

# 东方红聚利债券型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16        |
| 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       | 16        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16        |
| 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 | 16        |
| 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      | 16        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 17        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 19        |
| 7.2 利润表                                 | 20        |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表                        | 21        |
| 7.4 报表附注                                | 25        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>57</b> |

|                                                    |           |
|----------------------------------------------------|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                               | 57        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                         | 58        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....            | 58        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                          | 58        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                         | 59        |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....           | 59        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....        | 59        |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....        | 59        |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....           | 59        |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                    | 59        |
| 8.11 投资组合报告附注 .....                                | 60        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                         | <b>63</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                        | 63        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                     | 63        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....             | 63        |
| 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... | 64        |
| <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>64</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                             | 64        |
| 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 .....             | 64        |
| 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 其他重大事件 .....                                  | 68        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                   | <b>72</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 .....           | 72        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                          | 72        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                           | <b>72</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                  | 72        |
| 13.2 存放地点 .....                                    | 72        |
| 13.3 查阅方式 .....                                    | 72        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 东方红聚利债券型证券投资基金     |                    |
| 基金简称            | 东方红聚利债券            |                    |
| 基金主代码           | 007262             |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                    |
| 基金合同生效日         | 2019 年 9 月 6 日     |                    |
| 基金管理人           | 上海东方证券资产管理有限公司     |                    |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司         |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 3,075,605,542.10 份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 东方红聚利债券 A          | 东方红聚利债券 C          |
| 下属分级基金的交易代码     | 007262             | 007263             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,031,109,456.01 份 | 1,044,496,086.09 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                    |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的基础上谨慎投资，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。                                                                      |
| 投资策略   | 本基金充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产配置进行动态管理。综合信用分析、久期控制、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，同时关注一级市场投资机会，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准=中债综合全价指数收益率*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率（税后）*5%。                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金是一只债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。                                                                        |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人          | 基金托管人         |
|---------|------|----------------|---------------|
| 名称      |      | 上海东方证券资产管理有限公司 | 招商银行股份有限公司    |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 周陶             | 张燕            |
|         | 联系电话 | 021-53950806   | 0755-83199084 |

|        |                              |                        |
|--------|------------------------------|------------------------|
| 电子邮箱   | service@dfham.com            | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | 4009200808                   | 95555                  |
| 传真     | 021-63326381                 | 0755-83195201          |
| 注册地址   | 上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层    | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 办公地址   | 上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 邮政编码   | 200010                       | 518040                 |
| 法定代表人  | 杨斌                           | 缪建民                    |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                               |
|--------|----------------------|------------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司       | 北京市西城区太平桥大街 17 号                   |

# § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.         | 2022 年         |                | 2021 年        |               | 2020 年        |               |
|--------------|----------------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 1 期间数据和指标    | 东方红聚利债券 A      | 东方红聚利债券 C      | 东方红聚利债券 A     | 东方红聚利债券 C     | 东方红聚利债券 A     | 东方红聚利债券 C     |
| 本期已实现收益      | 34,477,906.51  | 12,745,592.93  | 43,933,332.98 | 18,411,306.89 | 80,697,607.11 | 11,740,613.13 |
| 本期利润         | -39,707,721.47 | -32,761,840.16 | 74,639,552.89 | 32,881,717.23 | 43,478,227.04 | 7,976,529.16  |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0232        | -0.0360        | 0.1323        | 0.1112        | 0.0588        | 0.0890        |
| 本期加权         | -1.83%         | -2.87%         | 10.88%        | 9.07%         | 5.49%         | 8.37%         |

|                                  |                  |                  |                  |                  |                |               |
|----------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|---------------|
| 平均<br>净值<br>利润<br>率              |                  |                  |                  |                  |                |               |
| 本期<br>基金<br>份额<br>净值<br>增长<br>率  | -0.93%           | -1.33%           | 14.35%           | 13.90%           | 5.88%          | 5.45%         |
| 3.1.<br>2 期<br>末数<br>据和<br>指标    | 2022 年末          |                  | 2021 年末          |                  | 2020 年末        |               |
| 期末<br>可供<br>分配<br>利润             | 473,010,678.10   | 225,917,127.10   | 289,210,078.15   | 175,128,341.87   | 43,164,621.97  | 2,398,844.05  |
| 期末<br>可供<br>分配<br>基金<br>份额<br>利润 | 0.2329           | 0.2163           | 0.2114           | 0.2001           | 0.1054         | 0.0995        |
| 期末<br>基金<br>资产<br>净值             | 2,543,340,776.67 | 1,290,561,807.26 | 1,729,151,803.11 | 1,096,078,658.49 | 452,642,712.55 | 26,505,479.50 |
| 期末<br>基金<br>份额<br>净值             | 1.2522           | 1.2356           | 1.2640           | 1.2523           | 1.1054         | 1.0995        |
| 3.1.<br>3 累<br>计期<br>末指<br>标     | 2022 年末          |                  | 2021 年末          |                  | 2020 年末        |               |
| 基金<br>份额<br>累计<br>净值<br>增长<br>率  | 25.22%           | 23.56%           | 26.40%           | 25.23%           | 10.54%         | 9.95%         |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红聚利债券 A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -1.31%       | 0.31%               | -0.55%             | 0.07%                 | -0.76% | 0.24% |
| 过去六个月          | -2.00%       | 0.24%               | 0.16%              | 0.06%                 | -2.16% | 0.18% |
| 过去一年           | -0.93%       | 0.22%               | 0.56%              | 0.06%                 | -1.49% | 0.16% |
| 过去三年           | 19.94%       | 0.29%               | 2.66%              | 0.06%                 | 17.28% | 0.23% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 25.22%       | 0.28%               | 3.04%              | 0.06%                 | 22.18% | 0.22% |

东方红聚利债券 C

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -1.41%       | 0.31%               | -0.55%             | 0.07%                 | -0.86% | 0.24% |
| 过去六个月          | -2.20%       | 0.24%               | 0.16%              | 0.06%                 | -2.36% | 0.18% |
| 过去一年           | -1.33%       | 0.22%               | 0.56%              | 0.06%                 | -1.89% | 0.16% |
| 过去三年           | 18.50%       | 0.29%               | 2.66%              | 0.06%                 | 15.84% | 0.23% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 23.56%       | 0.28%               | 3.04%              | 0.06%                 | 20.52% | 0.22% |

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率(税后)\*5%。



本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,  $t$  日收益率 (benchmark $_t$ ) 按下列公式计算:

$$\text{benchmark}_t = 95\% \times [\text{t 日中债综合全价指数} / (\text{t-1 日中债综合全价指数}) - 1] + 5\% \times (\text{t 日同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率 (税后)} / 365)$$

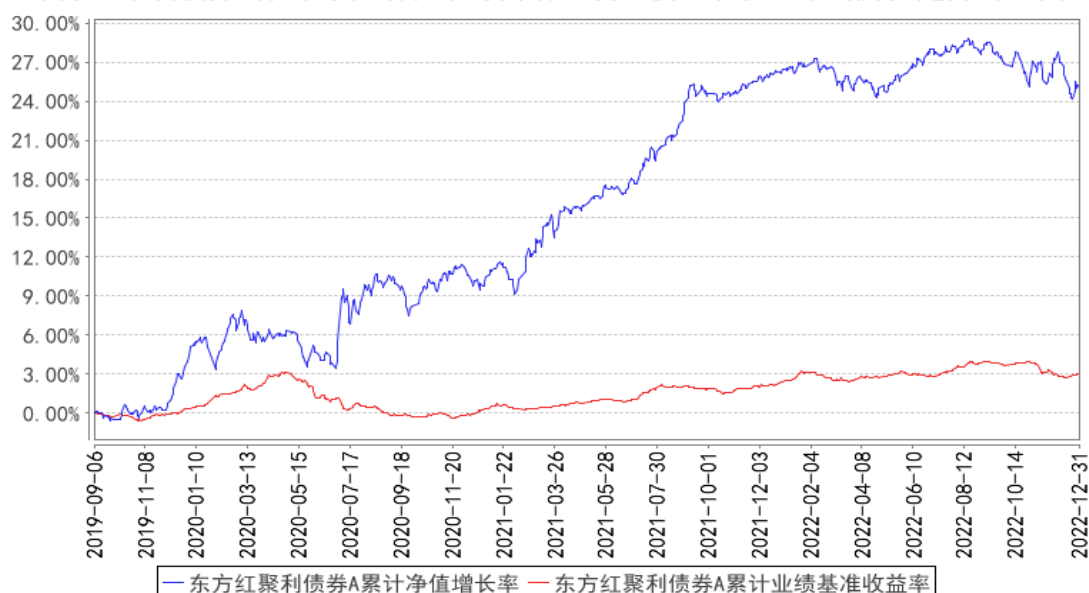
期间  $T$  日收益率 (benchmark $_T$ ) 按下列公式计算:

$$\text{benchmark}_T = [\prod (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$
, 其中  $t=1, 2, 3, \dots, T$ ,  $T$  表示时间截至日;

