502,519	-	-	81,859,502,519.

购款	.43			43
2. 基金赎回款	-81,622,657,155.88	-	-	-81,622,657,155.88
(三)、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)	-	-	-214,578,897.52	-214,578,897.52
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	16,235,675,129.75	-	-	16,235,675,129.75
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	12,995,581,156.38	-	-	12,995,581,156.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	12,995,581,156.38	-	-	12,995,581,156.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,083,840,921.60	-	-	3,083,840,921.60
(一)、综合收益总额	-	-	174,886,863.81	174,886,863.81
(二)、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)	3,083,840,921.60	-	-	3,083,840,921.60
其中：1. 基金申购款	71,378,797,857.80	-	-	71,378,797,857.80

2. 基金赎回款	-68,294,956,936.20	-	-	-68,294,956,936.20
(三)、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)	-	-	-174,886,863.81	-174,886,863.81
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	16,079,422,077.98	-	-	16,079,422,077.98

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：

张锋

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

## 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、C类、D类和E类五类基金份额,五类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,五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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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 2023 年半年度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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。



## 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	558,136.79
等于：本金	557,905.95
加：应计利息	230.84
减：坏账准备	-
定期存款	4,646,740,550.95
等于：本金	4,623,000,000.00

加：应计利息	23,740,550.95
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	100,167,749.99
存款期限 3 个月以上	4,546,572,800.96
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,647,298,687.74

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	23,000,828.52	22,978,694.09	-22,134.43	-0.0001
	银行间市场	11,723,423,798.65	11,728,223,357.77	4,799,559.12	0.0296
	合计	11,746,424,627.17	11,751,202,051.86	4,777,424.69	0.0294
资产支持证券		-	-	-	-
合计		11,746,424,627.17	11,751,202,051.86	4,777,424.69	0.0294

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	141,853,649.73	-
银行间市场	1,730,186,865.12	-
合计	1,872,040,514.85	-

##### 6.4.7.4.2 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。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	-
应付交易费用	292,616.33
其中：交易所市场	-
银行间市场	292,616.33
应付利息	-
预提费用	122,434.05
合计	415,050.38

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

#### 东方红货币 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,084,239.64	64,084,239.64
本期申购	133,820,056.73	133,820,056.73
本期赎回（以“-”号填列）	-122,842,494.05	-122,842,494.05
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	75,061,802.32	75,061,802.32

东方红货币 B

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	10,307,882,620.54	10,307,882,620.54
本期申购	20,743,269,952.73	20,743,269,952.73
本期赎回 (以“-”号填列)	-21,075,013,345.63	-21,075,013,345.63
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	9,976,139,227.64	9,976,139,227.64

东方红货币 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,868,308,096.86	4,868,308,096.86
本期申购	56,558,942,355.69	56,558,942,355.69
本期赎回 (以“-”号填列)	-56,647,867,436.20	-56,647,867,436.20
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	4,779,383,016.35	4,779,383,016.35

东方红货币 D

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	747,409,541.75	747,409,541.75
本期申购	4,384,941,311.56	4,384,941,311.56
本期赎回 (以“-”号填列)	-3,740,966,341.28	-3,740,966,341.28
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	1,391,384,512.03	1,391,384,512.03

东方红货币 E

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	11,145,267.41	11,145,267.41
本期申购	38,528,842.72	38,528,842.72
本期赎回 (以“-”号填列)	-35,967,538.72	-35,967,538.72

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	13,706,571.41	13,706,571.41

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 东方红货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	586,331.33	-	586,331.33
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-586,331.33	-	-586,331.33
本期末	-	-	-

##### 东方红货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	144,130,385.82	-	144,130,385.82
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-144,130,385.82	-	-144,130,385.82
本期末	-	-	-

##### 东方红货币 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	59,911,924.03	-	59,911,924.03
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-59,911,924.03	-	-59,911,924.03
本期末	-	-	-

##### 东方红货币 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	9,813,417.92	-	9,813,417.92
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-9,813,417.92	-	-9,813,417.92
本期末	-	-	-

东方红货币 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	136,838.42	-	136,838.42
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-136,838.42	-	-136,838.42
本期末	-	-	-

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	10,957.39
定期存款利息收入	63,084,015.46
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	145,413.89
其他	0.29
合计	63,240,387.03

6.4.7.14 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	136,775,729.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	961,031.31
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	137,736,761.19

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,986,468,178.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,946,158,871.32
减：应计利息总额	39,348,275.99
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	961,031.31

**6.4.7.15.3 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。

**6.4.7.15.4 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。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

**6.4.7.17.1 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。

**6.4.7.17.2 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。

**6.4.7.17.3 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。

**6.4.7.17.4 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。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 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。

