

# 东方金账簿货币市场证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月二十五日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....        | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 11        |
| <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.....                 | 17        |
| 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.....             | 18        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 18        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 19        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 19        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 20        |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 20        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>21</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 21        |
| 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..... | 21        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 21        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>22</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 22        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 22        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>24</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 24        |
| 7.2 利润表.....                                 | 25        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 26        |
| 7.4 报表附注.....                                | 27        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>55</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 55        |
| 8.2 债券回购融资情况.....                            | 55        |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限.....                        | 55        |
| 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....         | 56        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 56        |
| 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....      | 57        |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....               | 57        |
| 8.8 期末按摊余成本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 .....       | 58        |
| 8.9 投资组合报告附注 .....                                 | 58        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                          | <b>62</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                        | 62        |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                       | 62        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                     | 63        |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....            | 63        |
| 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... | 63        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                         | <b>64</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                            | <b>65</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                             | 65        |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....             | 65        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                  | 65        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                               | 65        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                        | 65        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....                | 65        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                       | 65        |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                        | 66        |
| 11.9 其他重大事件 .....                                  | 66        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                    | <b>74</b> |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....           | 74        |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                            | <b>75</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                  | 75        |
| 13.2 存放地点 .....                                    | 75        |
| 13.3 查阅方式 .....                                    | 75        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 东方金账簿货币市场证券投资基金    |                    |
| 基金简称            | 东方金账簿货币            |                    |
| 基金主代码           | 400005             |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                    |
| 基金合同生效日         | 2006 年 8 月 2 日     |                    |
| 基金管理人           | 东方基金管理股份有限公司       |                    |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司       |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 4,756,995,157.29 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属分级基金的基金简称:    | 东方金账簿货币 A          | 东方金账簿货币 B          |
| 下属分级基金的交易代码:    | 400005             | 400006             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 136,603,869.99 份   | 4,620,391,287.30 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在强调本金安全性、资产充分流动性的前提下，追求稳定的当期收益。  |
| 投资策略   | 本基金以价值分析为基础，以主动式的科学投资管理为手段，把握宏观经济走向与微观经济脉搏，通过以剩余期限为核心的资产配置，充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征，追求基金资产稳定的当期收益。 |
| 业绩比较基准 | 银行税后活期利率   |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。   |

### 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      | 东方基金管理股份有限公司                        | 中国民生银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名                                  | 李景岩                  |
|         | 联系电话                                | 010-66295888         |
|         | 电子邮箱                                | xxpl@orient-fund.com |
| 客户服务电话  | 010-66578578 或<br>400-628-5888      | 95568                |
| 传真      | 010-66578700                        | 010-57093382         |
| 注册地址    | 北京市西城区锦什坊街 28 号<br>1-4 层            | 北京市西城区复兴门内大街 2 号     |
| 办公地址    | 北京市丰台区金泽路 161 号<br>院 1 号楼远洋锐中心 26 层 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号     |
| 邮政编码    | 100033                              | 100031               |
| 法定代表人   | 崔伟                                  | 高迎欣                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |  |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》   |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.orient-fund.com">http://www.orient-fund.com</a> 或<br><a href="http://www.df5888.com">http://www.df5888.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 本基金管理人及本基金托管人住所  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                            |
|--------|------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 立信会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区南京东路 61 号四层               |
| 注册登记机构 | 东方基金管理股份有限公司     | 北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层 |

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1<br>期间数据和指标 | 2021 年         |                  | 2020 年         |                  | 2019 年         |                  |
|------------------|----------------|------------------|----------------|------------------|----------------|------------------|
|                  | 东方金账簿货币 A      | 东方金账簿货币 B        | 东方金账簿货币 A      | 东方金账簿货币 B        | 东方金账簿货币 A      | 东方金账簿货币 B        |
| 本期已实现收益          | 2,843,967.66   | 154,903,551.25   | 3,113,802.48   | 164,243,650.68   | 4,027,531.44   | 163,618,517.82   |
| 本期利润             | 2,843,967.66   | 154,903,551.25   | 3,113,802.48   | 164,243,650.68   | 4,027,531.44   | 163,618,517.82   |
| 本期净值收益率          | 2.0987%        | 2.3437%          | 2.1221%        | 2.3670%          | 2.4075%        | 2.6533%          |
| 3.1.2<br>期末数据和指标 | 2021 年末        |                  | 2020 年末        |                  | 2019 年末        |                  |
|                  | 136,603,869.99 | 4,620,391,287.30 | 161,743,425.78 | 5,736,419,262.86 | 162,875,425.55 | 4,887,072,538.94 |

|              |          |          |          |          |          |          |
|--------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| 基金资产净值       |          |          |          |          |          |          |
| 期末基金份额净值     | 1.0000   | 1.0000   | 1.0000   | 1.0000   | 1.0000   | 1.0000   |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2021 年末  |          | 2020 年末  |          | 2019 年末  |          |
| 累计净值收益率      | 60.3375% | 25.1569% | 57.0417% | 22.2908% | 53.7784% | 19.4631% |

注：①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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，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本基金每日分配收益，按月结转份额。

### 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

东方金账簿货币 A

| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益率标 | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|----------|----------|------------|-----|-----|
|----|----------|----------|----------|------------|-----|-----|



|            |          | 准差②     | 率③       | 准差④     |          |         |
|------------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.5271%  | 0.0015% | 0.0882%  | 0.0000% | 0.4389%  | 0.0015% |
| 过去六个月      | 1.0151%  | 0.0013% | 0.1764%  | 0.0000% | 0.8387%  | 0.0013% |
| 过去一年       | 2.0987%  | 0.0012% | 0.3500%  | 0.0000% | 1.7487%  | 0.0012% |
| 过去三年       | 6.7756%  | 0.0016% | 1.0500%  | 0.0000% | 5.7256%  | 0.0016% |
| 过去五年       | 14.5851% | 0.0025% | 1.7500%  | 0.0000% | 12.8351% | 0.0025% |
| 自基金合同生效起至今 | 60.3375% | 0.0057% | 10.5093% | 0.0023% | 49.8282% | 0.0034% |

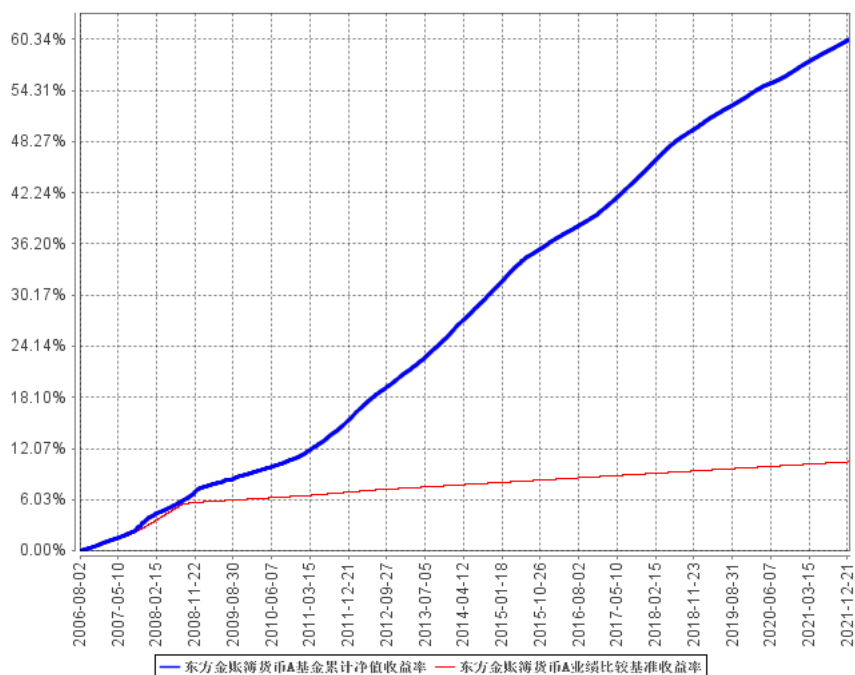
东方金账簿货币 B

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③      | ②—④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.5878%  | 0.0015%     | 0.0882%    | 0.0000%       | 0.4996%  | 0.0015% |
| 过去六个月      | 1.1372%  | 0.0013%     | 0.1764%    | 0.0000%       | 0.9608%  | 0.0013% |
| 过去一年       | 2.3437%  | 0.0012%     | 0.3500%    | 0.0000%       | 1.9937%  | 0.0012% |
| 过去三年       | 7.5459%  | 0.0016%     | 1.0500%    | 0.0000%       | 6.4959%  | 0.0016% |
| 过去五年       | 15.9658% | 0.0025%     | 1.7500%    | 0.0000%       | 14.2158% | 0.0025% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.1569% | 0.0036%     | 2.5186%    | 0.0000%       | 22.6383% | 0.0036% |