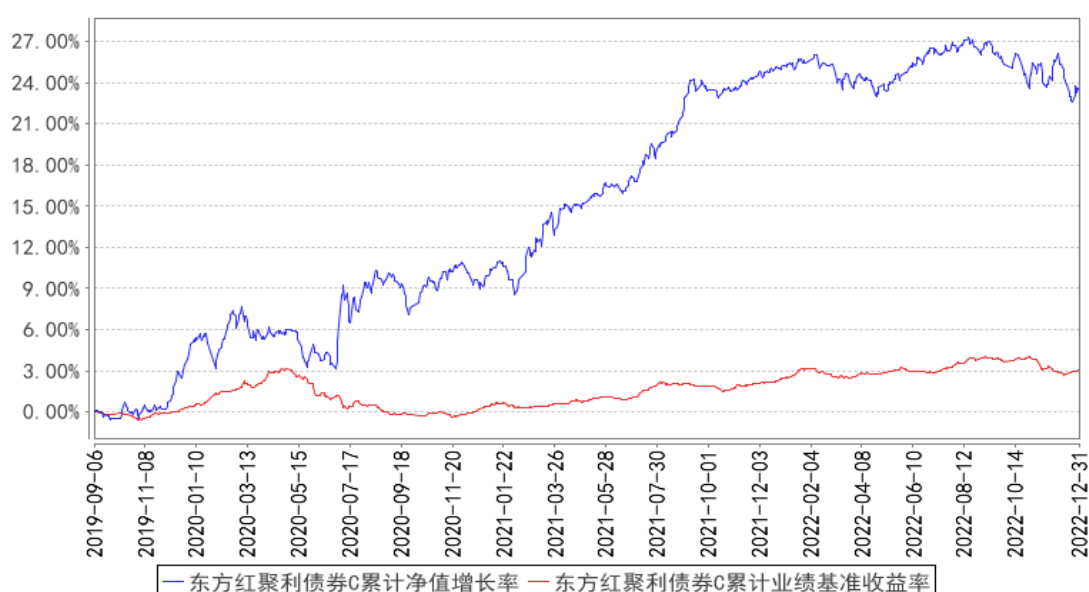
$\prod (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $(1 + \text{benchmark}_t)$  的数学连乘。

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

东方红聚利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

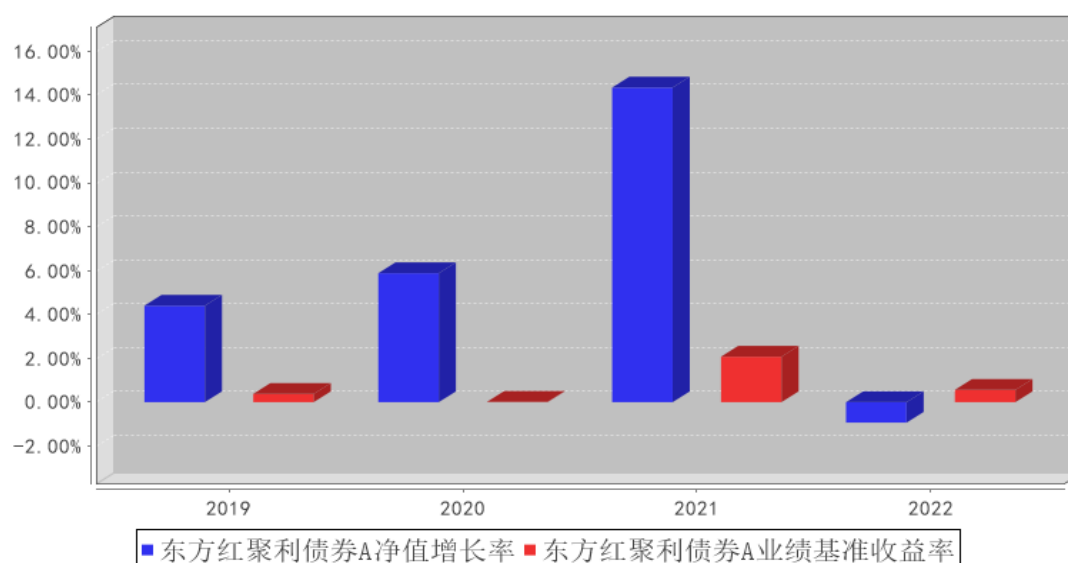


东方红聚利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

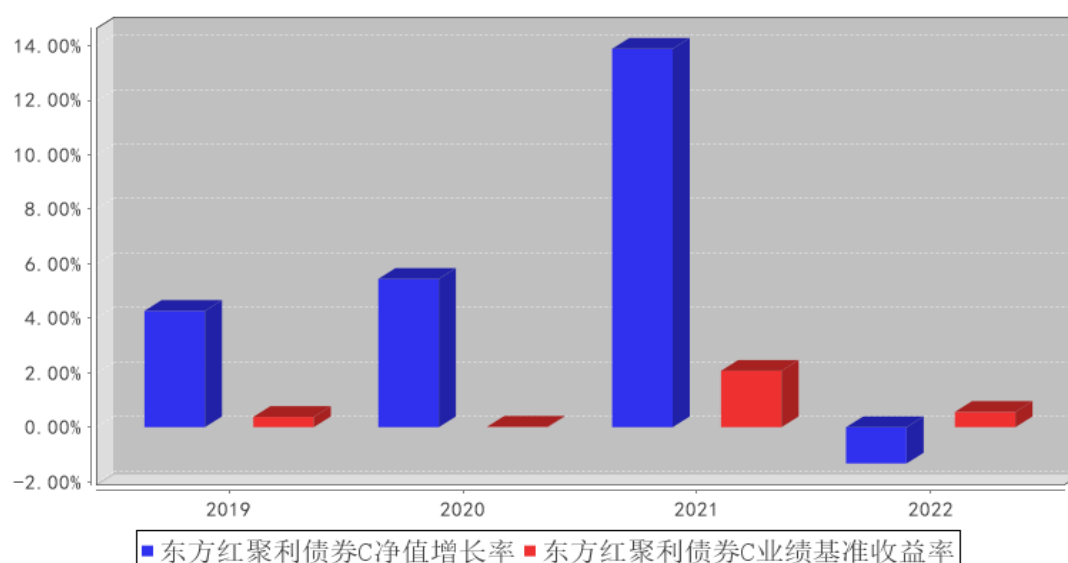


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红聚利债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



东方红聚利债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日期为 2019 年 9 月 6 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自2020年以来未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金、东

方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红新海混合型证券投资基金、东方红新源三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金、东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红智华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启兴三年持有期混合型证券投资基金、东方红智选三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿和三年定期开放混合型证券投资基金、东方红中证东方红红利低波动指数证券投资基金、东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金、东方红 ESG 可持续投资混合型证券投资基金、东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红医疗升级股票型发起式证券投资基金、东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红短债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、东方红中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金共计 87 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名    | 职务               | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                |
|-------|------------------|-----------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------|
|       |                  | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                   |
| 孔 令 超 | 上海东方证券资产管理有限公司固定 | 2019 年 9 月 6 日  | -    | 11 年   | 上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部总经理、基金经理，2016 年 08 月至今任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2016 年 08 |

|  |                |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--|----------------|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 收益研究部 总经理、基金经理 |  |  |  | 月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2018 年 03 月至今任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 05 月至今任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018 年 06 月至今任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 06 月至今任东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2018 年 07 月至今任东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理、2019 年 09 月至今任 东方红聚利债券型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至 2021 年 12 月任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。北京大学金融学硕士。曾任平安证券有限责任公司总部综合研究所策略研究员，国信证券股份有限公司经济研究所策略研究研究员。具备证券投资基金从业资格。 |
|--|----------------|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理本报告期内未兼任私募资产管理计划投资经理。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露

露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统内的公平交易模块进行交易执行和分配，风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析，校验公平交易执行情况。对于同向交易，风险管理部侧重于对公司管理的不同产品（包含了公募产品、私募产品）的整体收益率差异、投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录，在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差按两两组合进行显著性检验，并根据显著性检验结果，对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录，通过逐笔检查或抽样分析的方法，分析相应交易行为的公平性。对于反向交易，原则上禁止组合间的日内反向交易，完全按照有关指数构成比例进行投资的投资组合除外。如有投资策略或流动性等特殊需要的，需由投资经理提供投资依据，经投资决策委员会审慎审批后留档备查。报告期内未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理本报告期内未兼任私募资产管理计划投资经理。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品一直偏重于挖掘可转债资产的投资机会。2022 年转债市场表现不佳，中证转债指数下跌 10.02%。由于转债在 2022 年初整体估值偏高，本产品在年初的转债持仓水平处于较低区间。随着转债投资价值的提升，本产品全年逐渐增加了转债的配置比例，转债的持仓比例在四个季度呈现出逐季递增的状态。除转债外，债券方面的持仓仍然为利率债和短久期高等级信用债。另外，考虑对利率水平和转债估值的担忧，本产品自二季度开始，逐渐增加了国债期货的空头头寸，对