**6.4.7.18.2 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。

**6.4.7.19 股利收益**

注：本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.21 其他收入**

注：本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	53,556.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	73,990.20
账户维护费	16,030.59
合计	203,084.25

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1 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。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系**

**6.4.9.1 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**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。



#### 6.4.9.2 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
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、注册登记机构、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
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司、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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

注：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。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	119,240,391.78	100.00

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
东方证券	16,160,495,000.00	100.00	20,302,005,000.00	100.00

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：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。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年
----	------------------------	----------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,553,830.77	16,973,736.06
其中：支付销售机构的客户维护费	1,100,080.02	978,235.53

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,166,149.17	5,092,120.83

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.06% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.06\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 C	东方红货币 D	东方红货币 E	合计
东方证券	1,762.35	8,642.11	7,776,168.01	-	-	7,786,572.47
东证期货	1.81	-	-	-	-	1.81
东证资管	34,763.49	499,205.24	-	70,695.52	6,014.77	610,679.02
合计	36,527.65	507,847.35	7,776,168.01	70,695.52	6,014.77	8,397,253.3

			1			0
获得销售服务费 的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 C	东方红货币 D	东方红货币 E	合计
东方证券	2,386.60	-	7,370,988.09	-	-	7,373,374.69
东证期货	1.81	-	-	-	-	1.81
东证资管	29,592.07	353,952.02	-	69,138.28	6,537.95	459,220.32
合计	31,980.48	353,952.02	7,370,988.09	69,138.28	6,537.95	7,832,596.82

注：本基金 E 类基金份额的年销售服务费为 0.1%/年。

本基金 D 类基金份额的年销售服务费为 0.1%/年。

本基金 C 类基金份额的年销售服务费为 0.25%/年。

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 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费率为 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、C 类基金份额、D 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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1 日至2023年 6月30日	本期 2023年1月1 日至2023年 6月30日	本期 2023年1月1 日至2023年 6月30日	本期 2023年1月1日至 2023年6月30日	本期 2023年1月1 日至2023年 6月30日
	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 C	东方红货币 D	东方红货币 E
基金合同生效日（2017年8月25日）持有的基金份额	-	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-	120,027.16	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	1,109.77	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	121,136.93	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	0.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	0.0000%	-
项目	上年度可比 期间 2022年1月1 日至2022年 6月30日	上年度可比 期间 2022年1月1 日至2022年 6月30日	上年度可比 期间 2022年1月1 日至2022年 6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比 期间 2022年1月1 日至2022年 6月30日
	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 C	东方红货币 D	东方红货币 E
基金合同生效日（2017年8月25日）持有的基金份额	-	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-

减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-	-

注: 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

#### 6.4.10.4.2 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 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	4.24	0.0000	80,033.40	0.0005

份额单位: 份

##### 东方红货币 B

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	200,013,440.26	1.2319	200,040,868.46	1.2503

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相关法律文件有关规定支付。

#### 6.4.10.5 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	558,136.79	10,957.39	939,144.78	15,155.05

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

东方红货币 A				
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	本期利润分配合 计	备注
585,748.69	5,075.28	-4,492.64	586,331.33	-
东方红货币 B				
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	本期利润分配合 计	备注
143,268,858.77	1,776,408.75	-914,881.70	144,130,385.82	-
东方红货币 C				
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	本期利润分配合 计	备注
60,311,365.29	-	-399,441.26	59,911,924.03	-
东方红货币 D				
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	本期利润分配合 计	备注
9,779,809.80	55,542.41	-21,934.29	9,813,417.92	-
东方红货币 E				
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	本期利润分配合 计	备注
135,531.63	2,081.62	-774.83	136,838.42	-

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 2,144,180,505.50 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
112208143	22 中信银行 CD143	2023 年 7 月 3 日	99.29	990,000	98,292,736.68
112209145	22 浦发银行	2023 年 7 月 3	99.61	1,190,000	118,541,200.12

