

# 东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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 2024 年 08 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 2024 年 1 月 19 日新增 E 类份额，本报告中本基金 E 类份额的“基金合同生效日”特指 2024 年 1 月 19 日。

本基金 A 类和 C 类份额报告期为 2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日，E 类份额报告期为 2024 年 01 月 19 日-2024 年 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	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
<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>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47

7.7 期末按公允价值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 .....	47
7.8 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 .....	48
7.9 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 .....	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.11 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.3 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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金		
基金简称	东方红益鑫纯债债券		
基金主代码	003668		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 11 月 28 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	164,894,108.00 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	东方红益鑫纯债债券 A	东方红益鑫纯债债券 C	东方红益鑫纯债债券 E
下属分级基金的交易代码	003668	003669	020615
报告期末下属分级基金的份额总额	22,955,133.62 份	135,881,516.27 份	6,057,458.11 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法，在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上，对市场基本利率、债券类产品收益率、货币类产品收益率等大类产品收益率水平变化进行评估，并结合各类资产的波动性以及流动性状况分析，针对不同行业、不同投资品种选择投资策略，以此做出最佳的资产配置及风险控制。
业绩比较基准	中债综合全价指数（0571.CS）收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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 姓名	周陶	郭明

负责人	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	廖林

## 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	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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)			
	2024 年 1 月 19 日(基金合同生效日)-2024 年 6 月 30 日	东方红益鑫纯债债券 A	东方红益鑫纯债债券 C	东方红益鑫纯债债券 E
本期已实现收益		594,258.75	3,206,833.16	215,823.97
本期利润		734,606.42	3,541,717.84	114,278.88
加权平均基金份额本期利润		0.0259	0.0239	0.0086
本期加权平均净值利润率		2.45%	2.27%	0.82%

本期基金份额净值增长率	2.41%	2.29%	2.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)		
期末可供分配利润	1,130,304.19	5,990,074.33	264,810.86
期末可供分配基金份额利润	0.0492	0.0441	0.0437
期末基金资产净值	24,616,239.15	144,992,348.78	6,461,225.86
期末基金份额净值	1.0724	1.0670	1.0667
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	30.60%	27.55%	2.12%

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、本基金于 2024 年 01 月 19 日增加东方红益鑫纯债债券 E 类份额，东方红益鑫纯债债券 E 类份额报告期间为 2024 年 01 月 19 日-2024 年 06 月 30 日，自东方红益鑫纯债债券 E 类份额生效日起至本报告期末不满半年。

### 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

东方红益鑫纯债债券 A

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.47%	0.02%	0.65%	0.03%	-0.18%	-0.01%
过去三个月	1.27%	0.06%	1.06%	0.07%	0.21%	-0.01%
过去六个月	2.41%	0.05%	2.42%	0.07%	-0.01%	-0.02%
过去一年	3.30%	0.05%	3.27%	0.06%	0.03%	-0.01%
过去三年	8.99%	0.04%	6.58%	0.05%	2.41%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	30.60%	0.04%	8.05%	0.07%	22.55%	-0.03%

东方红益鑫纯债债券 C

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
过去一个月	0.44%	0.02%	0.65%	0.03%	-0.21%	-0.01%
过去三个月	1.22%	0.06%	1.06%	0.07%	0.16%	-0.01%
过去六个月	2.29%	0.05%	2.42%	0.07%	-0.13%	-0.02%
过去一年	3.08%	0.05%	3.27%	0.06%	-0.19%	-0.01%
过去三年	8.33%	0.04%	6.58%	0.05%	1.75%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	27.55%	0.04%	8.05%	0.07%	19.50%	-0.03%