组合的利率敞口进行一定程度的套保。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金 A 类份额净值为 1.2522 元,份额累计净值为 1.2522 元;C 类份额净值为 1.2356 元,份额累计净值为 1.2356 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-0.93%,同期业绩比较基准收益率为 0.56%;C 类份额净值增长率为-1.33%,同期业绩比较基准收益率为 0.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,由于宏观环境的变化,我们相对更看好 2023 年的权益市场,转债会有更多的投资机会。过去两年,转债市场一直受到居高不下的估值困扰,但目前估值水平也已经相对合理,更具投资价值。从结构上看,我们主要关注以下几类转债机会:一是一些市场关注度较高的行业或者优质公司对应的转债,但这类转债普遍估值偏高,我们会从中自下而上选择一些品种,但考虑较高的估值,组合层面会控制这类转债的配置比例;二是一些关注度相对偏低的行业或公司,其转债估值水平也相对更低,我们会从中采取主动或者量化组合的方式选择一些品种进行一定比例的配置;另外,一些大盘转债,如券商、银行等行业,目前的转债估值对于这些行业的潜在弹性并没有充分定价,目前也具备更高的配置价值。除转债外,债券配置上仍然会主要配置利率债和高等级信用债,并且考虑转债本身的特性,本产品仍然持有一部分国债期货的空头套保。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司日常监察稽核工作主要由合规稽核部和风险管理部根据职责分工开展,2022 年开展了如下主要工作:

在合规管理履职方面:(1)切实履行日常合规管理职责,包括合规审查、合规宣导、合规培训、合规报告、合规咨询、合规检查/稽核、监管沟通与配合;(2)持续加强员工执业行为管理,包括持续督促和指导员工及时完成投资申报工作,进一步完善即时通讯工具管控、加强合规监测工作,建立员工手机下单行为合规检查机制,对董事、监事及员工投资行为管理进一步梳理;(3)切实履行反洗钱管理职责;(4)稳步跟进各类法律事务;(5)深入开展合规专题研究;(6)资管新规整改后相关事项持续跟进处理。

在风险管理履职方面:(1)切实履行日常风险管理职责,做到事前、事中、事后风险管理,按时完成内外部各类定期风控报告及数据报送,并对公司风控指标进行持续监测;(2)不断完善风险管理规则体系,牵头制定或修订各项制度及方案,展开专项梳理,确保业务流程合规和操作风险可控;(3)持之以恒加强风控系统建设。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》

以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种，并提交估值委员会审议。运营部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。



§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2023)第 21455 号 |

6.2 审计报告的基本内容

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题          | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 审计报告收件人         | 东方红聚利债券型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 审计意见            | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了东方红聚利债券型证券投资基金(以下简称“东方红聚利债券基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了东方红聚利债券基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方红聚利债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                               |
| 强调事项            | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 其他事项            | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 其他信息            | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>东方红聚利债券基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估东方红聚利债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算东方红聚利债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督东方红聚利债券基金的财务报告</p>                         |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |     |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|                 | 过程。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |     |
| 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>（一） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三） 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四） 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东方红聚利债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方红聚利债券基金不能持续经营。</p> <p>（五） 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称       | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |     |
| 注册会计师的姓名        | 张振波                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 叶尔甸 |
| 会计师事务所的地址       | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |     |
| 审计报告日期          | 2023 年 3 月 28 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |     |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方红聚利债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产           | 附注号        | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 银行存款          | 7.4.7.1    | 261,386.47                      | 7,679,089.16                     |
| 结算备付金         |            | 56,972,537.44                   | 38,271,470.56                    |
| 存出保证金         |            | 12,126,489.84                   | 87,496.84                        |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 4,347,337,787.14                | 2,307,006,130.48                 |
| 其中：股票投资       |            | -                               | -                                |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 4,347,337,787.14                | 2,307,006,130.48                 |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                               | 439,984,705.06                   |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                               | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | -                               | -                                |
| 应收清算款         |            | 4,424,299.44                    | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | 661,236.93                      | 27,284,787.12                    |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                               | 22,764,016.06                    |
| 资产总计          |            | 4,421,783,737.26                | 2,843,077,695.28                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2021 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     |            | 578,543,759.12                  | -                                |
| 应付清算款         |            | 2,485,099.40                    | 6,966,860.27                     |
| 应付赎回款         |            | 3,297,460.71                    | 8,461,313.76                     |

|             |          |                  |                  |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 应付管理人报酬     |          | 2,309,925.05     | 1,507,144.84     |
| 应付托管费       |          | 494,983.93       | 322,959.58       |
| 应付销售服务费     |          | 441,160.27       | 355,186.52       |
| 应付投资顾问费     |          | -                | -                |
| 应交税费        |          | 82,888.74        | 36,962.07        |
| 应付利润        |          | -                | -                |
| 递延所得税负债     |          | -                | -                |
| 其他负债        | 7.4.7.9  | 225,876.11       | 196,806.64       |
| 负债合计        |          | 587,881,153.33   | 17,847,233.68    |
| <b>净资产：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金        | 7.4.7.10 | 3,075,605,542.10 | 2,243,198,851.68 |
| 其他综合收益      | 7.4.7.11 | -                | -                |
| 未分配利润       | 7.4.7.12 | 758,297,041.83   | 582,031,609.92   |
| 净资产合计       |          | 3,833,902,583.93 | 2,825,230,461.60 |
| 负债和净资产总计    |          | 4,421,783,737.26 | 2,843,077,695.28 |

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 3,075,605,542.10 份，其中东方红聚利债券 A 基金份额总额 2,031,109,456.01 份，基金份额净值 1.2522 元；东方红聚利债券 C 基金份额总额 1,044,496,086.09 份，基金份额净值 1.2356 元。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红聚利债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 |
|-------------------|----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | -35,908,659.89                            | 118,178,611.01                                 |
| 1. 利息收入           |          | 1,990,599.43                              | 17,182,489.15                                  |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.13 | 614,132.27                                | 251,561.44                                     |
| 债券利息收入            |          | -                                         | 14,488,815.37                                  |
| 资产支持证券利息收入        |          | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入        |          | 1,376,467.16                              | 2,442,112.34                                   |
| 证券出借利息收入          |          | -                                         | -                                              |
| 其他利息收入            |          | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 80,413,380.45                             | 55,440,288.48                                  |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.14 | -2,602,963.99                             | -723,988.98                                    |
| 基金投资收益            |          | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益            | 7.4.7.15 | 86,800,745.42                             | 56,724,677.46                                  |
| 资产支持证券投资          | 7.4.7.16 | -                                         | -                                              |

|                                     |            |                 |                |
|-------------------------------------|------------|-----------------|----------------|
| 收益                                  |            |                 |                |
| 贵金属投资收益                             | 7.4.7.17   | -               | -              |
| 衍生工具收益                              | 7.4.7.18   | -3,784,400.98   | -560,400.00    |
| 股利收益                                | 7.4.7.19   | -               | -              |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>收益       |            | -               | -              |
| 其他投资收益                              |            | -               | -              |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列）          | 7.4.7.20   | -119,693,061.07 | 45,176,630.25  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）              |            | -               | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）              | 7.4.7.21   | 1,380,421.30    | 379,203.13     |
| <b>减：二、营业总支出</b>                    |            | 36,560,901.74   | 10,657,340.89  |
| 1. 管理人报酬                            | 7.4.10.2.1 | 23,133,725.94   | 7,272,410.36   |
| 2. 托管费                              | 7.4.10.2.2 | 4,957,227.00    | 1,558,373.55   |
| 3. 销售服务费                            | 7.4.10.2.3 | 4,579,827.92    | 1,432,843.79   |
| 4. 投资顾问费                            |            | -               | -              |
| 5. 利息支出                             |            | 3,484,337.51    | 45,506.04      |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出                   |            | 3,484,337.51    | 45,506.04      |
| 6. 信用减值损失                           | 7.4.7.22   | -               | -              |
| 7. 税金及附加                            |            | 110,768.22      | 26,843.07      |
| 8. 其他费用                             | 7.4.7.23   | 295,015.15      | 321,364.08     |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>    以“-”号填列）</b> |            | -72,469,561.63  | 107,521,270.12 |
| 减：所得税费用                             |            | -               | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>    号填列）</b>   |            | -72,469,561.63  | 107,521,270.12 |
| <b>五、其他综合收益的税后<br/>    净额</b>       |            | -               | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>                     |            | -72,469,561.63  | 107,521,270.12 |