	CD145	日			
112289379	22 宁波银行 CD300	2023 年 7 月 3 日	99.34	1,360,000	135,098,438.11
112303118	23 农业银行 CD118	2023 年 7 月 3 日	99.58	1,510,000	150,372,080.53
112308042	23 中信银行 CD042	2023 年 7 月 3 日	98.33	1,000,000	98,331,360.00
112311040	23 平安银行 CD040	2023 年 7 月 3 日	98.41	202,000	19,878,869.22
112315255	23 民生银行 CD255	2023 年 7 月 3 日	99.61	2,000,000	199,227,164.91
112315261	23 民生银行 CD261	2023 年 7 月 3 日	99.59	220,000	21,908,803.67
112318051	23 华夏银行 CD051	2023 年 7 月 3 日	98.31	1,000,000	98,308,554.28
112318157	23 华夏银行 CD157	2023 年 7 月 3 日	97.85	170,000	16,635,068.55
112320047	23 广发银行 CD047	2023 年 7 月 3 日	99.02	1,000,000	99,024,451.62
112380992	23 台州银行 CD031	2023 年 7 月 3 日	99.57	1,870,000	186,199,118.72
180211	18 国开 11	2023 年 7 月 3 日	103.49	220,000	22,767,229.67
180413	18 农发 13	2023 年 7 月 3 日	102.78	500,000	51,389,710.11
200207	20 国开 07	2023 年 7 月 3 日	102.80	2,800,000	287,834,651.63
200313	20 进出 13	2023 年 7 月 3 日	102.93	1,280,000	131,744,308.41
210402	21 农发 02	2023 年 7 月 3 日	101.62	980,000	99,584,953.74
220023	22 付息国债 23	2023 年 7 月 3 日	101.10	400,000	40,439,723.47
220211	22 国开 11	2023 年 7 月 3 日	101.57	290,000	29,456,226.52
220302	22 进出 02	2023 年 7 月 3 日	100.85	100,000	10,085,325.97
220306	22 进出 06	2023 年 7 月 3 日	101.49	100,000	10,149,423.56
220308	22 进出 08	2023 年 7 月 3 日	101.17	300,000	30,352,353.60
220408	22 农发 08	2023 年 7 月 3 日	101.23	1,870,000	189,305,952.56
220411	22 农发 11	2023 年 7 月 3	101.22	1,000,000	101,224,965.18

		日			
230301	23 进出 01	2023 年 7 月 3 日	100.93	700,000	70,653,973.46
合计				23,052,000	2,316,806,644.29

#### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；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；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

##### 6.4.13.2 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行中国工商银行，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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	20,013,808.22	1,723,479.26
A-1 以下	-	-
未评级	1,144,506,214.14	1,151,029,995.96
合计	1,164,520,022.36	1,152,753,475.22

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,951,596,658.01	8,187,906,734.05
合计	9,951,596,658.01	8,187,906,734.05

#### 6.4.13.2.4 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	15,635,754.36	15,536,790.61
AAA 以下	-	-
未评级	614,672,192.44	431,841,621.20
合计	630,307,946.80	447,378,411.81

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 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可于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。

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。

于 2023 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 2,144,180,505.50 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 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》且于基金开放日内按照《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时间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发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放日内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（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 6.4.12。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 2023 年 06 月 30 日，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放日内，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。于 2023 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金可以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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年 6月 30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	613,957,768.56	2,880,595,141.21	1,152,745,777.9	-	-	-	4,647,298,687.7

行存款		3	5			4
结算备付金	10,434,573.40	-	-	-	-	10,434,573.40
交易性金融资产	150,355,899.73	7,242,355,162.04	4,353,713,565.40	-	-	11,746,424,627.17
买入返售金融资产	1,872,040,514.85	-	-	-	-	1,872,040,514.85
应收申购款	-	-	-	-	111,591,476.00	111,591,476.00
资产总计	2,646,788,756.54	10,122,950,303.27	5,506,459,343.35	-	111,591,476.00	18,387,789,879.16
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	100,119.05	100,119.05
应付管理人报	-	-	-	-	3,674,281.32	3,674,281.32

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	1,102,284.41	1,102,284.41
卖出回购金融资产款	2,144,180,505.50	-	-	-	-	-	2,144,180,505.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,520,575.26	1,520,575.26
应付利润	-	-	-	-	-	1,031,969.11	1,031,969.11
应交税费	-	-	-	-	-	89,964.38	89,964.38
其他负债	-	-	-	-	-	415,050.38	415,050.38
负债总计	2,144,180,505.50	-	-	-	-	7,934,243.91	2,152,114,749.41
利率敏感度缺口	502,608,251.04	10,122,950,303.27	5,506,459,343.35	-	-	103,657,232.09	16,235,675,129.75

上 年 度 末 202 2 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	671,263,029.42	1,051,414,861.42	1,902,474,236.55	-	-	-	3,625,152,127.39
结 算 备 付 金	28,050,655.43	-	-	-	-	-	28,050,655.43
存 出 保 证 金	112.93	-	-	-	-	-	112.93
交 易 性 金 融 资 产	80,562,703.54	5,208,771,376.71	4,498,704,540.83	-	-	-	9,788,038,621.08
买 入 返 售 金 融 资 产	3,149,139,988.44	-	-	-	-	-	3,149,139,988.44
应 收 申 购	-	-	-	-	-	61,742,220.01	61,742,220.01