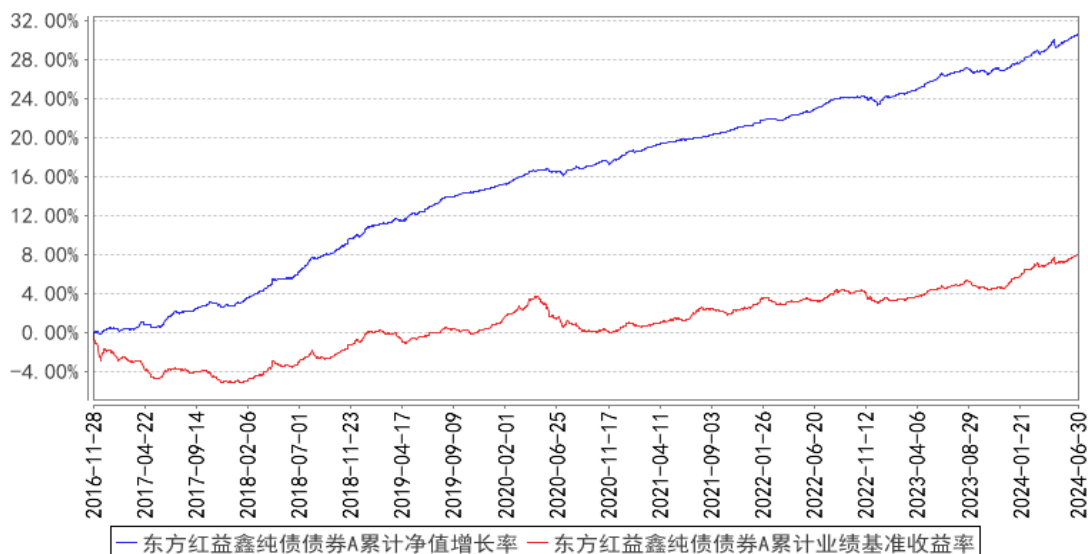
东方红益鑫纯债债券 E

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
过去一个月	0.45%	0.02%	0.65%	0.03%	-0.20%	-0.01%
过去三个月	1.20%	0.06%	1.06%	0.07%	0.14%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	2.12%	0.06%	2.13%	0.07%	-0.01%	-0.01%