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东方红聚利债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |        |                |                  |
|---------------|----------------------------------------|--------|----------------|------------------|
|               | 实收基金                                   | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期<br>期 末 净 | 2,243,198,851.68                       | -      | 582,031,609.92 | 2,825,230,461.60 |

|                                     |                   |   |                  |                   |
|-------------------------------------|-------------------|---|------------------|-------------------|
| 资产(基金净值)                            |                   |   |                  |                   |
| 加:会计政策变更                            | -                 | - | -                | -                 |
| 前期差错更正                              | -                 | - | -                | -                 |
| 其他                                  | -                 | - | -                | -                 |
| 二、本期末期初净资产(基金净值)                    | 2,243,198,851.68  | - | 582,031,609.92   | 2,825,230,461.60  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | 832,406,690.42    | - | 176,265,431.91   | 1,008,672,122.33  |
| (一)、综合收益总额                          | -                 | - | -72,469,561.63   | -72,469,561.63    |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 832,406,690.42    | - | 248,734,993.54   | 1,081,141,683.96  |
| 其中:1. 基金申购款                         | 4,642,962,175.25  | - | 1,232,818,271.09 | 5,875,780,446.34  |
| 2. 基金赎回款                            | -3,810,555,484.83 | - | -984,083,277.55  | -4,794,638,762.38 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产                 | -                 | - | -                | -                 |

|                       |                                             |        |                |                  |
|-----------------------|---------------------------------------------|--------|----------------|------------------|
| 生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) |                                             |        |                |                  |
| (四)、其他综合收益结转留存收益      | -                                           | -      | -              | -                |
| 四、本期期末净资产(基金净值)       | 3,075,605,542.10                            | -      | 758,297,041.83 | 3,833,902,583.93 |
| 项目                    | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |        |                |                  |
|                       | 实收基金                                        | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产(基金净值)       | 433,584,726.03                              | -      | 45,563,466.02  | 479,148,192.05   |
| 加:会计政策变更              | -                                           | -      | -              | -                |
| 前期差错更正                | -                                           | -      | -              | -                |
| 其他                    | -                                           | -      | -              | -                |
| 二、本期期初净资产(基金净值)       | 433,584,726.03                              | -      | 45,563,466.02  | 479,148,192.05   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)  | 1,809,614,125.65                            | -      | 536,468,143.90 | 2,346,082,269.55 |
| (一)、综合收益总额            | -                                           | -      | 107,521,270.12 | 107,521,270.12   |
| (二)、本期基               | 1,809,614,125.65                            | -      | 428,946,873.78 | 2,238,560,999.43 |

|                                                                                                             |                  |   |                 |                   |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|---|-----------------|-------------------|
| 金 份 额<br>交 易 产<br>生 的 基<br>金 净 值<br>变 动 数<br>( 净 值<br>减 少 以<br>“-” 号<br>填 列 )                               |                  |   |                 |                   |
| 其中:1.<br>基 金 申<br>购 款                                                                                       | 2,767,481,717.95 | - | 617,095,945.81  | 3,384,577,663.76  |
| 2<br>. 基 金 赎<br>回 款                                                                                         | -957,867,592.30  | - | -188,149,072.03 | -1,146,016,664.33 |
| (三)、<br>本 期 向<br>基 金 份<br>额 持 有<br>人 分 配<br>利 润 产<br>生 的 基<br>金 净 值<br>变 动 ( 净<br>值 减 少<br>以 “-”<br>号 填 列 ) | -                | - | -               | -                 |
| (四)、<br>其 他 综<br>合 收 益<br>结 转 留<br>存 收 益                                                                    | -                | - | -               | -                 |
| 四、本期<br>期 末 净<br>资 产 ( 基<br>金 净 值 )                                                                         | 2,243,198,851.68 | - | 582,031,609.92  | 2,825,230,461.60  |

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：

张锋

汤琳

陈培

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东方红聚利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]337号《关于准予东方红聚利债券型证券投资基金注册的批复》核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红聚利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,382,367,508.65元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0507号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红聚利债券型证券投资基金基金合同》于2019年9月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,382,727,846.48份基金份额,其中认购资金利息折合360,337.83份基金份额,其中A类基金份额的基金份额总额为1,311,726,336.63份,包含认购资金利息折合343,548.46份,C类基金份额的基金份额总额为71,001,509.85份,包含认购资金利息折合16,789.37份。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《东方红聚利债券型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购费用、申购费用和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费,而不计提销售服务费的,称为A类基金份额;不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,各类别基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红聚利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、公开发行的次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款等)、同业存单、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、债券回购、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、国债期货等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不可以直接买入股票、权证,但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票和因投资分离交易可转债所形成的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履

行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率\*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率(税后)\*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司于 2023 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红聚利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利

率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为 7,679,089.16 元、38,271,470.56 元、87,496.84 元、439,984,705.06 元、22,764,016.06 元和 27,284,787.12 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 7,682,225.48 元、38,289,189.22 元、87,540.07 元、440,022,326.98 元、0.00 元和 27,288,261.34 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,307,006,130.48 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,329,708,152.19 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 6,966,860.27 元、8,461,313.76 元、1,507,144.84 元、322,959.58 元、355,186.52 元、17,856.81 元和 1,949.83 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 6,966,860.27 元、8,461,313.76 元、1,507,144.84 元、322,959.58 元、355,186.52 元、17,856.81 元和 1,949.83 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。



#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 261,386.47              | 7,679,089.16             |
| 等于：本金          | 260,267.60              | 7,679,089.16             |
| 加：应计利息         | 1,118.87                | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 等于：本金          | -                       | -                        |
| 加：应计利息         | -                       | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | -                       | -                        |
| 存款期限 3 个月以上    | -                       | -                        |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 等于：本金          | -                       | -                        |
| 加：应计利息         | -                       | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 合计             | 261,386.47              | 7,679,089.16             |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日  |               |                  |                |
|---------------|-------|--------------------------|---------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本                       | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | -                        | -             | -                | -              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -             | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 3,301,073,258.66         | 15,884,577.89 | 3,237,901,091.79 | -79,056,744.76 |
|               | 银行间市场 | 1,100,223,117.29         | 8,507,695.35  | 1,109,436,695.35 | 705,882.71     |
|               | 合计    | 4,401,296,375.95         | 24,392,273.24 | 4,347,337,787.14 | -78,350,862.05 |
| 资产支持证券        |       | -                        | -             | -                | -              |
| 基金            |       | -                        | -             | -                | -              |
| 其他            |       | -                        | -             | -                | -              |
| 合计            |       | 4,401,296,375.95         | 24,392,273.24 | 4,347,337,787.14 | -78,350,862.05 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |               |                  |                |
|               |       | 成本                       | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | -                        | -             | -                | -              |

|               |       |                  |   |                  |               |
|---------------|-------|------------------|---|------------------|---------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                | - | -                | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 1,792,634,933.97 | - | 1,835,958,130.48 | 43,323,196.51 |
|               | 银行间市场 | 470,313,364.51   | - | 471,048,000.00   | 734,635.49    |
|               | 合计    | 2,262,948,298.48 | - | 2,307,006,130.48 | 44,057,832.00 |
| 资产支持证券        |       | -                | - | -                | -             |
| 基金            |       | -                | - | -                | -             |
| 其他            |       | -                | - | -                | -             |
| 合计            |       | 2,262,948,298.48 | - | 2,307,006,130.48 | 44,057,832.00 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日  |      |    |    |
|-----------|--------------------------|------|----|----|
|           | 合同/名义<br>金额              | 公允价值 |    | 备注 |
|           |                          | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具    | -403,675,632.98          | -    | -  |    |
| 其中：国债期货投资 | -403,675,632.98          | -    | -  |    |
| 货币衍生工具    | -                        | -    | -  |    |
| 权益衍生工具    | -                        | -    | -  |    |
| 其他衍生工具    | -                        | -    | -  |    |
| 合计        | -403,675,632.98          | -    | -  |    |
| 项目        | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |      |    |    |
|           | 合同/名义<br>金额              | 公允价值 |    | 备注 |
|           |                          | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具    | -                        | -    | -  |    |
| 货币衍生工具    | -                        | -    | -  |    |
| 权益衍生工具    | -                        | -    | -  |    |
| 其他衍生工具    | -                        | -    | -  |    |
| 合计        | -                        | -    | -  |    |

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码         | 名称                | 持仓量（买/卖） | 合约市值            | 公允价值变动       |
|------------|-------------------|----------|-----------------|--------------|
| T2303      | 10 年期国债期货 2303 合约 | -400.00  | -400,960,000.00 | 2,715,632.98 |
| 合计         |                   |          |                 | 2,715,632.98 |
| 减：可抵销期货暂收款 |                   |          |                 | 2,715,632.98 |
| 净额         |                   |          |                 | -            |

注：衍生金融资产项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 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>2022 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 | -                        | -         |
| 合计    | -                        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 70,000,000.00            | -         |
| 银行间市场 | 369,984,705.06           | -         |
| 合计    | 439,984,705.06           | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
| 应收利息  | -                       | 22,764,016.06            |
| 其他应收款 | -                       | -                        |
| 待摊费用  | -                       | -                        |
| 合计    | -                       | 22,764,016.06            |

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 573.29                  | 1,949.83                 |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 应付交易费用      | 15,302.82               | 17,856.81                |
| 其中：交易所市场    | 10,777.82               | 17,151.75                |
| 银行间市场       | 4,525.00                | 705.06                   |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提费用        | 210,000.00              | 177,000.00               |
| 合计          | 225,876.11              | 196,806.64               |

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 东方红聚利债券 A

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|----------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额              |
| 上年度末          | 1,367,947,589.61                       | 1,367,947,589.61  |
| 本期申购          | 2,945,607,239.10                       | 2,945,607,239.10  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,282,445,372.70                      | -2,282,445,372.70 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                      | -                 |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                      | -                 |
| 本期申购          | -                                      | -                 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                      | -                 |
| 本期末           | 2,031,109,456.01                       | 2,031,109,456.01  |