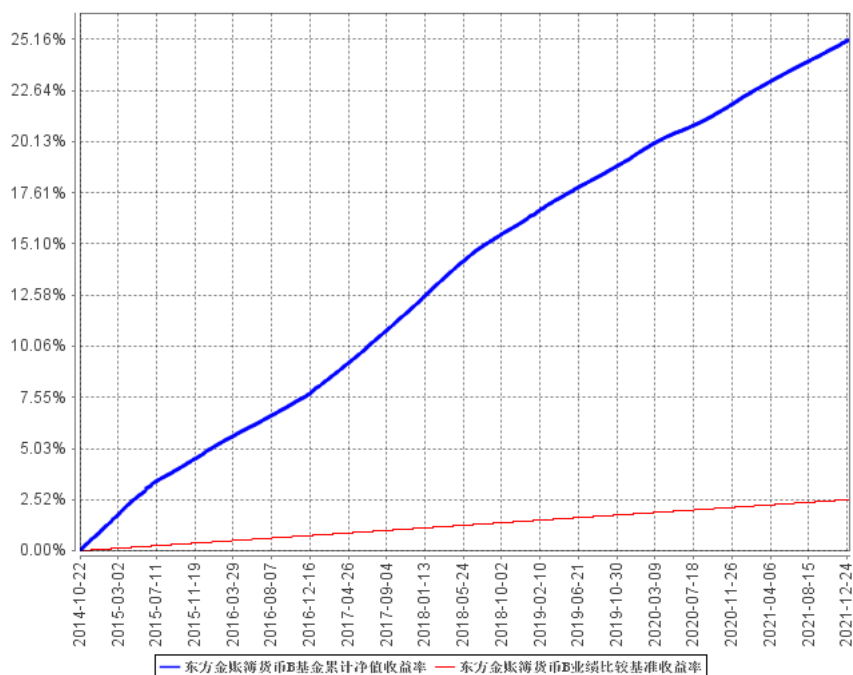
注：本基金每日分配收益，按月结转份额。

### 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

东方金账簿货币A基金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

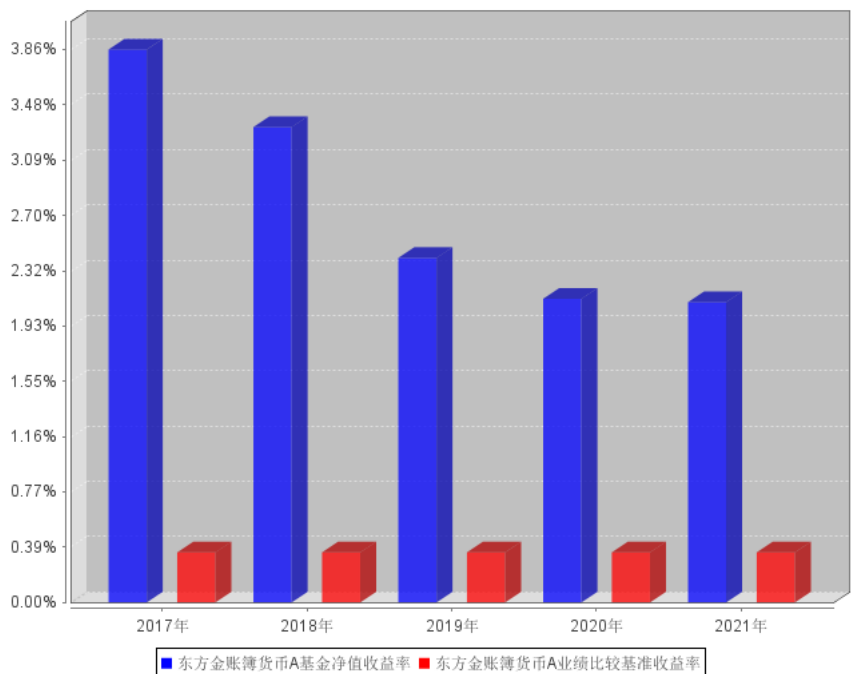


东方金账簿货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

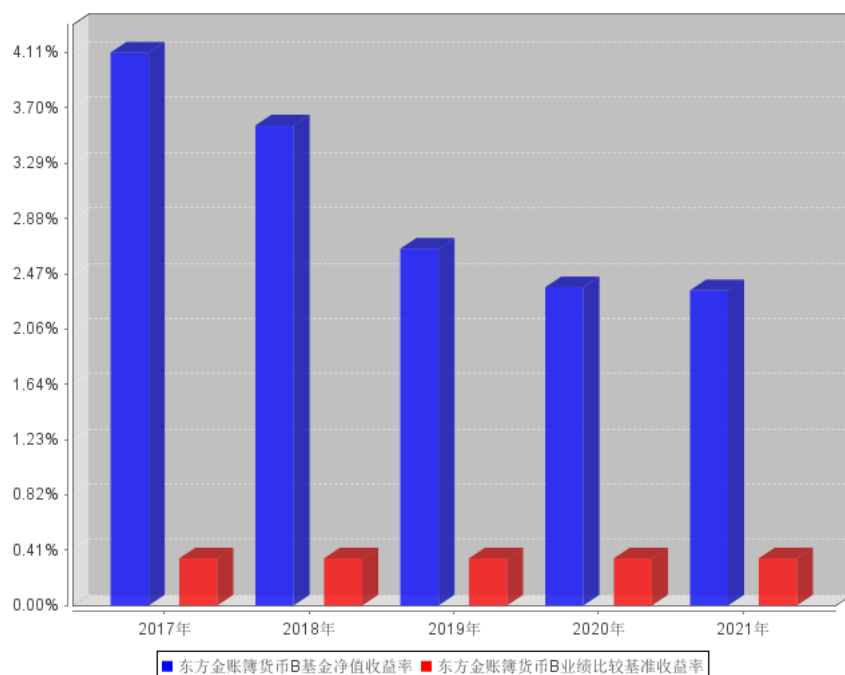


### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方金账簿货币A过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



东方金账簿货币B过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 东方金账簿货币 A |                  |                   |               |              |    |
|-----------|------------------|-------------------|---------------|--------------|----|
| 年度        | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动  | 年度利润<br>分配合计 | 备注 |
| 2021      | 5,309,282.33     | 179,390.10        | -2,644,704.77 | 2,843,967.66 |    |
| 2020      | 3,253,864.67     | 253,915.62        | -393,977.81   | 3,113,802.48 |    |
| 2019      | 4,494,503.19     | 759,678.03        | -1,226,649.78 | 4,027,531.44 |    |
| 合计        | 13,057,650.19    | 1,192,983.75      | -4,265,332.36 | 9,985,301.58 |    |

单位：人民币元

| 东方金账簿货币 B |                  |                   |              |                |    |
|-----------|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 年度        | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计   | 备注 |
| 2021      | 129,209,310.62   | 26,060,808.78     | -366,568.15  | 154,903,551.25 |    |
| 2020      | 143,038,389.12   | 19,191,399.78     | 2,013,861.78 | 164,243,650.68 |    |
| 2019      | 141,597,277.95   | 19,637,849.26     | 2,383,390.61 | 163,618,517.82 |    |
| 合计        | 413,844,977.69   | 64,890,057.82     | 4,030,684.24 | 482,765,719.75 |    |

注：本基金“每日分配收益，按月结转份额”。本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额净收益为基准，每日为基金份额持有人计算当日收益并分配，每月集中支付收益。

## § 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

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立。截至2021年12月31日，本公司注册资本3.3333亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份19200万股，持股比例57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份8100万股，持股比例24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份2700万股，持股比例8.1%；天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持有本公司股份3.37%；天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止2021年12月31日，本公司管理55只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长回报平衡混合型证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃3个月定期开

放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣利混合型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金。

#### 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 |        |  |
| 郑雪莹<br>(女士) | 本基金基金经理 | 2020 年 4 月 30 日 | -    | 6 年    | 复旦大学财务学专业硕士，6 年证券从业经历。2015 年 7 月加盟本基金管理人，曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员，东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方金元宝货币市场基金基金经理助理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理助理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理助理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金证通货币市场基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方盛 |

|                       |                                       |                        |   |             |   |
|-----------------------|---------------------------------------|------------------------|---|-------------|---|
|                       |                                       |                        |   |             | <p>世灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，现任东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。</p>  |
| <p>吴 萍 萍<br/>(女士)</p> | <p>本基金基金经理、固定收益投资部总经理，公募投资决策委员会委员</p> | <p>2021 年 5 月 13 日</p> | - | <p>10 年</p> | <p>固定收益投资部总经理，公募投资决策委员会委员。中国人民大学应用经济学硕士，10 年证券从业经历。曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015 年 11 月加盟本基金管理人，曾任固定收益投资部副总经理，东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金</p> |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>（于 2019 年 8 月 2 日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理，现任东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、东方</p> |
|--|--|--|--|---|

|               |           |                 |                |     |  |
|---------------|-----------|-----------------|----------------|-----|--|
|               |           |                 |                |     | 恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理。   |
| 李 雅 蓉<br>(女士) | 本基金基金经理助理 | 2020 年 7 月 23 日 | 2021 年 7 月 7 日 | 4 年 | 中国人民大学梳理经济专业硕士，4 年证券从业经历。2017 年加盟本基金管理人，曾任固定收益研究研究员、交易部债券交易员、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻慧纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金元宝货币市场基金基金经理助理、东方金证通货货币市场基金基金经理助理。 |

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方金账簿货币市场证券投资



基金基金合同》和其他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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），制定了公司公平交易管理制度。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易管理制度的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行T分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在同日反向交

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

2021 年债券市场走出一轮小牛市行情，尤其体现在 2 月以后，利率基本呈现下行趋势，波动率显著下降。根据 wind 数据显示，10 年国债从 2 月中最高点近 3.3%的水平下行至年底不足 2.8%，累计下行 50BP，较年初下行 38BP；10 年国开也从近 3.8%的水平下行至年底不足 3.1%，累计下行 70BP 左右，较年初下行 46BP；短端方面，Shibor 3M 收于 2.42%，较半年末基本持平，较年初下行 30BP，1Y NCD 收于 2.72%，较半年末下行 14BP，较年初下行 25BP。