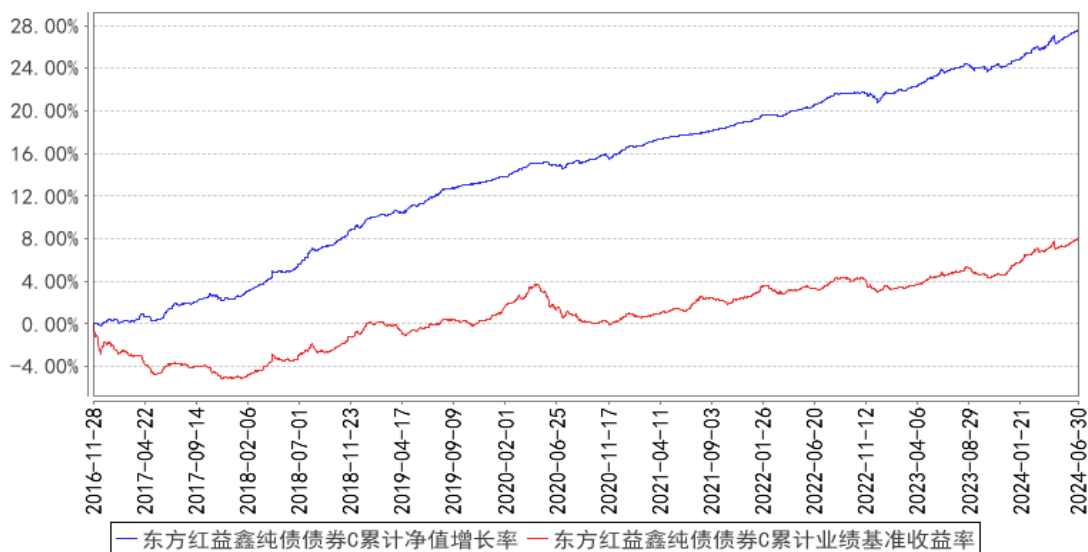


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

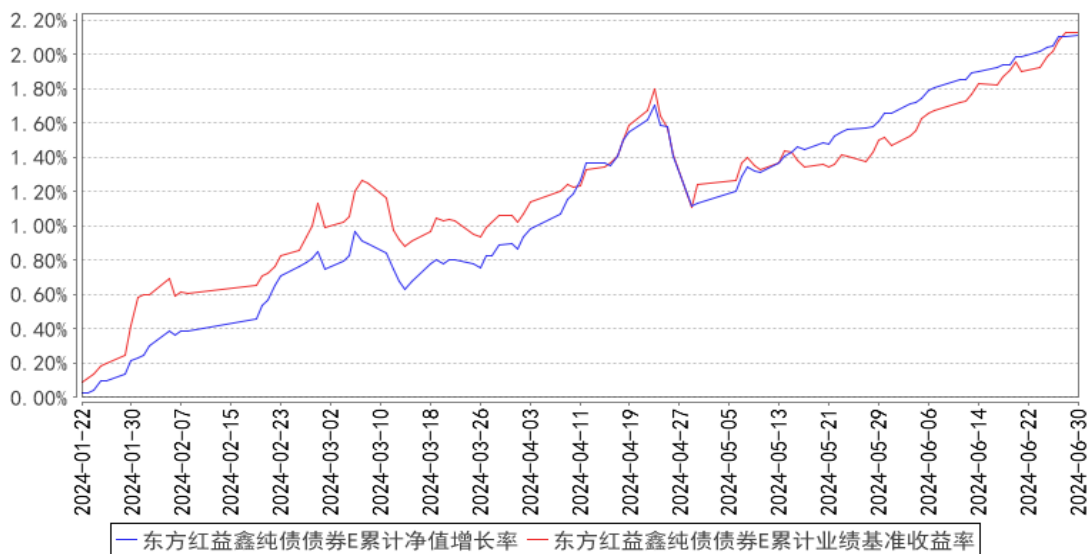
东方红益鑫纯债债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红益鑫纯债债券C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



东方红益鑫纯债债券E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



## § 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 2024 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）、东方红睿玺三年持有期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、东方红欣和积极配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、东方红 6 个月持有期债券型证券投资基金、东方红中证东方红优势成长指数发起式证券投资基金、东方红远见领航混合型发起式证券投资基金、东方红 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方红季鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、东方红 60 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红慧鑫甄选 6 个月持有期混合型证券投资基金、东方红汇享债券型证券投资基金、东方红智享三年持有期混合型证券投资基金、东方红量化选股混合型发起式证券投资基金，共计 105 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		
徐觅	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2016 年 12 月 21 日	-	16 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2016 年 12 月至今任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至 2023 年 04 月任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至 2023 年 04 月任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2017 年 09 月至 2024 年 03 月任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2017 年 09 月至 2020 年 05 月任东方红货币市场基金基金经理、2018 年 03 月至今任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 05 月至 2024 年 03 月任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018 年 10 月至今任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、2020 年 01 月至 2024 年 04 月任东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资

					基金基金经理、2020 年 07 月至 2022 年 11 月任东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金经理、2022 年 05 月至今任 东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2023 年 11 月至今任东方红 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理、2023 年 12 月至今任东方红季鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理、2024 年 01 月至今任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理。复旦大学工商管理硕士。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投资经理。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可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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，为指数投资组合因跟踪指数需要和其他组合发生的反向交易。

#### 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

债券方面，收益率一季度单边下行，二季度受央行警示长期债券风险，涨势有所放缓，上半年债市整体走牛。10 年期国债收益率期初位于 2.55%，期末下行至 2.21%，接连创出收益率新低。货币政策方面，央行采用下调存款准备金率和降低政策利率等方式，引导融资成本下行，保持流动性整体充裕。财政政策方面，超长期特别国债开始发行，大规模设备更新和消费品以旧换新政策效果逐步体现。房地产方面，以首套房首付比例降至 15%的历史低位、北京上海等一线城市放松限购为标志，地产政策不断释放宽松信号，带动一、二手房销售有所改善，但成交的持续性仍待观察。整体而言，伴随上半年各项稳定经济政策的推出和落地生效，市场从关注节奏力度逐步将关注重心转移到持续性的验证。产品操作上，我们仍然维持投资级信用债配置为主的策略。一季度将久期提升至 2.5-3 年左右，并增配了期限 3-5 年的大行二级资本债和 5-10 年利率债；二季度切换期限结构为哑铃型，调整久期至 1.5-2 年左右，将期限 3-5 年的大行二级资本债置换为 1 年左右期限，并适当提高了产品的杠杆水平。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.0724 元，份额累计净值为 1.2784 元；C 类份额净值为 1.0670 元，份额累计净值为 1.2520 元；E 类份额净值为 1.0667 元，份额累计净值为 1.0667 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 2.41%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%；C 类份额净值增长率为 2.29%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%；E 类份额净值增长率为 2.12%，同期业绩比较基准收益率为 2.13%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券方面，年中在陆家嘴论坛上，央行行长提出了货币政策框架的调整思路：淡化金融总量增速目标、明确 7 天逆回购利率主要政策利率的地位、收窄利率走廊宽度和逐步在二级市场买卖国债。这对后续研究关注的指标和投资行为范式可能产生深远的影响。海外方面，市场围绕美联储降息时机已经交易数轮，若未来美联储降息，人民币汇率端压力的缓解能为国内货币政策释放更多的操作空间。出口方面上半年是一大亮点，下半年外需的变化可能驱动后续国内财政政策向更加积极的方向转变。从产品层面，将提高组合久期的基准水平，系统性的增加对长期利率债的配置，保持投资级信用债配置为主的策略，更加灵活地运用国债期货等套保工具。