##### 东方红聚利债券 C

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----|----------------------------------------|
|----|----------------------------------------|

|               | 基金份额（份）           | 账面金额              |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末          | 875,251,262.07    | 875,251,262.07    |
| 本期申购          | 1,697,354,936.15  | 1,697,354,936.15  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,528,110,112.13 | -1,528,110,112.13 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                 | -                 |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                 | -                 |
| 本期申购          | -                 | -                 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                 | -                 |
| 本期末           | 1,044,496,086.09  | 1,044,496,086.09  |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

东方红聚利债券 A

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期期初           | 289,210,078.15  | 71,994,135.35  | 361,204,213.50  |
| 本期利润           | 34,477,906.51   | -74,185,627.98 | -39,707,721.47  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 149,322,693.44  | 41,412,135.19  | 190,734,828.63  |
| 其中：基金申购款       | 667,334,223.91  | 129,158,993.77 | 796,493,217.68  |
| 基金赎回款          | -518,011,530.47 | -87,746,858.58 | -605,758,389.05 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | 473,010,678.10  | 39,220,642.56  | 512,231,320.66  |

东方红聚利债券 C

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期期初           | 175,128,341.87  | 45,699,054.55  | 220,827,396.42  |
| 本期利润           | 12,745,592.93   | -45,507,433.09 | -32,761,840.16  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 38,043,192.30   | 19,956,972.61  | 58,000,164.91   |
| 其中：基金申购款       | 356,256,359.83  | 80,068,693.58  | 436,325,053.41  |
| 基金赎回款          | -318,213,167.53 | -60,111,720.97 | -378,324,888.50 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | 225,917,127.10  | 20,148,594.07  | 246,065,721.17  |

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 145,388.32                             | 63,658.15                                   |
| 定期存款利息收入 | -                                      | -                                           |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 其他存款利息收入  | -          | -          |
| 结算备付金利息收入 | 407,992.41 | 147,476.92 |
| 其他        | 60,751.54  | 40,426.37  |
| 合计        | 614,132.27 | 251,561.44 |

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -2,602,963.99               | -723,988.98                      |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                           | -                                |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                           | -                                |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                           | -                                |
| 合计               | -2,602,963.99               | -723,988.98                      |

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 50,306,712.27               | 39,287,856.10                    |
| 减：卖出股票成本总额 | 52,819,123.95               | 40,011,845.08                    |
| 减：交易费用     | 90,552.31                   | -                                |
| 买卖股票差价收入   | -2,602,963.99               | -723,988.98                      |

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
|----|-----------------------------|----------------------------------|

|                              | 日             | 日             |
|------------------------------|---------------|---------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 50,922,548.80 | —             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 35,878,196.62 | 56,724,677.46 |
| 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                           | 86,800,745.42 | 56,724,677.46 |

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 4,563,952,063.60                | 883,694,422.30                       |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,471,631,778.72                | 817,131,088.09                       |
| 减：应计利息总额               | 56,344,748.65                   | 9,838,656.75                         |
| 减：交易费用                 | 97,339.61                       | —                                    |
| 买卖债券差价收入               | 35,878,196.62                   | 56,724,677.46                        |

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益—赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益—申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益—申购差价收入。



#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期收益金额<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>收益金额<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------|--------------------------------------------|-----------------------------------------------------|
| 国债期货投资收益 | -3,784,400.98                              | -560,400.00                                         |

#### 7.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021<br>年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -122,408,694.05                           | 45,176,630.25                                  |
| 股票投资       | -                                         | -                                              |
| 债券投资       | -122,408,694.05                           | 45,176,630.25                                  |
| 资产支持证券投资   | -                                         | -                                              |
| 基金投资       | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资      | -                                         | -                                              |
| 其他         | -                                         | -                                              |
| 2. 衍生工具    | 2,715,632.98                              | -                                              |
| 权证投资       | -                                         | -                                              |
| 期货投资       | 2,715,632.98                              | -                                              |
| 3. 其他      | -                                         | -                                              |

|                        |                 |               |
|------------------------|-----------------|---------------|
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -               | -             |
| 合计                     | -119,693,061.07 | 45,176,630.25 |

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,369,177.63                           | 376,996.35                                  |
| 基金转换费收入 | 11,243.67                              | 2,206.78                                    |
| 合计      | 1,380,421.30                           | 379,203.13                                  |

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 审计费用    | 90,000.00                              | 57,000.00                                   |
| 信息披露费   | 120,000.00                             | 120,000.00                                  |
| 证券出借违约金 | -                                      | -                                           |
| 银行费用    | 47,815.15                              | 27,477.78                                   |
| 账户维护费   | 37,200.00                              | 19,600.00                                   |
| 交易费用    | -                                      | 97,286.30                                   |
| 合计      | 295,015.15                             | 321,364.08                                  |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                  | 与本基金的关系           |
|------------------------|-------------------|
| 上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”） | 基金管理人、基金销售机构      |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）     | 基金托管人、基金销售机构      |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构   |
| 上海东证期货有限公司（“东证期货”）     | 受东方证券控制的公司、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |                          | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                          |
|-------|----------------------------------------|--------------------------|---------------------------------------------|--------------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 (%) | 成交金额                                        | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 (%) |
| 东方证券  | 57,289,896.56                          | 55.55                    | 24,483,211.52                               | 30.87                    |

##### 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>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |                          | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                          |
|-------|----------------------------------------|--------------------------|---------------------------------------------|--------------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 (%) | 成交金额                                        | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 (%) |
| 东方证券  | 2,943,035,269.95                       | 56.71                    | 24,483,218.90                               | 0.89                     |

##### 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>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |                            | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                            |
|-------|----------------------------------------|----------------------------|---------------------------------------------|----------------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期债券回购<br>成交总额的比<br>例 (%) | 成交金额                                        | 占当期债券回购<br>成交总额的比<br>例 (%) |
| 东方证券  | 27,357,300,000.00                      | 53.86                      | -                                           | -                          |

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                                    | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 东方证券  | 14,663.82                                   | 40.41              | -            | -                    |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                    |              |                      |

|   | 当期<br>佣金 | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
|---|----------|-------------------|--------------|---------------------|
| - | -        | -                 | -            | -                   |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 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>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 23,133,725.94                             | 7,272,410.36                                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,275,237.15                              | 1,829,712.05                                   |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,957,227.00                              | 1,558,373.55                                   |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日      |              |              |
|----------------|---------------------------------------------|--------------|--------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |              |              |
|                | 东方红聚利债券 A                                   | 东方红聚利债券 C    | 合计           |
| 东方证券           | —                                           | 43,444.95    | 43,444.95    |
| 东证资管           | —                                           | 1,329,492.38 | 1,329,492.38 |
| 招商银行           | —                                           | 649,661.72   | 649,661.72   |
| 合计             | —                                           | 2,022,599.05 | 2,022,599.05 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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                            |              |              |
|                | 东方红聚利债券 A                                   | 东方红聚利债券 C    | 合计           |
| 东方证券           | —                                           | 15,996.65    | 15,996.65    |
| 东证资管           | —                                           | 462,176.73   | 462,176.73   |
| 招商银行           | —                                           | 167,869.84   | 167,869.84   |
| 合计             | —                                           | 646,043.22   | 646,043.22   |

注：本基金 C 类基金份额的年销售服务费率为 0.4%。销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为每日 C 类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 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    |
| 招商银行  | 261,386.47                             | 145,388.32 | 7,679,089.16                                | 63,658.15 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金支付给东证期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2022 年 12 月 31 日，本基金无应付交易手续费余额(2021 年 12 月 31 日：同)。于 2022 年，本基金当期交易手续费支出 5,418.00 元(2021 年同期：548.10 元)。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按协议利率计息，存出保证金不计息。于 2022 年 12 月 31 日，本基金的结算备付金余额（不含应计利息）为 11,414,700.09 元，存出保证金余额为 12,028,800.00 元。(2021 年 12 月 31 日：结算备付金 4,453,311.93 元，无存出保证金)。于 2022 年，本基金当期结算备付金利息收入为 63,181.19 元(2021 年同期：13,238.18 元)。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 578,543,759.12 元，于 2023 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及的各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实

施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### 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>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 1,233,612,620.01        | 1,330,475,001.80         |
| 合计     | 1,233,612,620.01        | 1,330,475,001.80         |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为期限在一年以下的国债和短期融资券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 2,077,728,187.85        | 743,764,866.58           |
| AAA 以下 | 919,653,746.13          | 196,916,462.10           |
| 未评级    | 116,343,233.15          | 35,849,800.00            |



|    |                      |                   |
|----|----------------------|-------------------|
| 合计 | 3, 113, 725, 167. 13 | 976, 531, 128. 68 |
|----|----------------------|-------------------|

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为期限在一年以上的国债和政策性金融债。

**7. 4. 13. 2. 5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**7. 4. 13. 2. 6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

**7. 4. 13. 3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2022 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 578, 543, 759. 12 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**7. 4. 13. 3. 1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放日内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放日内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构