报告期内，本基金规模变动较大，月末、季末等时点赎回明显；组合整体维持中性久期，在季末时点增配了 3M-6M 存单和存款，在兼顾流动性下保证了较好的收益稳定性。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为 2.0987%，业绩比较基准收益率为 0.3500%，高于业绩比较基准 1.7487%；本基金 B 类净值增长率为 2.3437%，业绩比较基准收益率为 0.3500%，高于业绩比较基准 1.9937%。

#### 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 2022 年，中美宏观政策的分化仍将对市场带来持续影响。基本面方面，对于发达海外经济体，随着 2022 年货币政策逐渐收缩、实际利率底部回升，大概率步入滞涨状态，MMT 将对通胀和需求带来一定的反噬效果。对于国内而言，整体周期领先海外，PPI 向下、CPI 向上的趋势改善下游利润空间，预计内需疲软的压力也将整体有所缓解，整体呈现弱复苏状态，预计国内 GDP 增速先下后上，整体呈现弱复苏，动能由出口向基建切换。

在面临稳增长、稳信贷的背景下，预计国内货币政策也将维持稳健偏宽松，流动性仍将维持合理充裕。短端方面，预计资金利率维持政策利率附近震荡，整体波动性降低，1Y NCD 为代表的短端资产整体低于 MLF 震荡；长端方面，预计前低后平，主要受经济节奏、政策节奏影响，同时考虑到年初财政支出力度可能加大、政府债券发行预计前置，存在一定的供给扰动，关注债券长端利率阶段性上冲等带来的交易性机会。

交易节奏而言，2022 年更倾向于利率先下后上。上半年内需惯性走低、叠加贸易顺差收窄，稳增长压力不会得到明显缓释，债市也仍将受益于相对宽松的货币金融环境；但随着内需弱复苏，下半年预计将会进入到一个宽信用、经济改善的阶段，对长端存在一定扰动。

未来，本基金将继续确保组合的流动性和收益的稳定性，防范流动性风险和信用风险，力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，定期和实时监控，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

(1) 开展对公司各项业务的日常监管业务，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的合法合规。(2) 根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强了基金投资监察力度，完善了基金投资有关控制制度。(3) 进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。(4) 注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及相关会计核算业务细则，本管理人对所管理的基金各项资产进行核算，本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下：

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营高管、分管投研高管、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益投资部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

##### 1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

##### 2. 运营部

① 自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

② 征求托管行意见并借鉴行业界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③ 根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

### 3. 投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称“停牌有价证券”）时，根据估值委员会要求和运营部的估值方案，负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当，对估值方法有失公允性的“停牌有价证券”，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

### 4. 风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末，公司已与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值（适用非货币基金）。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金应分配且已分配利润 157,747,518.91 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

## 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或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，中国民生银行股份有限公司在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、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                        |
|------------|------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                      |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                |
| 审计报告编号     | 信会师报字[2022]第 ZB30066 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|                 |   |
|-----------------|---|
| 审计报告标题          | 审计报告  |
| 审计报告收件人         | 东方金账簿货币市场证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见            | <p>我们审计了东方金账簿货币市场证券投资基金(以下简称东方金账簿基金)财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了东方金账簿基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。</p>                            |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方金账簿基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>   |
| 强调事项            | -   |
| 其他事项            | -   |
| 其他信息            | <p>东方金账簿基金的基金管理人东方基金管理股份有限公司(以下简称基金管理人)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人负责评估东方金账簿基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营</p>  |

|                 |   |     |
|-----------------|---|-----|
|                 | 假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。   |     |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东方金账簿基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方金账簿基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称       | 立信会计师事务所（特殊普通合伙）  |     |
| 注册会计师的姓名        | 朱锦梅   | 高慧丽 |
| 会计师事务所的地址       | 上海市黄浦区南京东路 61 号 4 层   |     |
| 审计报告日期          | 2022 年 3 月 24 日   |     |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 321,528,441.21                  | 450,122,271.79                   |
| 结算备付金           |            | 6,875,104.87                    | 189,764,707.13                   |
| 存出保证金           |            | 46,177.46                       | 29,950.14                        |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 3,150,165,821.09                | 3,698,489,577.63                 |
| 其中：股票投资         |            | -                               | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 3,150,165,821.09                | 3,638,457,494.50                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | 60,032,083.13                    |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 1,899,806,529.72                | 2,009,214,623.85                 |
| 应收证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 7,234,720.98                    | 17,357,382.74                    |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 2,100.00                        | 3,201.18                         |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 5,385,658,895.33                | 6,364,981,714.46                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 616,042,647.48                  | 351,899,304.05                   |
| 应付证券清算款         |            | 1,416,222.14                    | 100,000,000.00                   |
| 应付赎回款           |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 1,487,400.00                    | 1,922,457.05                     |
| 应付托管费           |            | 450,727.31                      | 582,562.73                       |
| 应付销售服务费         |            | 71,352.60                       | 93,823.41                        |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 172,334.49                      | 188,782.55                       |
| 应交税费            |            | 119,923.47                      | 230,280.61                       |
| 应付利息            |            | 25,565.87                       | 12,977.82                        |



|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利润          |          | 8,468,564.68     | 11,479,837.60    |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 409,000.00       | 409,000.00       |
| 负债合计          |          | 628,663,738.04   | 466,819,025.82   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 4,756,995,157.29 | 5,898,162,688.64 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -                | -                |
| 所有者权益合计       |          | 4,756,995,157.29 | 5,898,162,688.64 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 5,385,658,895.33 | 6,364,981,714.46 |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，东方金账簿货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 136,603,869.99 份；东方金账簿货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 4,620,391,287.30 份。东方金账簿货币份额总额合计为 4,756,995,157.29 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|---|--|
| <b>一、收入</b>           |            | 195,986,797.01                            | 205,623,658.79                                 |
| 1.利息收入                |            | 192,922,638.22                            | 205,000,510.66                                 |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11   | 19,691,271.06                             | 42,041,076.68                                  |
| 债券利息收入                |            | 130,150,792.27                            | 96,870,996.23                                  |
| 资产支持证券利息收入            |            | 795,777.49                                | 3,323,497.57                                   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 42,284,797.40                             | 62,764,940.18                                  |
| 证券出借利息收入              |            | -   | -  |
| 其他利息收入                |            | -   | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 3,064,158.79                              | 623,148.13                                     |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12   | -   | -  |
| 基金投资收益                |            | -   | -  |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13   | 3,064,158.79                              | 623,148.13                                     |
| 资产支持证券投资收益            | 7.4.7.13.3 | -   | -  |
| 贵金属投资收益               | 7.4.7.14   | -   | -  |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.15   | -   | -  |
| 股利收益                  | 7.4.7.16   | -   | -  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | -   | -  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   | -  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | -   | -  |

|                            |            |                |                |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 列)                         |            |                |                |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 38,239,278.10  | 38,266,205.63  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 22,555,120.14  | 23,866,573.71  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 6,834,884.90   | 7,232,295.02   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 1,011,378.30   | 1,073,700.45   |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 2.55           | 17,472.80      |
| 5. 利息支出                    |            | 7,333,629.62   | 5,543,793.75   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 7,333,629.62   | 5,543,793.75   |
| 6. 税金及附加                   |            | 166,673.93     | 177,408.88     |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 337,588.66     | 354,961.02     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 157,747,518.91 | 167,357,453.16 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 157,747,518.91 | 167,357,453.16 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                 |                    |
|--|--|-----------------|--------------------|
|  | 实收基金                                   | 未分配利润           | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 5,898,162,688.64                       | -               | 5,898,162,688.64   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                      | 157,747,518.91  | 157,747,518.91     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -1,141,167,531.35                      | -               | -1,141,167,531.35  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 30,922,232,762.87                      | -               | 30,922,232,762.87  |
| 2. 基金赎回款                               | -32,063,400,294.22                     | -               | -32,063,400,294.22 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                      | -157,747,518.91 | -157,747,518.91    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 4,756,995,157.29                       | -               | 4,756,995,157.29   |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                 |                    |
|--|---|-----------------|--------------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润           | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 5,049,947,964.49                            | -               | 5,049,947,964.49   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 167,357,453.16  | 167,357,453.16     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 848,214,724.15                              | -               | 848,214,724.15     |
| 其中：1. 基金申购款                            | 32,321,507,977.19                           | -               | 32,321,507,977.19  |
| 2. 基金赎回款                               | -31,473,293,253.04                          | -               | -31,473,293,253.04 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -   | -167,357,453.16 | -167,357,453.16    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 5,898,162,688.64                            | -               | 5,898,162,688.64   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘鸿鹏

刘鸿鹏

王丹丹

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东方金账簿货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2006 年 6 月 6 日中国证监会《关于同意东方金账簿货币市场证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2006】106 号）和《关于东方金账簿货币市场证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2006】146 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》自 2006 年 7 月 3 日至 2006 年 7 月 28 日公开募集设立。本基金为货币市场基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 489,924,256.22 元人民币，业经天华会计师事务所“天华验字（2006）第 58-06 号”及“天华验字（2006）第 58-07 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》于 2006 年 8 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 489,989,508.84 份基金单位，其中认购资金

利息折合 65,252.62 份基金单位。本基金的基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于：现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的并允许货币市场基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本基金于 2014 年 10 月 22 日实施分级，新增 B 类基金份额类别，基金份额分类后，在基金存续期内的任何一个开放日，若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额，并于升级次一工作日适用 B 类基金份额的相关费率，若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额，并于降级次一工作日适用 A 类基金份额的相关费率。两级基金份额分设不同的基金代码，分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

-

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成本基金的金融资产，并形成其他单位的金融负债或权益工具的合同。

##### 1. 金融资产的分类

金融资产应当在初始确认时划分为以下两类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；（2）贷款和应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资等。