款							
资产总计	3,929,016,489.76	6,260,186,238.13	16,401,178,777.38	-	-61,742,220.01	16,652,123,725.28	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	7,094.16	7,094.16	
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,973,605.93	2,973,605.93	
应付托管费	-	-	-	-	892,081.75	892,081.75	
卖出回购金融资产款	645,095,163.42	-	-	-	-	645,095,163.42	
应付销售服务费	-	-	-	-	1,413,055.11	1,413,055.11	
应付利润	-	-	-	-	2,373,493.83	2,373,493.83	
应	-	-	-	-	88,280.74	88,280.74	

交税费							
其他负债		-	-	-	-	451,184.14	451,184.14
负债总计	645,095,163.42	-	-	-	-	8,198,795.66	653,293,959.08
利率敏感度缺口	3,283,921,326.34	6,260,186,238.13	16,401,178,777.38	-	-	-53,543,424.35	15,998,829,766.20

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	8,646,406.47	8,181,896.67
2. 市场利率上升 25 个基点	-8,629,464.58	-8,164,431.92	

#### 6.4.13.4.2 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。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

#### 6.4.13.4.3.1 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。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	11,746,424,627.17	9,788,038,621.08
第三层次	-	-
合计	11,746,424,627.17	9,788,038,621.08

###### 6.4.14.2.2 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层

次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	11,746,424,627.17	63.88
	其中：债券	11,746,424,627.17	63.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,872,040,514.85	10.18
	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	4,657,733,261.14	25.33
4	其他各项资产	111,591,476.00	0.61
5	合计	18,387,789,879.16	100.00

### 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	4.14	
	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	2,144,180,505.50	13.21
	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

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	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

### 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	15.64	13.21
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	8.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	48.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	13.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	24.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	112.27	13.21

### 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	40,439,723.47	0.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,065,828,895.54	6.56
	其中：政策性金融债	1,045,815,087.32	6.44

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	672,923,595.79	4.14
6	中期票据	15,635,754.36	0.10
7	同业存单	9,951,596,658.01	61.29
8	其他	-	-
9	合计	11,746,424,627.17	72.35
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 7.6 期末按实际利率计算账面价值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)	按实际利率计算的账面价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	200207	20 国开 07	2,800,000	287,834,651.63	1.77
2	112315255	23 民生银行 CD255	2,000,000	199,227,164.91	1.23
3	112303118	23 农业银行 CD118	2,000,000	199,168,318.58	1.23
4	112380992	23 台州银行 CD031	2,000,000	199,143,442.48	1.23
5	112303134	23 农业银行 CD134	2,000,000	198,941,279.15	1.23
6	220408	22 农发 08	1,870,000	189,305,952.56	1.17
7	112209145	22 浦发银行 CD145	1,500,000	149,421,680.82	0.92
8	112289379	22 宁波银行 CD300	1,500,000	149,005,630.27	0.92
9	112304002	23 中国银行 CD002	1,500,000	148,866,647.79	0.92
10	200313	20 进出 13	1,280,000	131,744,308.41	0.81

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0465%
报告期内偏离度的最低值	-0.0344%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0182%

#### 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 期末按实际利率计算的账面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 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。

### 7.9.2 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发行主体中，上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海市市场监督管理局、国家外汇管理局上海市分局的处罚；宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到宁波银保监局的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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。

### 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	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	111,591,476.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	111,591,476.00

### 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	2,242	33,479.84	48,947,426.08	65.21	26,114,376.24	34.79
东方红货币 B	60	166,268,987.13	9,976,139,227.64	100.00	-	-
东方红货币 C	39,558	120,819.63	410,261,440.46	8.58	4,369,121,575.89	91.42
东方红货币 D	126,881	10,966.06	287,332,869.77	20.65	1,104,051,642.26	79.35
东方红货币 E	1,374	9,975.67	-	-	13,706,571.41	100.00
合计	170,115	95,439.41	10,722,680,963.95	66.04	5,512,994,165.80	33.96

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	券商类机构	882,738,589.51	5.44
2	券商类机构	701,845,593.05	4.32
3	券商类机构	624,192,456.98	3.84
4	信托类机构	604,975,453.89	3.73
5	银行类机构	502,140,669.28	3.09
6	银行类机构	501,639,902.67	3.09
7	银行类机构	500,923,057.21	3.09
8	其他类机构	414,223,299.49	2.55
9	银行类机构	403,364,668.84	2.48
10	其他类机构	401,975,388.61	2.48