#### 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操作实务手册》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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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》及其他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本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

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 2024 年中期报告中财务指标、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：东方红益鑫纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,816,357.06	266,940.50
结算备付金		6,105,721.31	6,413,222.28
存出保证金		10,053.29	13,241.10
交易性金融资产	6.4.7.2	236,664,690.09	211,892,331.91
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		236,664,690.09	211,892,331.91
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	-	15,002,088.54
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		-	5,000,000.00
应收股利		-	-
应收申购款		69,816.48	9,690.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		244,666,638.23	238,597,515.16
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		67,504,438.36	25,476,708.39
应付清算款		511,869.55	5,000,000.00
应付赎回款		410,699.43	98,292.89



应付管理人报酬		42,984.23	53,021.50
应付托管费		14,328.06	17,673.85
应付销售服务费		24,897.43	28,262.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,543.52	3,986.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	86,063.86	161,085.00
负债合计		68,596,824.44	30,839,031.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	164,894,108.00	199,024,191.68
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	11,175,705.79	8,734,292.48
净资产合计		176,069,813.79	207,758,484.16
负债和净资产总计		244,666,638.23	238,597,515.16

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 164,894,108.00 份，其中东方红益鑫纯债债券 A 基金份额总额 22,955,133.62 份，基金份额净值 1.0724 元；东方红益鑫纯债债券 C 基金份额总额 135,881,516.27 份，基金份额净值 1.0670 元；东方红益鑫纯债债券 E 基金份额总额 6,057,458.11 份，基金份额净值 1.0667 元。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红益鑫纯债债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,380,514.46	4,686,729.15
1. 利息收入		55,496.46	117,112.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	49,684.80	41,934.96
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		5,811.66	75,177.83
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,949,467.79	3,306,670.40
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	4,950,152.64	3,317,701.90

资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-684.85	-11,031.50
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	373,687.26	1,261,891.42
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	1,862.95	1,054.54
<b>减：二、营业总支出</b>		989,911.32	1,018,405.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	294,437.43	335,074.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	98,145.81	105,928.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	166,480.54	169,776.70
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		327,589.28	301,708.19
其中：卖出回购金融资产支 出		327,589.28	301,708.19
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,474.40	5,983.81
8. 其他费用	6.4.7.23	100,783.86	99,933.40
<b>三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)</b>		4,390,603.14	3,668,323.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		4,390,603.14	3,668,323.63
<b>五、其他综合收益的税后净 额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		4,390,603.14	3,668,323.63

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东方红益鑫纯债债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	199,024,191.68	8,734,292.48	207,758,484.16
二、本期期初净资产	199,024,191.68	8,734,292.48	207,758,484.16
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-34,130,083.68	2,441,413.31	-31,688,670.37
(一)、综合收益总额	-	4,390,603.14	4,390,603.14
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-34,130,083.68	-1,949,189.83	-36,079,273.51
其中: 1. 基金申购款	125,250,685.55	7,025,648.43	132,276,333.98
2. 基金赎回款	-159,380,769.23	-8,974,838.26	-168,355,607.49
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	164,894,108.00	11,175,705.79	176,069,813.79
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	200,119,093.32	5,096,112.02	205,215,205.34
二、本期期初净资产	200,119,093.32	5,096,112.02	205,215,205.34
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-5,800,964.97	1,811,266.70	-3,989,698.27
(一)、综合收益总额	-	3,668,323.63	3,668,323.63
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-5,800,964.97	-156,616.58	-5,957,581.55
其中: 1. 基金申购款	42,771,231.11	1,304,321.05	44,075,552.16
2. 基金赎回款	-48,572,196.08	-1,460,937.63	-50,033,133.71
(三)、本期向基金份额持有人分配利	-	-1,700,440.35	-1,700,440.35

润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	194,318,128.35	6,907,378.72	201,225,507.07