成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放日内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和卖出回购金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本<br>期<br>末<br>2022<br>年<br>12<br>月<br>31<br>日 | 1 个月以内         | 1-3 个月         | 3 个月-1 年         | 1-5 年            | 5 年以上          | 不计息           | 合计               |
|------------------------------------------------|----------------|----------------|------------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 资<br>产                                         |                |                |                  |                  |                |               |                  |
| 银<br>行<br>存<br>款                               | 261,386.47     |                |                  |                  |                |               | 261,386.47       |
| 结<br>算<br>备<br>付<br>金                          | 56,972,537.44  |                |                  |                  |                |               | 56,972,537.44    |
| 存<br>出<br>保<br>证<br>金                          | 97,689.84      |                |                  |                  |                | 12,028,800.00 | 12,126,489.84    |
| 交<br>易<br>性<br>金<br>融<br>资<br>产                | 173,791,859.18 | 694,138,329.43 | 1,022,230,673.30 | 2,014,397,289.72 | 442,779,635.51 |               | 4,347,337,787.14 |
| 应<br>收<br>申<br>购<br>款                          | 2,001.21       |                |                  |                  |                | 659,235.72    | 661,236.93       |
| 应<br>收<br>清<br>算<br>款                          |                |                |                  |                  |                | 4,424,299.44  | 4,424,299.44     |
| 资<br>产                                         | 231,125,474.14 | 694,138,329.43 | 1,022,230,673.30 | 2,014,397,289.72 | 442,779,635.51 | 17,112,335.16 | 4,421,783,737.26 |

|           |                |   |   |   |   |              |                |
|-----------|----------------|---|---|---|---|--------------|----------------|
| 总计        |                |   |   |   |   |              |                |
| 负债        |                |   |   |   |   |              |                |
| 应付赎回款     | -              | - | - | - | - | 3,297,460.71 | 3,297,460.71   |
| 应付管理人报酬   | -              | - | - | - | - | 2,309,925.05 | 2,309,925.05   |
| 应付托管费     | -              | - | - | - | - | 494,983.93   | 494,983.93     |
| 应付清算款     | -              | - | - | - | - | 2,485,099.40 | 2,485,099.40   |
| 卖出回购金融资产款 | 578,543,759.12 | - | - | - | - | -            | 578,543,759.12 |
| 应付销售服务费   | -              | - | - | - | - | 441,160.27   | 441,160.27     |
| 应交税       | -              | - | - | - | - | 82,888.74    | 82,888.74      |

|     |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
|-----|-----------------|----------------|------------------|------------------|----------------|--------------|------------------|
| 费   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 其他  |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 负债  |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
|     | -               | -              | -                | -                | -              | -225,876.11  | 225,876.11       |
| 负债  |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 总计  | 578,543,759.12  | -              | -                | -                | -              | 9,337,394.21 | 587,881,153.33   |
| 利率  |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 敏感  |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 度   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 缺   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 口   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
|     | -347,418,284.98 | 694,138,329.43 | 1,022,230,673.30 | 2,014,397,289.72 | 442,779,637.51 | 7,774,940.95 | 3,833,902,583.93 |
| 上   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 年   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 度   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 末   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 202 |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 1   | 1 个月以内          | 1-3 个月         | 3 个月-1 年         | 1-5 年            | 5 年以上          | 不计息          | 合计               |
| 年   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 12  |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 月   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 31  |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 日   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 资   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 产   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 银   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 行   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 存   | 7,679,089.16    | -              | -                | -                | -              | -            | 7,679,089.16     |
| 款   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 结   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 算   | 38,271,470.56   | -              | -                | -                | -              | -            | 38,271,470.56    |
| 备   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 付   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 金   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 存   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 出   | 87,496.84       | -              | -                | -                | -              | -            | 87,496.84        |
| 保   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 证   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 金   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |
| 交   | 320,138,000.00  | 274,735,200.00 | 906,928,053.00   | 678,721,977.84   | 126,482,899.64 | -            | 2,307,006,130.48 |
| 易   |                 |                |                  |                  |                |              |                  |

|          |                |                |                |                |                |               |                  |
|----------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 性金融资产    |                |                |                |                |                |               |                  |
| 买入返售金融资产 | 439,984,705.06 | -              | -              | -              | -              | -             | 439,984,705.06   |
| 应收申购款    | 20,449,163.36  | -              | -              | -              | -              | 6,835,623.76  | 27,284,787.12    |
| 其他资产     | -              | -              | -              | -              | -              | 22,764,016.06 | 22,764,016.06    |
| 资产总计     | 826,609,924.98 | 274,735,200.00 | 906,928,053.00 | 678,721,977.84 | 126,482,899.64 | 29,599,639.82 | 2,843,077,695.28 |
| 负债       |                |                |                |                |                |               |                  |
| 应付赎回款    | -              | -              | -              | -              | -              | 8,461,313.76  | 8,461,313.76     |
| 应付管理人报酬  | -              | -              | -              | -              | -              | 1,507,144.84  | 1,507,144.84     |
| 应付托管费    | -              | -              | -              | -              | -              | 322,959.58    | 322,959.58       |

|                             |                |                |                |                |                |               |                  |
|-----------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 应付<br>证券<br>清算<br>款         | -              | -              | -              | -              | -              | 6,966,860.27  | 6,966,860.27     |
| 应付<br>销售<br>服务<br>费         | -              | -              | -              | -              | -              | 355,186.52    | 355,186.52       |
| 应交<br>税费                    | -              | -              | -              | -              | -              | 36,962.07     | 36,962.07        |
| 其他<br>负债                    | -              | -              | -              | -              | -              | 196,806.64    | 196,806.64       |
| 负债<br>总计                    | -              | -              | -              | -              | -              | 17,847,233.68 | 17,847,233.68    |
| 利率<br>敏<br>感<br>度<br>缺<br>口 | 826,609,924.98 | 274,735,200.00 | 906,928,053.00 | 678,721,977.84 | 126,482,899.64 | 11,752,406.14 | 2,825,230,461.60 |

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 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（2022 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |

|    |                  |                |               |
|----|------------------|----------------|---------------|
| 分析 | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 23,927,976.55  | 7,529,077.78  |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -23,642,793.27 | -7,452,307.35 |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

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

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 2,661,509,887.99        | 651,223,249.38           |



|      |                  |                  |
|------|------------------|------------------|
| 第二层次 | 1,685,827,899.15 | 1,655,782,881.10 |
| 第三层次 | —                | —                |
| 合计   | 4,347,337,787.14 | 2,307,006,130.48 |

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额               | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | —                | —            |
|    | 其中：股票  | —                | —            |
| 2  | 基金投资   | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资 | 4,347,337,787.14 | 98.32        |
|    | 其中：债券  | 4,347,337,787.14 | 98.32        |
|    | 资产支持证券 | —                | —            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 4 | 贵金属投资             | -                | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 57,233,923.91    | 1.29   |
| 8 | 其他各项资产            | 17,212,026.21    | 0.39   |
| 9 | 合计                | 4,421,783,737.26 | 100.00 |

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600536 | 中国软件 | 28,303,420.95 | 1.00           |
| 2  | 603305 | 旭升集团 | 24,515,703.00 | 0.87           |

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600536 | 中国软件 | 27,155,676.52 | 0.96           |
| 2  | 603305 | 旭升集团 | 23,151,035.75 | 0.82           |

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 52,819,123.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 50,306,712.27 |

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价

乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 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      | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 240,519,157.81   | 6.27         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 123,623,458.09   | 3.22         |
|    | 其中：政策性金融债 | 103,234,684.93   | 2.69         |
| 4  | 企业债券      | 54,881,814.14    | 1.43         |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,006,202,010.42 | 26.24        |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 2,922,111,346.68 | 76.22        |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 4,347,337,787.14 | 113.39       |

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 113011 | 光大转债     | 2,130,680 | 222,893,061.67 | 5.81         |
| 2  | 113052 | 兴业转债     | 2,175,300 | 221,476,828.56 | 5.78         |
| 3  | 132015 | 18 中油 EB | 2,020,770 | 213,746,697.61 | 5.58         |
| 4  | 110059 | 浦发转债     | 1,621,080 | 170,098,592.00 | 4.44         |
| 5  | 019679 | 22 国债 14 | 1,600,000 | 161,096,986.30 | 4.20         |

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

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

## 8.10.2 本期国债期货投资评价

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

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券发行主体中,兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚;上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、上海市市场监督管理局、国家外汇管理局上海市分局的处罚;国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚;中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚;国泰君安证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行上海分行的处罚。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定,本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称    | 金额            |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | 12,126,489.84 |
| 2  | 应收清算款 | 4,424,299.44  |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 661,236.93    |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 17,212,026.21 |