### 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	551,704.69	0.74
	东方红货币 B	-	-
	东方红货币 C	70,322.11	0.00
	东方红货币 D	23,063,828.23	1.66
	东方红货币 E	1,905,113.54	13.90
	合计	25,590,968.57	0.16

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（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	0
	东方红货币 C	0
	东方红货币 D	>100
	东方红货币 E	>100
	合计	>100
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 C	0
	东方红货币 D	10~50
	东方红货币 E	0~10
	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 C	东方红货币 D	东方红货币 E
基金合同生效日（2017年8月25日）基金份额总	18,161,374.56	1,293,000,000.00	-	-	6,864,488.67

额					
本报告 期期初 基金份 额总额	64,084,239.64	10,307,882,62 0.54	4,868,308,096 .86	747,409,541.7 5	11,145,267.41
本报告 期基金 总申购 份额	133,820,056.7 3	20,743,269,95 2.73	56,558,942,35 5.69	4,384,941,311 .56	38,528,842.72
减：本报 告期基 金总赎 回份额	122,842,494.0 5	21,075,013,34 5.63	56,647,867,43 6.20	3,740,966,341 .28	35,967,538.72
本报告 期基金 拆分变 动份额	-	-	-	-	-
本报告 期期末 基金份 额总额	75,061,802.32	9,976,139,227 .64	4,779,383,016 .35	1,391,384,512 .03	13,706,571.41

## § 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

报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期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

报告期内未发生基金管理人、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）。报告期内本基金未发生改聘会计师事务所的情形。



## 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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 (%)	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	5	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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、本基金本报告期内租用的券商交易单元变更情况：新增开源证券交易单元 2 个、国海证券交易单元 2 个。

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(%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	16,160,495,000.00	100.00	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
高华证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-

信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

### 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。

### 10.9 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	关于东方红货币市场基金在代销机构暂停办理大额申购（含定期定额投资、转换转入）业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 5 日
2	关于东方红货币市场基金节假日前暂停代销机构申购（含转换转入、定期定额投资）及直销机构转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 18 日
3	东方红货币市场基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
4	关于东方红货币市场基金恢复代销机构大额申购（含定期定额投资、转换转入）业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 2 月 6 日
5	关于东方红货币市场基金在代销机构暂停办理大额申购（含定期定额投资、转换转入）业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 2 月 10 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红货币市场基金 D 类份额增加代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 2 月 15 日
7	关于东方红货币市场基金在直销平台调整单笔申购金额限制的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 2 月 20 日

8	上海东方证券资产管理有限公司关于部分基金增加代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 2 月 23 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金增加泰信财富基金管理有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 6 日
10	关于调整东方红货币市场基金 D 类份额未付收益支付规则的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 8 日
11	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金增加泛华普益基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 9 日
12	关于东方红货币市场基金恢复及暂停代销机构大额申购（含定期定额投资、转换转入）业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 14 日
13	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金增加北京雪球基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 14 日
14	关于东方红货币市场基金恢复及暂停代销机构大额申购（含定期定额投资、转换转入）业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
15	东方红货币市场基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 31 日
16	上海东方证券资产管理有限公司关于部分基金增加招商证券股份有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 11 日
17	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 13 日
18	东方红货币市场基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
19	关于东方红货币市场基金节假日前暂停代销机构申购（含转换转入、定期定额投资）及直销机构转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 25 日
20	关于东方红货币市场基金恢复及暂停代销机构大额申购（含定期定额投资、转换转入）业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 12 日
21	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海陆享基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 16 日
22	上海东方证券资产管理有限公司关于部分基金增加国信证券股份有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 30 日
23	关于东方红货币市场基金节假日前暂停代销机构申购（含转换转入、定期	中国证监会规定媒介	2023 年 6 月 19 日

	定额投资)及直销机构转换转入业务的公告		
24	关于东方红货币市场基金恢复及暂停代销机构大额申购(含定期定额投资、转换转入)业务的公告	中国证监会规定媒介	2023年6月21日
25	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红货币市场基金D类份额增加代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023年6月26日
26	关于东方红货币市场基金增加北京度小满基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2023年6月26日
27	关于上海浦东发展银行股份有限公司延后代销东方红货币市场基金D类份额的公告	中国证监会规定媒介	2023年6月27日

## § 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

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红货币市场基金的文件；
- 2、《东方红货币市场基金基金合同》；
- 3、《东方红货币市场基金托管协议》；
- 4、东方红货币市场基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

### 12.3 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

2023 年 8 月 31 日