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：

<u>张锋</u>	<u>汤琳</u>	<u>陈培</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方红益鑫纯债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[2016]1635 号《关于准予东方红益鑫纯债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《东方红益鑫纯债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 749,360,184.09 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(2016)第 1535 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 749,572,390.15 份基金份额,其中认购资金利息折合 212,206.06 份基金份额;其中 A 类基金份额的基金份额总额为 548,938,732.33 份,包含认购资金利息折合 161,757.87 份,C 类基金份额的基金份额总额为 200,633,657.82 份,包含认购资金利息折合 50,448.19 份。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。

根据本基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司于 2024 年 1 月 18 日发布的《关于东方红益鑫纯债债券型证券投资基金增 E 类基金份额及修改基金合同及托管协议的公告》,本基金自 2024 年 1 月 19 日(含)起增加 E 类基金份额。本基金根据申购费用与销售服务费收取方式等的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金时收取申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费,而不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额。在投资人申购基金时不收取申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费的,称为 C 类基金份额和 E 类基金份额;本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额将分别计算基金份额

净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资的具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不参与股票、权证等权益类资产的投资，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%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数(0571. CS)收益率。

#### 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操作实务手册》、《东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》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 2024 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	1,816,357.06
等于：本金	1,815,597.33
加：应计利息	759.73
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,816,357.06

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	81,898,407.44	394,138.36	82,785,888.36	493,342.56
	银行间市场	151,842,236.09	2,077,801.73	153,878,801.73	-41,236.09
	合计	233,740,643.53	2,471,940.09	236,664,690.09	452,106.47
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	233,740,643.53	2,471,940.09	236,664,690.09	452,106.47	

### 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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 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 2024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	8,490.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	8,490.00
应付利息	-
预提费用	77,573.86
合计	86,063.86

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东方红益鑫纯债债券 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,807,893.36	39,807,893.36



本期申购	4,122,981.86	4,122,981.86
本期赎回(以“-”号填列)	-20,975,741.60	-20,975,741.60
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	22,955,133.62	22,955,133.62

东方红益鑫纯债债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	159,216,298.32	159,216,298.32
本期申购	9,689,224.37	9,689,224.37
本期赎回(以“-”号填列)	-33,024,006.42	-33,024,006.42
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	135,881,516.27	135,881,516.27

东方红益鑫纯债债券 E

项目	本期 2024 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	111,438,479.32	111,438,479.32
本期赎回(以“-”号填列)	-105,381,021.21	-105,381,021.21
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	6,057,458.11	6,057,458.11

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)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

东方红益鑫纯债债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,039,106.91	840,315.00	1,879,421.91
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	1,039,106.91	840,315.00	1,879,421.91
本期利润	594,258.75	140,347.67	734,606.42
本期基金份额交易产生的变动数	-503,061.47	-449,861.33	-952,922.80
其中：基金申购款	169,341.24	103,174.95	272,516.19
基金赎回款	-672,402.71	-553,036.28	-1,225,438.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,130,304.19	530,801.34	1,661,105.53

东方红益鑫纯债债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,518,968.25	3,335,902.32	6,854,870.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,518,968.25	3,335,902.32	6,854,870.57
本期利润	3,206,833.16	334,884.68	3,541,717.84
本期基金份额交易产生的变动数	-735,727.08	-550,028.82	-1,285,755.90
其中：基金申购款	296,536.33	245,358.42	541,894.75
基金赎回款	-1,032,263.41	-795,387.24	-1,827,650.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,990,074.33	3,120,758.18	9,110,832.51

东方红益鑫纯债债券 E

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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	215,823.97	-101,545.09	114,278.88
本期基金份额交易产生的变动数	48,986.89	240,501.98	289,488.87
其中：基金申购款	3,213,221.02	2,998,016.47	6,211,237.49
基金赎回款	-3,164,234.13	-2,757,514.49	-5,921,748.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	264,810.86	138,956.89	403,767.75

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	8,822.65
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	40,778.51
其他	83.64
合计	49,684.80

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 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。

##### 6.4.7.14.2 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。

##### 6.4.7.14.3 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。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,198,393.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,751,759.61
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	4,950,152.64

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	566,885,712.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	558,162,928.95
减：应计利息总额	6,958,698.61
减：交易费用	12,325.00
买卖债券差价收入	1,751,759.61

##### 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**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
国债期货投资收益	-684.85

**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**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	373,687.26
股票投资	-
债券投资	373,687.26
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	373,687.26

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,515.95
基金转换费收入	347.00
合计	1,862.95