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|--------------|
| 1  | 113011 | 光大转债 | 222,893,061.67 | 5.81         |
| 2  | 113052 | 兴业转债 | 221,476,828.56 | 5.78         |

|    |        |          |                |      |
|----|--------|----------|----------------|------|
| 3  | 132015 | 18 中油 EB | 213,746,697.61 | 5.58 |
| 4  | 110059 | 浦发转债     | 170,098,592.00 | 4.44 |
| 5  | 110073 | 国投转债     | 159,280,021.27 | 4.15 |
| 6  | 113044 | 大秦转债     | 130,780,861.20 | 3.41 |
| 7  | 127005 | 长证转债     | 125,681,204.54 | 3.28 |
| 8  | 113013 | 国君转债     | 114,528,154.52 | 2.99 |
| 9  | 113057 | 中银转债     | 89,335,093.37  | 2.33 |
| 10 | 113623 | 凤 21 转债  | 81,054,666.53  | 2.11 |
| 11 | 110079 | 杭银转债     | 60,185,395.82  | 1.57 |
| 12 | 113021 | 中信转债     | 58,637,179.39  | 1.53 |
| 13 | 110085 | 通 22 转债  | 47,804,444.61  | 1.25 |
| 14 | 113024 | 核建转债     | 42,962,558.44  | 1.12 |
| 15 | 127025 | 冀东转债     | 41,991,032.45  | 1.10 |
| 16 | 110053 | 苏银转债     | 41,816,359.89  | 1.09 |
| 17 | 110045 | 海澜转债     | 39,409,055.50  | 1.03 |
| 18 | 113042 | 上银转债     | 36,224,281.64  | 0.94 |
| 19 | 113602 | 景 20 转债  | 33,667,562.96  | 0.88 |
| 20 | 132018 | G 三峡 EB1 | 33,195,650.69  | 0.87 |
| 21 | 127016 | 鲁泰转债     | 31,868,698.28  | 0.83 |
| 22 | 127061 | 美锦转债     | 29,816,732.06  | 0.78 |
| 23 | 127045 | 牧原转债     | 27,881,927.84  | 0.73 |
| 24 | 127050 | 麒麟转债     | 26,754,793.20  | 0.70 |
| 25 | 128135 | 洽洽转债     | 25,906,240.00  | 0.68 |
| 26 | 113049 | 长汽转债     | 24,553,835.19  | 0.64 |
| 27 | 123133 | 佩蒂转债     | 24,268,630.14  | 0.63 |
| 28 | 110064 | 建工转债     | 21,425,145.11  | 0.56 |
| 29 | 113641 | 华友转债     | 21,028,502.47  | 0.55 |
| 30 | 127056 | 中特转债     | 20,977,047.29  | 0.55 |
| 31 | 113043 | 财通转债     | 20,540,696.99  | 0.54 |
| 32 | 113626 | 伯特转债     | 19,795,359.61  | 0.52 |
| 33 | 113037 | 紫银转债     | 19,261,920.66  | 0.50 |
| 34 | 110075 | 南航转债     | 18,830,360.55  | 0.49 |
| 35 | 127039 | 北港转债     | 18,488,613.70  | 0.48 |
| 36 | 127049 | 希望转 2    | 18,378,786.06  | 0.48 |
| 37 | 113579 | 健友转债     | 18,112,275.39  | 0.47 |
| 38 | 113634 | 珀莱转债     | 17,247,037.67  | 0.45 |
| 39 | 110084 | 贵燃转债     | 15,949,074.21  | 0.42 |
| 40 | 128138 | 侨银转债     | 15,396,556.94  | 0.40 |
| 41 | 110083 | 苏租转债     | 14,479,765.48  | 0.38 |
| 42 | 113636 | 甬金转债     | 14,263,260.83  | 0.37 |
| 43 | 132022 | 20 广版 EB | 13,659,110.39  | 0.36 |
| 44 | 113606 | 荣泰转债     | 12,893,854.44  | 0.34 |
| 45 | 113053 | 隆 22 转债  | 12,573,907.12  | 0.33 |

|    |        |         |               |      |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 46 | 127036 | 三花转债    | 12,557,761.64 | 0.33 |
| 47 | 113632 | 鹤 21 转债 | 12,479,931.51 | 0.33 |
| 48 | 123107 | 温氏转债    | 12,462,465.75 | 0.33 |
| 49 | 128129 | 青农转债    | 12,161,343.75 | 0.32 |
| 50 | 113055 | 成银转债    | 12,001,326.03 | 0.31 |
| 51 | 123121 | 帝尔转债    | 11,717,635.07 | 0.31 |
| 52 | 128083 | 新北转债    | 11,600,122.66 | 0.30 |
| 53 | 110067 | 华安转债    | 11,073,775.23 | 0.29 |
| 54 | 111000 | 起帆转债    | 10,945,020.41 | 0.29 |
| 55 | 127063 | 贵轮转债    | 10,780,870.96 | 0.28 |
| 56 | 110057 | 现代转债    | 10,125,369.86 | 0.26 |
| 57 | 113033 | 利群转债    | 9,703,298.45  | 0.25 |
| 58 | 110052 | 贵广转债    | 9,407,763.01  | 0.25 |
| 59 | 127022 | 恒逸转债    | 9,401,812.84  | 0.25 |
| 60 | 113054 | 绿动转债    | 8,916,996.31  | 0.23 |
| 61 | 127033 | 中装转 2   | 8,817,496.57  | 0.23 |
| 62 | 123145 | 药石转债    | 8,667,283.01  | 0.23 |
| 63 | 110061 | 川投转债    | 8,575,660.27  | 0.22 |
| 64 | 127032 | 苏行转债    | 8,326,601.64  | 0.22 |
| 65 | 113542 | 好客转债    | 8,022,135.10  | 0.21 |
| 66 | 113643 | 风语转债    | 8,016,059.77  | 0.21 |
| 67 | 128034 | 江银转债    | 7,051,758.97  | 0.18 |
| 68 | 113048 | 晶科转债    | 5,554,104.80  | 0.14 |
| 69 | 123091 | 长海转债    | 5,276,624.96  | 0.14 |
| 70 | 113516 | 苏农转债    | 4,569,986.85  | 0.12 |
| 71 | 113615 | 金诚转债    | 4,406,216.50  | 0.11 |
| 72 | 127034 | 绿茵转债    | 4,281,169.00  | 0.11 |
| 73 | 123132 | 回盛转债    | 3,961,751.98  | 0.10 |
| 74 | 128137 | 洁美转债    | 3,803,118.13  | 0.10 |
| 75 | 113648 | 巨星转债    | 3,637,201.64  | 0.09 |
| 76 | 123113 | 仙乐转债    | 3,510,473.10  | 0.09 |
| 77 | 128023 | 亚太转债    | 3,342,082.19  | 0.09 |
| 78 | 123131 | 奥飞转债    | 3,300,134.79  | 0.09 |
| 79 | 111002 | 特纸转债    | 2,527,918.82  | 0.07 |
| 80 | 113060 | 浙 22 转债 | 2,415,962.19  | 0.06 |
| 81 | 128134 | 鸿路转债    | 2,410,082.19  | 0.06 |
| 82 | 128132 | 交建转债    | 2,343,587.67  | 0.06 |
| 83 | 128142 | 新乳转债    | 2,220,013.70  | 0.06 |
| 84 | 113638 | 台 21 转债 | 2,192,065.75  | 0.06 |
| 85 | 118008 | 海优转债    | 2,132,879.38  | 0.06 |
| 86 | 128105 | 长集转债    | 2,034,504.11  | 0.05 |

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别      | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构            |            |                  |            |
|-----------|-----------|-----------|------------------|------------|------------------|------------|
|           |           |           | 机构投资者            |            | 个人投资者            |            |
|           |           |           | 持有份额             | 占总份额比例 (%) | 持有份额             | 占总份额比例 (%) |
| 东方红聚利债券 A | 80,692    | 25,171.14 | 1,395,682,759.30 | 68.72      | 635,426,696.71   | 31.28      |
| 东方红聚利债券 C | 14,969    | 69,777.28 | 581,265,581.16   | 55.65      | 463,230,504.93   | 44.35      |
| 合计        | 95,661    | 32,151.09 | 1,976,948,340.46 | 64.28      | 1,098,657,201.64 | 35.72      |

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别      | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|-----------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 东方红聚利债券 A | 567,227.83 | 0.03         |
|                  | 东方红聚利债券 C | 223,906.59 | 0.02         |
|                  | 合计        | 791,134.42 | 0.03         |

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别      | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|-----------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 东方红聚利债券 A | 10~50              |
|                                | 东方红聚利债券 C | 0                  |

|                     |           |       |
|---------------------|-----------|-------|
|                     | 合计        | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本<br>开放式基金 | 东方红聚利债券 A | 10~50 |
|                     | 东方红聚利债券 C | 0     |
|                     | 合计        | 10~50 |

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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                    | 东方红聚利债券 A        | 东方红聚利债券 C        |
|---------------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日<br>(2019 年 9 月 6 日)<br>基金份额总额 | 1,311,726,336.63 | 71,001,509.85    |
| 本报告期期初基金份<br>额总额                      | 1,367,947,589.61 | 875,251,262.07   |
| 本报告期基金总申购<br>份额                       | 2,945,607,239.10 | 1,697,354,936.15 |
| 减：本报告期基金总<br>赎回份额                     | 2,282,445,372.70 | 1,528,110,112.13 |
| 本报告期基金拆分变<br>动份额                      | —                | —                |
| 本报告期期末基金份<br>额总额                      | 2,031,109,456.01 | 1,044,496,086.09 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，管理人的重大人事变动情况如下：