本基金持有的其他金融资产包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### 2. 金融负债的分类

金融负债应当在初始确认时划分为以下两类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）其他金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。

同业存单采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。

本基金的金融负债在初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### 1. 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于交易日确认为债券投资。

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含应收利息单独核算，对于付息债券，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本。

卖出银行间同业市场交易的债券，于交易日确认债券投资收益；出售债券的成本按移动加权平均法结转。

#### 2. 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以实际成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提利息。

#### 3. 同业存单

买入同业存单时，按实际支付的全部价款入账，其中所包含应收利息作为同业存单投资成本。

卖出同业存单时，于交易日确认同业存单投资收益；出售同业存单的成本按移动加权平均法结转。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金计价采用摊余成本法，估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其收益期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率及上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；本基金金融工具的估值方法具体如下：

#### （1）银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息。

#### （2）债券投资

基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

#### （3）回购协议

①基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在回购期内逐日计提利息。

②基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在回购期内逐日计提。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产，若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值。

#### (4) 资产支持证券

基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

#### (5) 同业存单

基金持有的同业存单购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

#### (6) 其他

①为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按估值技术计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生不利影响，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的计价对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与采用影子定价计算的净值产生重大偏离时，基金管理人与基金托管人商定后按影子定价确定的公允价对其账面价值进行调整，并按影子定价进行后续计量，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。如基金份额净值恢复至 1.0000 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。

②如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

③如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额对应的金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回、转换及红利再投资引起的实收基金变动分别于基金相关活动确认日认列。

### 7.4.4.8 损益平准金

-

### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入：按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收

入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2) 债券利息收入：在实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；企业债券利息收入应按扣除代扣代缴的个人所得税之后的差额计量；

(3) 同业存单利息收入：在实际持有期内逐日计提。购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 债券投资收益，于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其债券账面价值、应收利息及相关费用的差额入账；

(6) 同业存单投资收益，于同业存单成交日确认，并按卖出同业存单成交金额与其账面价值及相关费用的差额入账；

(7) 其他收入：在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33%年费率逐日计提并确认。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率逐日计提并确认。

(3) 东方金账簿货币 A 销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率逐日计提并确认，东方金账簿货币 B 销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01%年费率逐日计提并确认。

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产款的账面价值及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

(5) 其他费用

其他费用包括基金运作过程中发生的除上述费用支出以外的其他各项费用，如注册登记费、上市年费、信息披露费用、账户服务费、持有人大会费用、审计费用、律师费用等。发生的其他费用，如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时可直接计入基金损益，如果影响基金份额净值小数点后第四位的，采用待摊或预提的方法计入基金损益。



#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) “每日分配收益，按月结转份额”。本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额净收益为基准，每日为基金份额持有人计算当日收益并分配，每月集中支付收益。基金份额持有人当日收益的精度为 0.01 元，小数点后第 3 位采用四舍五入方式，因此形成的余额再次进行分配，直到分完为止。

(2) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为基金份额持有人记正收益；若当日净收益小于零时，为基金份额持有人记负收益；若当日净收益等于零时，基金份额持有人不记收益。

(3) 本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计收益只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，基金份额持有人可通过赎回基金份额获得现金收益；若基金份额持有人在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则将缩减基金份额持有人基金份额。若基金份额持有人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清，若收益为负值，则从基金份额持有人赎回基金款中扣除。

(4) 本基金收益每月集中结转一次。基金管理人正式运作基金财产不满一个月的，不结转。每月结转日，若基金份额持有人账户的当前累计收益为正收益，则该基金份额持有人账户的本基金份额体现为增加；反之，则该基金份额持有人账户的本基金份额体现为减少。

除了每月的例行收益结转外，每天对涉及有赎回、转换等交易的账户进行提前收益支付，将赎回或转换的基金份额对应的待支付收益提前支付给基金份额持有人。

(5) 每份基金份额享有同等分配权。

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。

(7) 在不影响基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可酌情调整本基金收益分配方式，此项调整并不需要基金份额持有人大会决议通过。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、[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]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、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、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。

3、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。

4、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。

5、基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 1,528,441.21            | 100,122,271.79           |
| 定期存款           | 320,000,000.00          | 350,000,000.00           |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 200,000,000.00          | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | -                       | 50,000,000.00            |
| 存款期限 3 个月以上    | 120,000,000.00          | 300,000,000.00           |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计：            | 321,528,441.21          | 450,122,271.79           |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日  |                  |              |          |
|----|--------|--------------------------|------------------|--------------|----------|
|    |        | 摊余成本                     | 影子定价             | 偏离金额         | 偏离度      |
| 债券 | 交易所市场  | 44,099,177.06            | 44,104,813.00    | 5,635.94     | 0.0001%  |
|    | 银行间市场  | 3,106,066,644.03         | 3,107,753,000.00 | 1,686,355.97 | 0.0355%  |
|    | 合计     | 3,150,165,821.09         | 3,151,857,813.00 | 1,691,991.91 | 0.0356%  |
|    | 资产支持证券 | -                        | -                | -            | 0.0000%  |
|    | 合计     | 3,150,165,821.09         | 3,151,857,813.00 | 1,691,991.91 | 0.0356%  |
| 项目 |        | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                  |              |          |
|    |        | 摊余成本                     | 影子定价             | 偏离金额         | 偏离度      |
| 债券 | 交易所市场  | 100,000,000.00           | 100,070,000.00   | 70,000.00    | 0.0012%  |
|    | 银行间市场  | 3,538,457,494.50         | 3,540,573,000.00 | 2,115,505.50 | 0.0359%  |
|    | 合计     | 3,638,457,494.50         | 3,640,643,000.00 | 2,185,505.50 | 0.0371%  |
|    | 资产支持证券 | 60,032,083.13            | 59,874,000.00    | -158,083.13  | -0.0027% |
|    | 合计     | 3,698,489,577.63         | 3,700,517,000.00 | 2,027,422.37 | 0.0344%  |

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

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | 1,899,806,529.72         | -         |
| 合计    | 1,899,806,529.72         | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 100,000,000.00           | -         |
| 银行间市场 | 1,909,214,623.85         | -         |
| 合计    | 2,009,214,623.85         | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 235.35                  | 3,211.95                 |
| 应收定期存款利息   | 109,777.88              | 790,278.44               |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 34,053.80               | 245,328.60               |
| 应收债券利息     | 5,887,489.21            | 13,978,763.19            |
| 应收资产支持证券利息 | -                       | 1,421,852.05             |
| 应收买入返售证券利息 | 1,203,143.94            | 917,935.01               |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 应收出借证券利息   | -                       | -                        |
| 其他         | 20.80                   | 13.50                    |
| 合计         | 7,234,720.98            | 17,357,382.74            |

注：其他为应收结算保证金利息。

### 7.4.7.6 其他资产

本期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 银行间市场应付交易费用 | 172,334.49              | 188,782.55               |
| 合计          | 172,334.49              | 188,782.55               |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | -                        |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 预提费用        | 409,000.00              | 409,000.00               |
| 合计          | 409,000.00              | 409,000.00               |

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和银行间债券账户维护费。

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 东方金账簿货币 A     |  |                 |
|---------------|--|-----------------|
| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额            |
| 上年度末          | 161,743,425.78                         | 161,743,425.78  |
| 本期申购          | 296,389,272.72                         | 296,389,272.72  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -321,528,828.51                        | -321,528,828.51 |
| 本期末           | 136,603,869.99                         | 136,603,869.99  |

金额单位：人民币元

| 东方金账簿货币 B |  |      |
|-----------|--|------|
| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |      |
|           | 基金份额（份）                                | 账面金额 |

|               |                    |                    |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 上年度末          | 5,736,419,262.86   | 5,736,419,262.86   |
| 本期申购          | 30,625,843,490.15  | 30,625,843,490.15  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -31,741,871,465.71 | -31,741,871,465.71 |
| 本期末           | 4,620,391,287.30   | 4,620,391,287.30   |

注：本期申购包含红利再投资、基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 东方金账簿货币 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           | 2,843,967.66  | -     | 2,843,967.66  |
| 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        | -2,843,967.66 | -     | -2,843,967.66 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

单位：人民币元

| 东方金账簿货币 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           | 154,903,551.25  | -     | 154,903,551.25  |
| 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        | -154,903,551.25 | -     | -154,903,551.25 |
| 本期末            | -               | -     | -               |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 17,754.29             | 59,361.88             |
| 定期存款利息收入  | 19,437,618.86         | 40,671,447.48         |
| 其他存款利息收入  | -                     | -                     |
| 结算备付金利息收入 | 235,531.50            | 1,310,040.28          |

|    |               |               |
|----|---------------|---------------|
| 其他 | 366.41        | 227.04        |
| 合计 | 19,691,271.06 | 42,041,076.68 |

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,064,158.79                    | 623,148.13                           |
| 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                            | 3,064,158.79                    | 623,148.13                           |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|-------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 21,283,661,506.36               | 22,087,989,935.20                    |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 21,184,330,765.99               | 21,993,590,635.45                    |
| 减：应收利息总额                | 96,266,581.58                   | 93,776,151.62                        |
| 买卖债券差价收入                | 3,064,158.79                    | 623,148.13                           |

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月<br>31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 62,273,586.00                   | 175,165,065.00                       |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 60,000,000.00                   | 170,000,000.00                       |

|            |              |              |
|------------|--------------|--------------|
| 减：应收利息总额   | 2,273,586.00 | 5,165,065.00 |
| 资产支持证券投资收益 | 0.00         | 0.00         |