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,901.52
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	4,610.00
账户维护费	18,600.00
合计	100,783.86

#### 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、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、基金销售机构
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

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	222,564,631.97	100.00	188,433,831.26	94.93

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	3,183,800,000.00	99.58	1,990,212,000.00	92.82

##### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	294,437.43	335,074.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	54,449.40	82,758.24
应支付基金管理人的净管理费	239,988.03	252,316.49

注：1、根据《上海东方证券资产管理有限公司关于东方红益鑫纯债债券型证券投资基金调低基金费率、调整风险收益特征表述并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2023 年 3 月 23 日(含)的管理费率由 0.4%/年调整为 0.3%/年。

(1) 2023 年 1 月 1 日(含)至 2023 年 3 月 22 日(含)，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.4%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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。

(2) 自 2023 年 3 月 23 日(含)，本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	98,145.81	105,928.69

注：根据《上海东方证券资产管理有限公司关于东方红益鑫纯债债券型证券投资基金调低基金费率、调整风险收益特征表述并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2023 年 3 月 23 日（含）的托管费率由 0.12%/年调整为 0.10%/年。

(1) 2023 年 1 月 1 日（含）至 2023 年 3 月 22 日（含），本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.12% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.12\% \div \text{当年天数}$$

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。

(2) 自 2023 年 3 月 23 日（含），本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东方红益鑫纯债 债券 A	东方红益鑫纯债 债券 C	东方红益鑫纯债 债券 E	合计
东方证券	-	466.58	-	466.58
东证资管	-	38,087.26	1,161.19	39,248.45
工商银行	-	2,331.53	-	2,331.53
合计	-	40,885.37	1,161.19	42,046.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	东方红益鑫纯债 债券 A	东方红益鑫纯债 债券 C	东方红益鑫纯债 债券 E	合计
东方证券	-	556.59	-	556.59



东证资管	-	36,272.89	-	36,272.89
工商银行	-	1,958.89	-	1,958.89
合计	-	38,788.37	-	38,788.37

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金东方红益鑫纯债 C 基金份额的资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由东证资管计算并由登记机构支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日东方红益鑫纯债 C 基金份额的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

2、支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金东方红益鑫纯债 E 基金份额的资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由东证资管计算并由登记机构支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日东方红益鑫纯债 E 基金份额的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 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 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

##### 6.4.10.4.1 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：本基金本报告期内及上年度可比期间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。

##### 6.4.10.4.2 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：本基金本报告期内及上年度可比期间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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		本期 2024 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日
	东方红益鑫纯债债券 A	东方红益鑫纯债债券 C	东方红益鑫纯债债券 E
基金合同生效日 (2016 年 11 月 28 日)持有的基金份额	-	-	-

报告期初持有的基金份额	9,607,956.18	-	-
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	9,607,956.18	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	41.8554%	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 -
	东方红益鑫纯债债券 A	东方红益鑫纯债债券 C	东方红益鑫纯债债券 E
基金合同生效日（2016 年 11 月 28 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：1、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。

2、分类基金持有的基金份额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。

#### 6.4.10.5.2 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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,816,357.06	8,822.65	289,818.56	6,624.51

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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金支付给东证期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于2024年06月30日，本基金无应付交易手续费余额(2023年12月31日：同)。于2024年上半年，本基金当期交易手续费支出488.25元(2023年同期：31.50元)。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按协议利率计息，存出保证金不计息。于2024年06月30日，本基金存放于东证期货的结算备付金余额(不含应计利息)为2,826,576.14元，存出保证金余额为0元(2023年12月31日：结算备付金余额2,805,102.76元，存出保证金余额0元)。于报告期内，本基金存放于东证期货的结算备付金利息收入为20,802.76元(2023年同期：20,684.46元)。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：1、本基金本报告期内未进行利润分配。

2、本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项。

#### 6.4.12 期末(2024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2024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 20,004,438.36 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
1928033	19 中国银行二级 03	2024 年 7 月 1 日	103.23	25,000	2,580,645.90
2028013	20 农业银行二级 01	2024 年 7 月 1 日	101.39	100,000	10,139,049.32
2028018	20 交通银行二级	2024 年 7 月 1 日	101.44	100,000	10,144,115.62
合计				225,000	22,863,810.84

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 47,500,000.00 元，于 2024 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

#### 6.4.12.4 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。

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	21,711,866.99	12,441,429.06
合计	21,711,866.99	12,441,429.06