杨斌同志自 2022 年 10 月 11 日起担任管理人董事长，宋雪枫同志不再担任管理人董事长、自 2022 年 10 月 11 日起担任管理人董事；蒋鹤磊同志自 2022 年 11 月 7 日起担任管理人董事，宋雪枫同志不再担任管理人董事；彭卫东同志自 2022 年 12 月 20 日起担任管理人独立董事；杨勤法同志自 2022 年 12 月 20 日起担任管理人独立董事；郭晔同志自 2022 年 12 月 20 日起担任管理人独立董事；杨洁琼同志自 2022 年 12 月 20 日起不再担任管理人董事。



杨洁琼同志自 2022 年 12 月 20 日起担任管理人监事，朱静同志不再担任管理人监事；刘枫同志自 2022 年 12 月 20 日起担任管理人职工监事。

张锋同志自 2022 年 2 月 25 日起代行合规负责人、首席风险官职务，李云亮同志不再担任合规负责人、首席风险官、首席信息官职务；胡伟同志自 2022 年 3 月 4 日起担任公司副总经理；周陶同志自 2022 年 8 月 5 日起担任合规负责人、首席风险官、首席信息官，张锋同志不再代行合规负责人、首席风险官。

自 2022 年 07 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日（2019 年）起为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 9 万元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到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 | 交易单元数量 | 股票交易          |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 东方证券 | 5      | 57,289,896.56 | 55.55            | 14,663.82 | 40.41          | -  |
| 华创证券 | 2      | 20,042,527.72 | 19.44            | 10,323.35 | 28.45          | -  |
| 开源证券 | 1      | 15,034,982.7  | 14.58            | 10,845.17 | 29.89          | -  |

|          |   |               |       |        |      |   |
|----------|---|---------------|-------|--------|------|---|
|          |   | 5             |       |        |      |   |
| 国金证券     | 2 | 10,758,429.19 | 10.43 | 454.47 | 1.25 | - |
| 安信证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 长江证券     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 东方财富证券   | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 东吴证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 方正证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 高华证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 光大证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 广发证券     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 国盛证券     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 国泰君安     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 国信证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 海通证券     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 宏信证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 华金证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 华泰证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 华兴证券     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 汇丰前海     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 民生证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 申万宏源     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 天风证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 西部证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 西南证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 兴业证券     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 野村东方国际证券 | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 银河证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 招商证券     | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 中金公司     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 中泰证券     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |
| 中信建投证券   | 1 | -             | -     | -      | -    | - |
| 中信证券     | 2 | -             | -     | -      | -    | - |

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

## 2、交易单元的选择标准和程序

### （1）选择标准

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

交易佣金收费合理。

## (2) 选择程序

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

3、本基金本报告期内租用的券商交易单元变更情况：新增东方财富证券交易单元 2 个。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易             |                 | 债券回购交易            |                   | 权证交易 |                 |
|--------|------------------|-----------------|-------------------|-------------------|------|-----------------|
|        | 成交金额             | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 东方证券   | 2,943,035,269.95 | 56.71           | 27,357,300,000.00 | 53.86             | -    | -               |
| 华创证券   | 160,157,435.28   | 3.09            | 2,047,800,000.00  | 4.03              | -    | -               |
| 开源证券   | 41,698,861.59    | 0.80            | 3,358,200,000.00  | 6.61              | -    | -               |
| 国金证券   | 171,018,526.14   | 3.30            | 1,586,600,000.00  | 3.12              | -    | -               |
| 安信证券   | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               |
| 长江证券   | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               |
| 东方财富证券 | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               |
| 东吴证券   | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               |
| 方正证券   | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               |
| 高华证券   | 660,216,645.44   | 12.72           | -                 | -                 | -    | -               |
| 光大证券   | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               |
| 广发证券   | 26,501,654.55    | 0.51            | 2,027,500,000.00  | 3.99              | -    | -               |
| 国盛证券   | 139,945,602.72   | 2.70            | -                 | -                 | -    | -               |
| 国泰君安   | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               |
| 国信证    | -                | -               | -                 | -                 | -    | -               |

|                  |                    |       |                      |       |   |   |
|------------------|--------------------|-------|----------------------|-------|---|---|
| 券                |                    |       |                      |       |   |   |
| 海通证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 宏信证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 华金证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 华泰证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 华兴证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 汇丰前<br>海         | 111,827,912<br>.34 | 2.15  | 4,509,000,00<br>0.00 | 8.88  | - | - |
| 民生证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 申万宏<br>源         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 天风证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 西部证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 西南证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 兴业证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 野村东<br>方国际<br>证券 | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 银河证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 招商证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 中金公<br>司         | 935,216,812<br>.56 | 18.02 | 9,907,300,00<br>0.00 | 19.50 | - | - |
| 中泰证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 中信建<br>投证券       | -                  | -     | -                    | -     | - | - |
| 中信证<br>券         | -                  | -     | -                    | -     | - | - |

## 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项             | 法定披露方式    | 法定披露日期         |
|----|------------------|-----------|----------------|
| 1  | 关于东方红聚利债券型证券投资基金 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 4 日 |

|    |                                                           |           |                 |
|----|-----------------------------------------------------------|-----------|-----------------|
|    | 在网上直销平台调整定期定额投资业务起点金额的公告                                  |           |                 |
| 2  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告       | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 6 日  |
| 3  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告     | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 6 日  |
| 4  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告   | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 19 日 |
| 5  | 关于东方红聚利债券型证券投资基金在平安银行股份有限公司开通定投业务的公告                      | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 6  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加北京雪球基金销售有限公司为代理销售机构及开通部分基金定投业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 7  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金上海好买基金销售有限公司开通办理定投业务的公告             | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 8  | 东方红聚利债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告                             | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 24 日 |
| 9  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整申购及赎回数额限制的公告                      | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 26 日 |
| 10 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加广发证券股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告       | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 2 月 11 日 |
| 11 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在招商银行股份有限公司开通转换业务的公告                | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 21 日 |
| 12 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在东方证券股份有限公司开通转换业务的公告                | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 21 日 |
| 13 | 关于东方红聚利债券型证券投资基金在平安证券股份有限公司开通定投业务的公告                      | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 25 日 |
| 14 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                         | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 26 日 |

|    |                                                       |           |                 |
|----|-------------------------------------------------------|-----------|-----------------|
|    | 告                                                     |           |                 |
| 15 | 关于东方红聚利债券型证券投资基金增加中银国际证券股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告       | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 29 日 |
| 16 | 东方红聚利债券型证券投资基金 2021 年年度报告                             | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 31 日 |
| 17 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在上海基煜基金销售有限公司开通转换业务的公告          | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 4 月 15 日 |
| 18 | 东方红聚利债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告                         | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 19 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在上海利得基金销售有限公司开通转换业务的公告          | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 17 日 |
| 20 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销平台开展费率优惠活动的公告              | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 19 日 |
| 21 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在中国光大银行股份有限公司开通转换业务的公告          | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 19 日 |
| 22 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在平安银行股份有限公司开通转换业务的公告            | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 19 日 |
| 23 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在东方证券股份有限公司开通转换业务的公告            | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 20 日 |
| 24 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在上海浦东发展银行股份有限公司开通转换业务的公告        | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 20 日 |
| 25 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在中国建设银行股份有限公司开通定投业务的公告          | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 6 月 9 日  |
| 26 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 7 月 13 日 |
| 27 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销平台开展费率优惠活动的公告              | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 7 月 14 日 |
| 28 | 东方红聚利债券型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告                         | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 7 月 21 日 |
| 29 | 关于东方红聚利债券型证券投资基金增加上海证券有限责任公司为代理销售机构并开通定投业务的公告         | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 8 月 18 日 |

|    |                                                       |           |                  |
|----|-------------------------------------------------------|-----------|------------------|
| 30 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加东兴证券股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告   | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 8 月 24 日  |
| 31 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销平台开展费率优惠活动的公告              | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 8 月 24 日  |
| 32 | 东方红聚利债券型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新                       | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 8 月 25 日  |
| 33 | 东方红聚利债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2022 年第 1 号)                  | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 8 月 25 日  |
| 34 | 东方红聚利债券型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新                       | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 8 月 25 日  |
| 35 | 东方红聚利债券型证券投资基金 2022 年中期报告                             | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 8 月 31 日  |
| 36 | 关于东方红聚利债券型证券投资基金增加上海农村商业银行作为代理销售机构并开通定投业务的公告          | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 9 月 2 日   |
| 37 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金办理转换业务及费率优惠活动规则的公告              | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 9 月 7 日   |
| 38 | 东方红聚利债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告                         | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 10 月 26 日 |
| 39 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告   | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 10 月 31 日 |
| 40 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 11 月 10 日 |
| 41 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加国泰君安证券股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 11 月 10 日 |
| 42 | 关于东方红聚利债券型证券投资基金增加华夏银行股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告         | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 11 月 16 日 |
| 43 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加苏州银行股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告   | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 11 月 30 日 |
| 44 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限                      | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 12 月 1 日  |

|    |                                                       |           |                  |
|----|-------------------------------------------------------|-----------|------------------|
|    | 公司为代理销售机构并开通定投业务的公告                                   |           |                  |
| 45 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 12 月 2 日  |
| 46 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海万得基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 12 月 15 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红聚利债券型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红聚利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红聚利债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红聚利债券型证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

### 13.3 查阅方式

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

上海东方证券资产管理有限公司



2023 年 3 月 31 日