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | -                               | -                                    |
| 银行间市场交易费用 | 2.55                            | 17,472.80                            |
| 交易基金产生的费用 | -                               | -                                    |
| 其中：申购费    | -                               | -                                    |
| 赎回费       | -                               | -                                    |
| 合计        | 2.55                            | 17,472.80                            |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2021年1月1日至2021年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 |
|------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 80,000.00                       | 80,000.00                            |



|         |            |            |
|---------|------------|------------|
| 信息披露费   | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | -          | -          |
| 账户维护费用  | 32,700.00  | 37,200.00  |
| 银行费用    | 104,888.66 | 117,761.02 |
| 合计      | 337,588.66 | 354,961.02 |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系            |
|----------------------|--------------------|
| 东北证券股份有限公司           | 本基金管理人股东、销售机构      |
| 东方基金管理股份有限公司         | 本基金管理人、注册登记机构、直销机构 |
| 中国民生银行股份有限公司         | 本基金托管人、销售机构        |
| 渤海国际信托股份有限公司         | 本基金管理人股东           |
| 河北国控资本管理有限公司         | 本基金管理人股东           |
| 天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙） | 本基金管理人股东           |
| 天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙） | 本基金管理人股东           |
| 天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙） | 本基金管理人股东           |
| 东方汇智资产管理有限公司         | 本基金管理人下属子公司        |

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                      |
|------------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|            | 成交金额                        | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 |
| 东北证券股份有限公司 | 875,573,620.61              | 100.00%              | 549,562,775.64                   | 100.00%              |

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                            | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                            |
|------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------------|----------------------------|
|            | 回购成交金额                      | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                           | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 |
| 东北证券股份有限公司 | 10,592,842,000.00           | 100.00%                    | 953,884,000.00                   | 100.00%                    |

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月<br>31日 |
|----|---------------------------------|--------------------------------------|
|    |                                 |                                      |

|                 |               |               |
|-----------------|---------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 22,555,120.14 | 23,866,573.71 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,536,316.64  | 2,726,209.13  |

注：①计提标准：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，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上月基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,834,884.90                     | 7,232,295.02                     |

注：①计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。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

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，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上月基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 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                               |            |            |
|----------------|----------------------------------|------------|------------|
|                | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |            |            |
|                | 东方金账簿货币 A                        | 东方金账簿货币 B  | 合计         |
| 东方基金管理股份有限公司   | 36,560.18                        | 532,838.63 | 569,398.81 |
| 中国民生银行股份有限公司   | 1,646.95                         | 373.88     | 2,020.83   |

|                |                       |            |            |
|----------------|-----------------------|------------|------------|
| 东北证券股份有限公司     | 3.65                  | -          | 3.65       |
| 合计             | 38,210.78             | 533,212.51 | 571,423.29 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间               |            |            |
|                | 2020年1月1日至2020年12月31日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费      |            |            |
|                | 东方金账簿货币 A             | 东方金账簿货币 B  | 合计         |
| 东方基金管理股份有限公司   | 31,154.65             | 558,954.53 | 590,109.18 |
| 中国民生银行股份有限公司   | 1,735.87              | 528.84     | 2,264.71   |
| 东北证券股份有限公司     | 72.05                 | -          | 72.05      |
| 合计             | 32,962.57             | 559,483.37 | 592,445.94 |

注：①计提标准：东方金账簿货币 A 销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提，东方金账簿货币 B 销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计算，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上月基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金营销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期                    |        |      |       |      |                |           |
|-----------------------|--------|------|-------|------|----------------|-----------|
| 2021年1月1日至2021年12月31日 |        |      |       |      |                |           |
| 银行间市场交易的各关联方名称        | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购          |           |
|                       | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出      |
| 中国民生银行股份有限公司          | -      | -    | -     | -    | 486,400,000.00 | 52,708.93 |
| 上年度可比期间               |        |      |       |      |                |           |
| 2020年1月1日至2020年12月31日 |        |      |       |      |                |           |
| 银行间市场                 | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购          |           |

| 交易的各关联方名称    | 基金买入 | 基金卖出          | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出      |
|--------------|------|---------------|------|------|----------------|-----------|
| 中国民生银行股份有限公司 | -    | 49,891,641.30 | -    | -    | 845,050,000.00 | 52,276.30 |

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                 |
|---------------------------|-----------------------------|-----------------|
|                           | 东方金账簿货币 A                   | 东方金账簿货币 B       |
| 基金合同生效日（2006年8月2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              | -                           | 167,950,314.86  |
| 报告期间因拆分变动份额               | -                           | -               |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额            | -                           | -167,950,314.86 |
| 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       | -                           | 0.00%           |

| 项目                        | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                 |
|---------------------------|----------------------------------|-----------------|
|                           | 东方金账簿货币 A                        | 东方金账簿货币 B       |
| 基金合同生效日（2006年8月2日）持有的基金份额 | -                                | -               |
| 报告期初持有的基金份额               | -                                | 17,000,000.00   |
| 报告期间申购/买入总份额              | -                                | 150,965,637.03  |
| 报告期间因拆分变动份额               | -                                | -               |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额            | -                                | -167,965,637.03 |

|                         |   |       |
|-------------------------|---|-------|
| 报告期末持有的基金份额             | - | -     |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | - | 0.00% |

注：上述关联方投资本基金时，按照本基金基金合同、招募说明书约定的费率标准收取相应的手续费，并履行了信息披露义务。

#### 7.4.10.4.2 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

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。

#### 7.4.10.5 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                    |              | 上年度可比期间               |              |
|--------------|-----------------------|--------------|-----------------------|--------------|
|              | 2021年1月1日至2021年12月31日 |              | 2020年1月1日至2020年12月31日 |              |
|              | 期末余额                  | 当期利息收入       | 期末余额                  | 当期利息收入       |
| 中国民生银行股份有限公司 | 1,528,441.21          | 2,686,058.12 | 100,122,271.79        | 2,621,597.58 |

注：当期利息收入包括由关联方保管的活期存款、定期存款和清算备付金产生的利息收入。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 东方金账簿货币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 |
|--------------|---------------|---------------|--------------|----|
| 5,309,282.33 | 179,390.10    | -2,644,704.77 | 2,843,967.66 | -  |

##### 东方金账簿货币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 |
|----------------|---------------|-------------|----------------|----|
| 129,209,310.62 | 26,060,808.78 | -366,568.15 | 154,903,551.25 | -  |

注：本基金“每日分配收益，按月结转份额”。本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额净收益为基准，每日为基金份额持有人计算当日收益并分配，每月集中支付收益。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 582, 242, 647. 48 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            |
|-----------|---------------|----------------|---------|-----------------|-------------------|
| 112171821 | 21 宁波银行 CD288 | 2022 年 1 月 4 日 | 99. 17  | 383, 000. 00    | 37, 983, 186. 67  |
| 112177877 | 21 中原银行 CD425 | 2022 年 1 月 4 日 | 99. 35  | 1, 000, 000. 00 | 99, 353, 250. 14  |
| 210206    | 21 国开 06      | 2022 年 1 月 4 日 | 100. 04 | 300, 000. 00    | 30, 011, 614. 86  |
| 210301    | 21 进出 01      | 2022 年 1 月 4 日 | 100. 03 | 100, 000. 00    | 10, 003, 062. 40  |
| 112182748 | 21 徽商银行 CD080 | 2022 年 1 月 4 日 | 99. 43  | 700, 000. 00    | 69, 598, 471. 99  |
| 219954    | 21 贴现国债 54    | 2022 年 1 月 4 日 | 99. 78  | 500, 000. 00    | 49, 888, 652. 54  |
| 112171857 | 21 贵阳银行 CD101 | 2022 年 1 月 4 日 | 99. 14  | 10, 000. 00     | 991, 353. 14      |
| 112174183 | 21 宁波银行 CD322 | 2022 年 1 月 4 日 | 99. 66  | 473, 000. 00    | 47, 140, 636. 97  |
| 112114078 | 21 江苏银行 CD078 | 2022 年 1 月 4 日 | 98. 56  | 431, 000. 00    | 42, 480, 405. 68  |
| 190303    | 19 进出 03      | 2022 年 1 月 4 日 | 100. 06 | 200, 000. 00    | 20, 012, 944. 71  |
| 219949    | 21 贴现国债 49    | 2022 年 1 月 4 日 | 99. 90  | 200, 000. 00    | 19, 980, 804. 46  |
| 2103688   | 21 进出 688     | 2022 年 1 月 4 日 | 99. 88  | 500, 000. 00    | 49, 940, 219. 08  |
| 219955    | 21 贴现国债 55    | 2022 年 1 月 4 日 | 99. 72  | 500, 000. 00    | 49, 862, 082. 73  |
| 112184568 | 21 贵阳银行 CD070 | 2022 年 1 月 4 日 | 98. 51  | 1, 000, 000. 00 | 98, 508, 696. 51  |
| 合计        |               |                |         | 6, 297, 000     | 625, 755, 381. 88 |

### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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 33,800,000.00 元,于 2022 年 1 月 4 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括:信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系,确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险,从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和监察稽核部组成的风险管理组织体系,该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别,事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券;本基金持有一家上市公司的证券市值不超过基金资产净值的百分之十,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外,本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,发生违约风险的可能性很低;本基金也可在银行间同业市场进行交易,在交易前均会对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                    | 180,000,582.86           |
| A-1 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 825,919,977.82          | 859,023,796.41           |
| 合计     | 825,919,977.82          | 1,039,024,379.27         |



注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                    | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                    | 0.00                     |

#### 7.4.13.2.3 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                    | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                    | 0.00                     |