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

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同业存单投资。

##### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	184,448,958.71	189,232,809.70
AAA 以下	-	-
未评级	30,503,864.39	10,218,093.15
合计	214,952,823.10	199,450,902.85

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 2024 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 67,504,438.36 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，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 2024 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 2024 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 4 年 6 月	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
----------------------------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

30日							
资产							
货币资金	1,816,357.06	-	-	-	-	-	1,816,357.06
结算备付金	6,105,721.31	-	-	-	-	-	6,105,721.31
存出保证金	10,053.29	-	-	-	-	-	10,053.29
交易性金融资产	-	20,770,440.43	134,097,530.72	61,430,735.42	20,365,983.52	-	236,664,690.09
应收申购款	-	-	-	-	-	69,816.48	69,816.48
资产总计	7,932,131.66	20,770,440.43	134,097,530.72	61,430,735.42	20,365,983.52	69,816.48	244,666,638.23
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	410,699.43	410,699.43
应付管理	-	-	-	-	-	42,984.23	42,984.23



人 报 酬							
应付 托 管 费	-	-	-	-	-	14,328.06	14,328.06
应付 清 算 款	-	-	-	-	-	511,869.55	511,869.55
卖出 回 购 金 融 资 产 款	67,504,438. 36	-	-	-	-	-	67,504,438. 36
应付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	24,897.43	24,897.43
应 交 税 费	-	-	-	-	-	1,543.52	1,543.52
其 他 负 债	-	-	-	-	-	86,063.86	86,063.86
负 债 总 计	67,504,438. 36	-	-	-	-	1,092,386.0 8	68,596,824. 44
利 率 敏 感	-59,572,306 .70	20,770,440. 43	134,097,530 .72	61,430,735. 42	20,365,983. 52	-1,022,569. 60	176,069,813 .79

度 缺 口							
上 年 度 末 202 3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							
货 币 资 金	266,940.50	-	-	-	-	-	266,940.50
结 算 备 付 金	6,413,222.28	-	-	-	-	-	6,413,222.28
存 出 保 证 金	13,241.10	-	-	-	-	-	13,241.10
交 易 性 金 融 资 产	-	10,278,049.32	120,208,341.76	81,405,940.83	-	-	211,892,331.91
买 入 返 售 金 融 资 产	15,002,088.54	-	-	-	-	-	15,002,088.54
应	120.00	-	-	-	-	9,570.83	9,690.83

收申购款							
应收清算款	-	-	-	-	-	5,000,000.00	5,000,000.00
资产总计	21,695,612.42	10,278,049.32	120,208,341.76	81,405,940.83	-	5,009,570.83	238,597,515.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	98,292.89	98,292.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	53,021.50	53,021.50
应付托管费	-	-	-	-	-	17,673.85	17,673.85
应付清算款	-	-	-	-	-	5,000,000.00	5,000,000.00
卖出回购金融资产	25,476,708.39	-	-	-	-	-	25,476,708.39

款							
应付销售服务费						28,262.48	28,262.48
应交税费						3,986.89	3,986.89
其他负债						161,085.00	161,085.00
负债总计	25,476,708.39					5,362,322.61	30,839,031.00
利率敏感度缺口	-3,781,095.97	10,278,049.32	120,208,341.76	81,405,940.83		-352,751.78	207,758,484.16

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,677,855.61	1,518,153.27
2. 市场利率上升 25 个基点	-1,651,994.45	-1,499,261.56	

#### 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：本基金本报告期末及上年度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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	236,664,690.09	211,892,331.91
第三层次	-	-
合计	236,664,690.09	211,892,331.91

#### 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。

本基金本期及上年度可比期间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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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(2023 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	236,664,690.09	96.73
	其中：债券	236,664,690.09	96.73
	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	7,922,078.37	3.24
8	其他各项资产	79,869.77	0.03
9	合计	244,666,638.23	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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。

#### 7.2.2 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。

### 7.3 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。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金不参与股票投资。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金不参与股票投资。

#### 7.4.3 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。

### 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	32,075,173.25	18.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	184,448,958.71	104.76
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,002,677.26	5.68
6	中期票据	10,137,880.87	5.76
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	236,664,690.09	134.42