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                    | 0.00                     |
| AAA 以下 | 0.00                    | 100,000,000.00           |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                    | 100,000,000.00           |

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、短期融资券、超短期融资券及同业存单等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                    | 60,032,083.13            |
| AAA 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                    | 60,032,083.13            |

### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 1,990,749,312.11        | 1,935,186,729.66         |
| AAA 以下 | 59,697,973.32           | 184,212,310.11           |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 2,050,447,285.43        | 2,119,399,039.77         |

注：上述同业存单按主体评级列示。

### 7.4.13.3 流动性风险

所谓流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大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，除在本报告（7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦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。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，保持组合必要的流动性和可变现能力，未发生流动性风险。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和负债不计息，持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 6 个月以内           | 6 个月-1 年       | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息          | 合计               |
|-------------------------|------------------|----------------|-------|-------|--------------|------------------|
| 资产                      |                  |                |       |       |              |                  |
| 银行存款                    | 321,528,441.21   | -              | -     | -     | -            | 321,528,441.21   |
| 结算备付金                   | 6,875,104.87     | -              | -     | -     | -            | 6,875,104.87     |
| 存出保证金                   | 46,177.46        | -              | -     | -     | -            | 46,177.46        |
| 交易性金融资产-股票投资            | -                | -              | -     | -     | 0.00         | 0.00             |
| 交易性金融资产-债券投资            | 2,923,044,670.93 | 227,121,150.16 | 0.00  | 0.00  | -            | 3,150,165,821.09 |
| 交易性金融资产-资产支持<br>证券投资    | 0.00             | 0.00           | 0.00  | 0.00  | -            | 0.00             |
| 买入返售金融资产                | 1,899,806,529.72 | -              | -     | -     | -            | 1,899,806,529.72 |
| 应收证券清算款                 | -                | -              | -     | -     | 0.00         | 0.00             |
| 应收利息                    | -                | -              | -     | -     | 7,234,720.98 | 7,234,720.98     |
| 应收股利                    | -                | -              | -     | -     | 0.00         | 0.00             |
| 应收申购款                   | -                | -              | -     | -     | 2,100.00     | 2,100.00         |
| 资产总计                    | 5,151,300,924.19 | 227,121,150.16 | 0.00  | 0.00  | 7,236,820.98 | 5,385,658,895.33 |
| 负债                      |                  |                |       |       |              |                  |
| 卖出回购金融资产款               | 616,042,647.48   | -              | -     | -     | -            | 616,042,647.48   |
| 应付赎回款                   | -                | -              | -     | -     | 0.00         | 0.00             |
| 应付管理人报酬                 | -                | -              | -     | -     | 1,487,400.00 | 1,487,400.00     |
| 应付托管费                   | -                | -              | -     | -     | 450,727.31   | 450,727.31       |
| 应付交易费用                  | -                | -              | -     | -     | 172,334.49   | 172,334.49       |
| 应付销售服务费                 | -                | -              | -     | -     | 71,352.60    | 71,352.60        |
| 应交税费                    | -                | -              | -     | -     | 119,923.47   | 119,923.47       |
| 应付利息                    | -                | -              | -     | -     | 25,565.87    | 25,565.87        |
| 其他负债                    | -                | -              | -     | -     | 8,877,564.68 | 8,877,564.68     |
| 应付证券清算款                 | -                | -              | -     | -     | 1,416,222.14 | 1,416,222.14     |

|                          |                  |                |       |       |                 |                  |
|--------------------------|------------------|----------------|-------|-------|-----------------|------------------|
| 负债总计                     | 616,042,647.48   | 0.00           | 0.00  | 0.00  | 12,621,090.56   | 628,663,738.04   |
| 利率敏感度缺口                  | 4,535,258,276.71 | 227,121,150.16 | 0.00  | 0.00  | -5,384,269.58   | 4,756,995,157.29 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | 6 个月以内           | 6 个月-1 年       | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息             | 合计               |
| 资产                       |                  |                |       |       |                 |                  |
| 银行存款                     | 450,122,271.79   | -              | -     | -     | -               | 450,122,271.79   |
| 结算备付金                    | 189,764,707.13   | -              | -     | -     | -               | 189,764,707.13   |
| 存出保证金                    | 29,950.14        | -              | -     | -     | -               | 29,950.14        |
| 交易性金融资产-股票投资             | -                | -              | -     | -     | 0.00            | 0.00             |
| 交易性金融资产-债券投资             | 3,468,244,204.05 | 170,213,290.45 | 0.00  | 0.00  | -               | 3,638,457,494.50 |
| 交易性金融资产-资产支持<br>证券投资     | 60,032,083.13    | 0.00           | 0.00  | 0.00  | -               | 60,032,083.13    |
| 买入返售金融资产                 | 2,009,214,623.85 | -              | -     | -     | -               | 2,009,214,623.85 |
| 应收证券清算款                  | -                | -              | -     | -     | 0.00            | 0.00             |
| 应收利息                     | -                | -              | -     | -     | 17,357,382.74   | 17,357,382.74    |
| 应收股利                     | -                | -              | -     | -     | 0.00            | 0.00             |
| 应收申购款                    | -                | -              | -     | -     | 3,201.18        | 3,201.18         |
| 资产总计                     | 6,177,407,840.09 | 170,213,290.45 | 0.00  | 0.00  | 17,360,583.92   | 6,364,981,714.46 |
| 负债                       |                  |                |       |       |                 |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 351,899,304.05   | -              | -     | -     | -               | 351,899,304.05   |
| 应付赎回款                    | -                | -              | -     | -     | 0.00            | 0.00             |
| 应付管理人报酬                  | -                | -              | -     | -     | 1,922,457.05    | 1,922,457.05     |
| 应付托管费                    | -                | -              | -     | -     | 582,562.73      | 582,562.73       |
| 应付交易费用                   | -                | -              | -     | -     | 188,782.55      | 188,782.55       |
| 应付销售服务费                  | -                | -              | -     | -     | 93,823.41       | 93,823.41        |
| 应交税费                     | -                | -              | -     | -     | 230,280.61      | 230,280.61       |
| 应付利息                     | -                | -              | -     | -     | 12,977.82       | 12,977.82        |
| 其他负债                     | -                | -              | -     | -     | 11,888,837.60   | 11,888,837.60    |
| 应付证券清算款                  | -                | -              | -     | -     | -100,000,000.00 | 100,000,000.00   |
| 负债总计                     | 351,899,304.05   | 0.00           | 0.00  | 0.00  | 114,919,721.77  | 466,819,025.82   |
| 利率敏感度缺口                  | 5,825,508,536.04 | 170,213,290.45 | 0.00  | 0.00  | -97,559,137.85  | 5,898,162,688.64 |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |  |                             |                        |
|----|--|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响 |                             |                        |
| 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（2021 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下调 0.25%   | 1,125,226.15                | 1,324,947.59           |
|    | 市场利率上调 0.25%   | -2,777,066.10               | -3,723,200.51          |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险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市场价格风险，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |               | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | -                       | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                       | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产-债券投资  | 3,150,165,821.09        | 66.22         | 3,638,457,494.50         | 61.69         |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                       | -             | -                        | -             |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                       | -             | -                        | -             |
| 其他            | -                       | -             | 60,032,083.13            | 1.02          |
| 合计            | 3,150,165,821.09        | 66.22         | 3,698,489,577.63         | 62.71         |

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |  |                             |                        |
|----|--|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动                           |                             |                        |
|    | Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步 |                             |                        |
|    | 假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动                              |                             |                        |
| 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（2021 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 沪深 300 指数下跌 5%   | 0.00                        | 0.00                   |
|    | 沪深 300 指数上涨 5%   | 0.00                        | 0.00                   |

#### **7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

本基金在 95%的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 114,321.12 元，占基金资产净值比例为 0.00%；上年度末本基金风险价值为 186,136.68 元，占基金资产净值比例为 0.00%。

#### **7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截止本年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资            | 3,150,165,821.09 | 58.49         |
|    | 其中:债券             | 3,150,165,821.09 | 58.49         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 1,899,806,529.72 | 35.28         |
|    | 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      | 328,403,546.08   | 6.10          |
| 4  | 其他各项资产            | 7,282,998.44     | 0.14          |
| 5  | 合计                | 5,385,658,895.33 | 100.00        |

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%) |                |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 5.64           |                |
|    | 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 | 616,042,647.48 | 12.95          |
|    | 其中:买断式回购融资   | -              | -              |

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 59 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 86 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 41 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 120 天的情况。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 48.77               | 12.98               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 13.99               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | 20.95               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天(含)—120 天          | 15.88               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天(含)—397 天(含)      | 13.47               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 113.06              | 12.98               |

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 摊余成本             | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | 163,830,716.79   | 3.44          |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 109,967,841.05   | 2.31          |
|    | 其中：政策性金融债 | 109,967,841.05   | 2.31          |
| 4  | 企业债券      | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | 825,919,977.82   | 17.36         |
| 6  | 中期票据      | -                | -             |
| 7  | 同业存单      | 2,050,447,285.43 | 43.10         |
| 8  | 其他        | -                | -             |
| 9  | 合计        | 3,150,165,821.09 | 66.22         |



|    |                      |   |   |
|----|----------------------|---|---|
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |
|----|----------------------|---|---|

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 债券数量(张)   | 摊余成本           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 112121452 | 21 渤海银行 CD452  | 2,400,000 | 238,943,501.87 | 5.02          |
| 2  | 112192580 | 21 天津银行 CD038  | 1,150,000 | 114,561,828.72 | 2.41          |
| 3  | 112177877 | 21 中原银行 CD425  | 1,000,000 | 99,353,250.14  | 2.09          |
| 4  | 112119340 | 21 恒丰银行 CD340  | 1,000,000 | 99,135,769.16  | 2.08          |
| 5  | 112119401 | 21 恒丰银行 CD401  | 1,000,000 | 98,674,779.45  | 2.07          |
| 6  | 112184568 | 21 贵阳银行 CD070  | 1,000,000 | 98,508,696.51  | 2.07          |
| 7  | 112119182 | 21 恒丰银行 CD182  | 900,000   | 89,601,324.95  | 1.88          |
| 8  | 012105138 | 21 城投公路 SCP003 | 800,000   | 79,986,222.28  | 1.68          |
| 9  | 012103908 | 21 物产中大 SCP008 | 800,000   | 79,975,432.16  | 1.68          |
| 10 | 012105286 | 21 物产中大 SCP009 | 800,000   | 79,901,606.77  | 1.68          |

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况     |
|-------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | -        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0825%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0716% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0453%  |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 8.8 期末按摊余成本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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

### 8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有 21 渤海银行 CD452(112121452), 发行人渤海银行股份有限公司(以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责, 被中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行处罚。公司目前经营一切正常, 上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 21 天津银行 CD038(112192580), 发行人天津银行股份有限公司(以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责, 被中国银行保险监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常, 上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 21 中原银行 CD425(112177877), 发行人中原银行股份有限公司(以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责, 被中国银行保险监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常, 上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 21 恒丰银行 CD340(112119340)、21 恒丰银行 CD401(112119401)、21 恒丰银行 CD182(112119182), 发行人徽商银行股份有限公司(以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责, 被中国银行保险监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常, 上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 21 贵阳银行 CD070(112184568), 发行人贵阳银行股份有限公司(以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责, 被中国银行保险监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常, 上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 21 物产中大 SCP008(012103908)、21 物产中大 SCP009(012105286), 发行人物产中大集团股份有限公司(以下简称“公司”), 受到行政处罚。因未依法履行其他职责, 公司

高管廖建新被上海证券交易所于 2021 年 07 月 08 日依据相关法规给予:监管关注处分决定。公司目前经营一切正常,上述处罚不会对正常经营造成影响。

**本基金决策依据及投资程序:**

(1) 研究:本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台,由研究部负责,采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势进行分析,深入研究国家宏观经济走势、政策走向和利率变化趋势;通过对信用利差的分析判断,可转债的投资价值分析等,深入研究各类债券合理的投资价值。在全面深入研究的基础上,提出大类资产配置建议、目标久期建议、类属资产配置建议等。

(2) 资产配置决策:投资决策委员会依据上述研究报告,对基金的资产配置比例、目标久期设定等提出指导性意见。基金经理基于投研部门的投资建议,根据自己对未来一段时期内宏观经济走势的基本判断,对基金资产的投资,制定月度资产配置和久期设置计划,并报投资决策委员会审批,审批通过,方可按计划执行。

(3) 组合构建:大类资产配置比例范围及目标久期设定范围确定后,基金经理参考研究员的投资建议,结合自身的研究判断,决定具体的投资品种并决定买卖时机,其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。

(4) 交易执行:交易管理部负责具体的交易执行,依据基金经理的指令,制定交易策略,统一执行证券投资组合计划,进行具体品种的交易。

(5) 风险监控:本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控,定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况,责令投资不规范的基金经理进行检讨,并及时调整。

(6) 风险绩效评估:风险管理部定期和不定期对基金的投资进行风险绩效评估,并提供相关报告,使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略,并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整和优化投资组合。

(7) 组合调整:基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化,以及组合风险与绩效的评估结果,结合基金申购和赎回的现金流量情况,对投资组合进行动态调整,使之不断得到优化。

本基金投资 21 渤海银行 CD452 主要基于以下原因:

21 渤海银行 CD452 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 21 天津银行 CD038 主要基于以下原因：

21 天津银行 CD038 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 21 中原银行 CD425 主要基于以下原因：

21 中原银行 CD425 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 21 恒丰银行 CD340、21 恒丰银行 CD401、21 恒丰银行 CD182 主要基于以下原因：

21 恒丰银行 CD340、21 恒丰银行 CD401、21 恒丰银行 CD182 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 21 贵阳银行 CD070 主要基于以下原因：

21 贵阳银行 CD070 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 21 物产中大 SCP008、21 物产中大 SCP009 主要基于以下原因：

公司为浙江省最大的贸易企业，A 股上市公司，获得浙江省政府的大力支持，具有区域优势，经营规模、经济效益及综合实力等处于全国前列，经营稳定，同时公司融资渠道畅通，有良好的银企关系，备用流动性充足，偿债风险可控，具备一定投资价值。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 46,177.46 |

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | -            |
| 3 | 应收利息    | 7,234,720.98 |
| 4 | 应收申购款   | 2,100.00     |
| 5 | 其他应收款   | -            |
| 6 | 待摊费用    | -            |
| 7 | 其他      | -            |
| 8 | 合计      | 7,282,998.44 |

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别      | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额     | 持有人结构            |         |                |        |
|-----------|----------|---------------|------------------|---------|----------------|--------|
|           |          |               | 机构投资者            |         | 个人投资者          |        |
|           |          |               | 持有份额             | 占总份额比例  | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 东方金账簿货币 A | 20,587   | 6,635.44      | 22,807,107.71    | 16.70%  | 113,796,762.28 | 83.30% |
| 东方金账簿货币 B | 56       | 82,506,987.27 | 4,620,391,287.30 | 100.00% | -              | -      |
| 合计        | 20,643   | 230,441.08    | 4,643,198,395.01 | 97.61%  | 113,796,762.28 | 2.39%  |

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别      | 持有份额(份)        | 占总份额比例 |
|----|------------|----------------|--------|
| 1  | 券商委托资金     | 406,871,654.27 | 8.55%  |
| 2  | 信托公司资管资金   | 303,072,480.36 | 6.37%  |
| 3  | 银行委托资金     | 300,847,183.77 | 6.32%  |
| 4  | 其他机构客户委托资金 | 296,787,545.54 | 6.24%  |
| 5  | 银行委托资金     | 292,705,485.38 | 6.15%  |
| 6  | 信托公司委托资金   | 221,571,493.22 | 4.66%  |
| 7  | 券商委托资金     | 205,858,737.81 | 4.33%  |
| 8  | 银行委托资金     | 200,000,000.00 | 4.20%  |
| 9  | 保险公司资管资金   | 200,000,000.00 | 4.20%  |

|    |        |                |       |
|----|--------|----------------|-------|
| 10 | 券商资管资金 | 150,000,000.00 | 3.15% |
|----|--------|----------------|-------|

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别      | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 东方金账簿货币 A | 111,163.93 | 0.08%    |
|                  | 东方金账簿货币 B | 0.00       | 0.00%    |
|                  | 合计        | 111,163.93 | 0.00%    |

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别      | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 东方金账簿货币 A | 0                 |
|                                | 东方金账簿货币 B | 0                 |
|                                | 合计        | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 东方金账簿货币 A | 0                 |
|                                | 东方金账簿货币 B | 0                 |
|                                | 合计        | 0                 |

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

无。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                               | 东方金账簿货币 A      | 东方金账簿货币 B         |
|-------------------------------|----------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2006 年 8 月 2 日）基金份额总额 | 489,989,508.84 | -                 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 161,743,425.78 | 5,736,419,262.86  |
| 本报告期基金总申购份额                   | 296,389,272.72 | 30,625,843,490.15 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                 | 321,528,828.51 | 31,741,871,465.71 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）      | -              | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 136,603,869.99 | 4,620,391,287.30  |

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，无涉及基金管理人的重大人事变动。

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2021 年 11 月 19 日公告，根据工作需要，任命崔岩女士担任本公司资产托管部总经理，负责资产托管部相关工作。

2022 年 2 月 12 日，基金管理人发布了《东方基金管理股份有限公司高级管理人员变更公告》，自 2022 年 2 月 11 日起许文波先生担任公司副总经理、权益投资总监、基金经理。上述人员的变更已报北京监管局及中国证券投资基金业协会备案。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 80,000.00 元；截至 2021 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 14 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人未受到监管部门稽查或处罚。

本报告期内托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

|            | 数量 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 |   |
|------------|----|------|--------------|----|------------|---|
| 东北证券股份有限公司 | 2  | -    | -            | -  | -          | - |