### 7.6 期末按公允价值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）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	240004	24 付息国债 04	200,000	20,365,983.52	11.57
2	019727	23 国债 24	115,000	11,709,189.73	6.65
3	2028023	20 招商银行永 续债 01	100,000	10,580,092.90	6.01
4	1928031	19 广发银行永 续债	100,000	10,401,442.62	5.91
5	1920059	19 江苏银行二 级	100,000	10,368,997.81	5.89

### 7.7 期末按公允价值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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期国债期货投资在一定程度上对冲了利率波动的风险，符合既定的投资政策和投资目标。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚，上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚，中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。

### 7.11.2 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

本基金不参与股票投资。

### 7.11.3 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	10,053.29
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	69,816.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,869.77

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金不参与股票投资。

#### 7.11.6 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。

## § 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 (%)
东方红益鑫纯债债券 A	489	46,943.01	9,608,923.65	41.86	13,346,209.97	58.14
东方红益鑫纯债债券 C	29,609	4,589.20	82,172,958.34	60.47	53,708,557.93	39.53
东方红益鑫纯债债券 E	4,517	1,341.04	2,983,810.24	49.26	3,073,647.87	50.74
合计	34,615	4,763.66	94,765,692.23	57.47	70,128,415.77	42.53

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	东方红益鑫纯债债券 A	15,959.95	0.07
	东方红益鑫纯债债券 C	22,975.52	0.02
	东方红益鑫纯债债券 E	1,839.33	0.03
	合计	40,774.80	0.02

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）。

### 8.3 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	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	东方红益鑫纯债债券 A	0
	东方红益鑫纯债债券 C	0
	东方红益鑫纯债债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红益鑫纯债债券 A	0
	东方红益鑫纯债债券 C	0
	东方红益鑫纯债债券 E	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红益鑫纯债债券 A	东方红益鑫纯债债券 C	东方红益鑫纯债债券 E
基金合同生效日 (2016 年 11 月 28 日) 基金份额总额	548,938,732.33	200,633,657.82	-
本报告期期初基金份额总额	39,807,893.36	159,216,298.32	-
本报告期基金总申购份额	4,122,981.86	9,689,224.37	111,438,479.32
减：本报告期基金总赎回份	20,975,741.60	33,024,006.42	105,381,021.21

额			
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,955,133.62	135,881,516.27	6,057,458.11

注：东方红益鑫纯债债券 E 基金合同生效日为 2024 年 01 月 19 日。

## § 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，基金管理人无重大人事变动。

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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 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：本报告期内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	

			(%)		(%)	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	6	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国 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	-	-	-	-	-
国投证券	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	-	-	-	-	-
上海证券	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、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；具有较强的合规风控能力、交易能力和研究服务能力；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、本基金本报告期租用券商交易单元无变更。

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 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	222,564,631.97	100.00	3,183,800,000.00	99.58	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	13,587,000.00	0.42	-	-

国投证 券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
上海证 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 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	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年1月18日
2	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年1月18日
3	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金（E类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年1月18日
4	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会规定媒介	2024年1月18日
5	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金托管协议（更新）	中国证监会规定媒介	2024年1月18日
6	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2024年第1号）	中国证监会规定媒介	2024年1月18日
7	关于东方红益鑫纯债债券型证券投资基金调整单笔申购金额限制的公告	中国证监会规定媒介	2024年1月18日
8	关于东方红益鑫纯债债券型证券投资基金增加E类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2024年1月18日
9	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024年1月22日
10	东方红益鑫纯债债券型投资基金暂停大额申购（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	2024年2月6日
11	关于东方红益鑫纯债债券型证券投资基金调整单笔申购金额限制的公告	中国证监会规定媒介	2024年2月22日
12	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2024年第2号）	中国证监会规定媒介	2024年2月28日
13	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红益鑫纯债债券型证券投资基金调低A类基金份额申购费率并修订基金招募说明书和基金产品资料概要的公告	中国证监会规定媒介	2024年2月28日
14	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年2月28日
15	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调整赎回数额限制的公告	中国证监会规定媒介	2024年2月28日

16	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
17	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
18	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 14 日
19	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 14 日
20	东方红益鑫纯债债券型证券投资基金 (E 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 14 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

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	20240426-20240630	35,630,500.03	0.00	0.00	35,630,500.03	21.6081
	2	20240228-20240415-20240425	0.00	104,209,693.43	104,209,693.43	0.00	0.0000

#### 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，分类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。
----

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红益鑫纯债债券型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红益鑫纯债债券型证券投资基金托管协议》；



- 4、东方红益鑫纯债债券型证券投资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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 30 日