注：（1）交易单元的选择标准和程序：

券商选择标准：①资金雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

（2）本报告期内本基金租用的券商交易单元未发生变更。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 债券交易           |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|            | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东北证券股份有限公司 | 875,573,620.61 | 100.00%      | 10,592,842,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 11.9 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  | 东方基金管理股份有限公司年度最后一日基金净值公告 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站      | 2021 年 1 月 1 日 |
| 2  | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告    | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 1 月 4 日 |

|    |  |   |                 |
|----|--|---|-----------------|
| 3  | 关于旗下部分基金参与中国银行申购以及定期定额投资费率优惠活动的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 1 月 4 日  |
| 4  | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2020 年第 4 季度报告                     | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 1 月 21 日 |
| 5  | 关于旗下部分基金与农业银行基金定投手续费率优惠活动的公告                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 1 月 28 日 |
| 6  | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告 202101                       | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 2 月 1 日  |
| 7  | 关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告                     | 基金管理人网站                                     | 2021 年 2 月 8 日  |
| 8  | 东方金账簿货币市场证券投资基金春节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告               | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 2 月 8 日  |
| 9  | 东方金账簿货币市场证券投资基金春节前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告               | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 2 月 8 日  |
| 10 | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告 202101                       | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 3 月 1 日  |
| 11 | 关于旗下部分基金参与济安财富（北京）基金销售有限公司费率优惠活动的公告                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 6 日  |
| 12 | 关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为旗下部分基金销售机构的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 9 日  |
| 13 | 关于增加北京度小满基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 11 日 |
| 14 | 关于旗下部分基金参与宁波银行同业易管家平台费率优惠活动的公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 17 日 |
| 15 | 关于增加宁波银行股份有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 17 日 |
| 16 | 关于旗下部分基金参与安信证                                      | 中国证券报、上海证券报、证                               | 2021 年 3 月 17 日 |

|    |   |   |                 |
|----|---|---|-----------------|
|    | 券股份有限公司费率优惠活动的公告                          | 券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站              |                 |
| 17 | 东方基金关于开展直销中心基金转换申购补差费用优惠活动                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 23 日 |
| 18 | 关于东方基金在直销中心（含网上交易）开展部分基金赎回费率优惠活动的公告       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 24 日 |
| 19 | 东方基金管理股份有限公司上海分公司迁址公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 26 日 |
| 20 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2020 年年度报告                | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 3 月 26 日 |
| 21 | 东方基金管理股份有限公司关于对旗下基金持有的债券调整估值的公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 27 日 |
| 22 | 关于旗下部分基金继续参与中国银行部分渠道申购费率和全渠道定投费率优惠活动的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 23 | 东方金账簿货币市场证券投资基金清明节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告     | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 3 月 31 日 |
| 24 | 东方金账簿货币市场证券投资基金清明节前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告     | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 3 月 31 日 |
| 25 | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告                     | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 4 月 1 日  |
| 26 | 关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务并参与定投费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 4 月 1 日  |
| 27 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2021 年第 1 季度报告            | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 4 月 21 日 |
| 28 | 东方金账簿货币市场证券投资基金劳动节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告     | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 4 月 28 日 |
| 29 | 东方金账簿货币市场证券投资基金劳动节前暂停代销机构申                | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 4 月 28 日 |

|    |   |   |                 |
|----|---|---|-----------------|
|    | 购及转换转入业务的公告                                       |   |                 |
| 30 | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告                             | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 5 月 1 日  |
| 31 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2021 年临时公告_基金经理变更公告               | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 5 月 13 日 |
| 32 | 关于增加上海爱建基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 5 月 13 日 |
| 33 | 东方金账簿货币市场证券投资基金基金产品资料概要(更新)                       | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 5 月 14 日 |
| 34 | 东方金账簿货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(2021 年第 1 号)             | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 5 月 14 日 |
| 35 | 关于旗下部分基金参与吉林银行基金申购及定投手续费率优惠活动的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 5 月 28 日 |
| 36 | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益兑付公告                             | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 6 月 1 日  |
| 37 | 东方金账簿货币市场证券投资基金端午节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告             | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 6 月 9 日  |
| 38 | 东方金账簿货币市场证券投资基金端午节前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告             | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 6 月 9 日  |
| 39 | 关于增加展恒为东方基金旗下部分产品的销售机构同时开通定期定额投资、转换业务的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 6 月 22 日 |
| 40 | 关于旗下部分基金继续参与交通银行基金申购及定投申购费率优惠活动的公告                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 6 月 29 日 |
| 41 | 关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 6 月 29 日 |
| 42 | 关于旗下部分基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 6 月 29 日 |
| 43 | 东方金账簿货币市场证券投资                                     | 证券时报、基金管理人网站及                               | 2021 年 7 月 1 日  |

|    |   |   |                 |
|----|---|---|-----------------|
|    | 基金收益兑付公告  | 中国证监会基金电子披露网站                               |                 |
| 44 | 关于增加中国人寿保险股份有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告 | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 7 月 6 日  |
| 45 | 关于旗下部分基金参与招商银行股份有限公司申购费率优惠的公告                     | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 7 月 20 日 |
| 46 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2021 年第 2 季度报告                    | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 7 月 21 日 |
| 47 | 关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司等六家销售机构申购费率优惠的公告              | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 7 月 28 日 |
| 48 | 关于中国工商银行股份有限公司开通东方基金管理股份有限公司旗下开放式基金定投及转换业务的公告     | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 7 月 29 日 |
| 49 | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告                             | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 8 月 2 日  |
| 50 | 关于旗下部分基金参与兴业银行股份有限公司申购费率优惠的公告                     | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 8 月 6 日  |
| 51 | 关于旗下部分基金参与喜鹊财富基金销售有限公司等两家销售机构申购费率优惠的公告            | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 8 月 10 日 |
| 52 | 关于在方正证券股份有限公司开通旗下部分基金定投及转换业务并参加其费率优惠活动的公告         | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 8 月 17 日 |
| 53 | 关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购费率优惠的公告                   | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 8 月 21 日 |
| 54 | 关于旗下部分基金参与华夏银行股份有限公司申购费率优惠的公告                     | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 8 月 23 日 |
| 55 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2021 年中期报告                        | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 8 月 26 日 |
| 56 | 东方金账簿货币市场证券投资                                     | 证券时报、基金管理人网站及                               | 2021 年 9 月 1 日  |

|    |   |   |                 |
|----|---|---|-----------------|
|    | 基金收益支付公告  | 中国证监会基金电子披露网站                               |                 |
| 57 | 关于旗下部分基金参与中国中金财富证券有限公司申购费率优惠的公告                           | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 9 月 3 日  |
| 58 | 关于旗下部分基金参与中国建设银行股份有限公司申购费率优惠的公告                           | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 9 月 4 日  |
| 59 | 关于调整停牌股票(000959)估值方法的公告                                   | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 9 月 8 日  |
| 60 | 关于增加上海万得基金销售有限公司为东方基金旗下部分开放式基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与费率优惠活动的公告 | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 9 月 8 日  |
| 61 | 关于旗下部分基金参与农业银行股份有限公司申购费率优惠的公告                             | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 9 月 9 日  |
| 62 | 关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司申购费率优惠的公告                             | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 9 月 9 日  |
| 63 | 东方金账簿货币市场证券投资基金中秋节前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告                     | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 9 月 15 日 |
| 64 | 东方金账簿货币市场证券投资基金中秋节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告                     | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 9 月 15 日 |
| 65 | 东方金账簿货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(2021 年第 2 号)                     | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 9 月 15 日 |
| 66 | 东方金账簿货币市场证券投资基金基金产品资料概要(更新)                               | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 9 月 15 日 |
| 67 | 关于旗下部分基金参与国金证券股份有限公司等四家销售机构申购费率优惠的公告                      | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 9 月 16 日 |
| 68 | 关于在海通证券股份有限公司开通旗下部分基金定投业务并参加其费率优惠活动的公告                    | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子     | 2021 年 9 月 16 日 |

|    |  | 披露网站  |                  |
|----|--|---|------------------|
| 69 | 东方金账簿货币市场证券投资基金国庆节前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告                  | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 9 月 28 日  |
| 70 | 东方金账簿货币市场证券投资基金国庆节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告                  | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 9 月 28 日  |
| 71 | 关于旗下部分基金参与中国光大银行股份有限公司申购费率优惠的公告                        | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 9 月 29 日  |
| 72 | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益兑付公告                                  | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 10 月 8 日  |
| 73 | 关于旗下部分基金参与海银基金销售有限公司费率优惠活动的公告                          | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 10 月 18 日 |
| 74 | 关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告                      | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 10 月 18 日 |
| 75 | 关于增加泰信财富基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与费率优惠活动的公告 | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 10 月 21 日 |
| 76 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2021 年第 3 季度报告                         | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                       | 2021 年 10 月 26 日 |
| 77 | 关于旗下部分基金参与中信证券股份有限公司等四家销售机构申购费率优惠的公告                   | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 10 月 26 日 |
| 78 | 关于增加华泰期货有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加费率优惠的公告           | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 10 月 28 日 |
| 79 | 关于旗下部分基金参与交通银行申购费率优惠的公告                                | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 10 月 30 日 |
| 80 | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告                                  | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 11 月 1 日  |
| 81 | 关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司费率                             | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理                  | 2021 年 11 月 1 日  |



|    |   |   |                  |
|----|---|---|------------------|
|    | 优惠活动的公告                                       | 人网站及中国证监会基金电子披露网站                           |                  |
| 82 | 关于旗下部分基金参与深圳市新兰德证券投资咨询有限公司等 39 家销售机构费率优惠活动的公告 | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 11 月 5 日  |
| 83 | 关于旗下部分基金参与上海证券有限责任公司等四家销售机构申购费率优惠的公告          | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 11 月 9 日  |
| 84 | 关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司等 7 家销售机构费率优惠活动的公告    | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 11 月 16 日 |
| 85 | 关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告              | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 11 月 18 日 |
| 86 | 关于增加上海陆金所基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构                  | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 11 月 19 日 |
| 87 | 东方金账簿货币市场证券投资基金收益支付公告                         | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 12 月 1 日  |
| 88 | 东方基金管理股份有限公司关于办公地址变更的公告                       | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 12 月 4 日  |
| 89 | 关于旗下部分基金参与邮储银行申购费率优惠的公告                       | 上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 12 月 25 日 |
| 90 | 东方金账簿货币市场证券投资基金元旦前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告          | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 12 月 29 日 |
| 91 | 东方金账簿货币市场证券投资基金元旦后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告          | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站                  | 2021 年 12 月 29 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 一、《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》
- 二、《东方金账簿货币市场证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）查阅。

东方基金管理股份有限公司

2022 年 3 月 25 日