东方金元宝货币市场基金
2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年三月二十六日

§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。

2020 年 5 月 26 日，基金管理人官网披露了《关于股权变更及增加注册资本的公告》，公司原股东河北省国有资产控股运营有限公司将所有出资转让给河北国控资本管理有限公司，新增天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）、天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）、天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）为公司股东，公司注册资本从 30,000 万元增至 33,333 万元。

基金管理人于 2020 年 8 月 20 日改制为股份有限公司，名称由东方基金管理有限责任公司变更为东方基金管理股份有限公司。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....7
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
3.2 基金净值表现.....7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....9
§4 管理人报告.....10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....20
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....20
§5 托管人报告.....21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....21
§6 审计报告.....22
6.1 审计报告基本信息.....22
6.2 审计报告的基本内容.....22
§7 年度财务报表.....24
7.1 资产负债表.....24
7.2 利润表.....25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....27
7.4 报表附注.....28
§8 投资组合报告.....56
8.1 期末基金资产组合情况.....56
8.2 债券回购融资情况.....56
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....56
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....57
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....58
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....59

8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 59
8.9 投资组合报告附注 59
§9 基金份额持有人信息 63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 63
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 63
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 63
§10 开放式基金份额变动 65
§11 重大事件揭示 66
11.1 基金份额持有人大会决议 66
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 66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 66
11.4 基金投资策略的改变 66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 66
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 66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 66
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 70
11.9 其他重大事件 70
§12 影响投资者决策的其他重要信息 77
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 77
§13 备查文件目录 78
13.1 备查文件目录 78
13.2 存放地点 78
13.3 查阅方式 78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方金元宝货币市场基金
基金简称	东方金元宝货币
基金主代码	001987
前端交易代码	001987
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 23 日
基金管理人	东方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	316,186,584.54 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在确保本金安全的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金结合自上而下和自下而上的分析，在保证资产的安全性和流动性的前提下，进行积极的投资组合管理，追求基金的长期、稳定增值。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理股份有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	李景岩	罗菲菲

人	联系电话	010-66295888	010-58560666
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95568
传真		010-66578700	010-58560798
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100033	100031
法定代表人		崔伟	高迎欣

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区南京东路 61 号四层
注册登记机构	东方基金管理股份有限公司	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	5,550,424.18	15,591,206.47	18,669,407.91
本期利润	5,550,424.18	15,591,206.47	18,669,407.91
本期净值收益率	2.2944%	2.6000%	3.6443%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末基金资产净值	316,186,584.54	246,177,029.12	592,060,432.92
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
累计净值收益率	16.7007%	14.0832%	11.1923%

注：①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

③本基金每日分配收益，按日结转份额。

3.2 基金净值表现

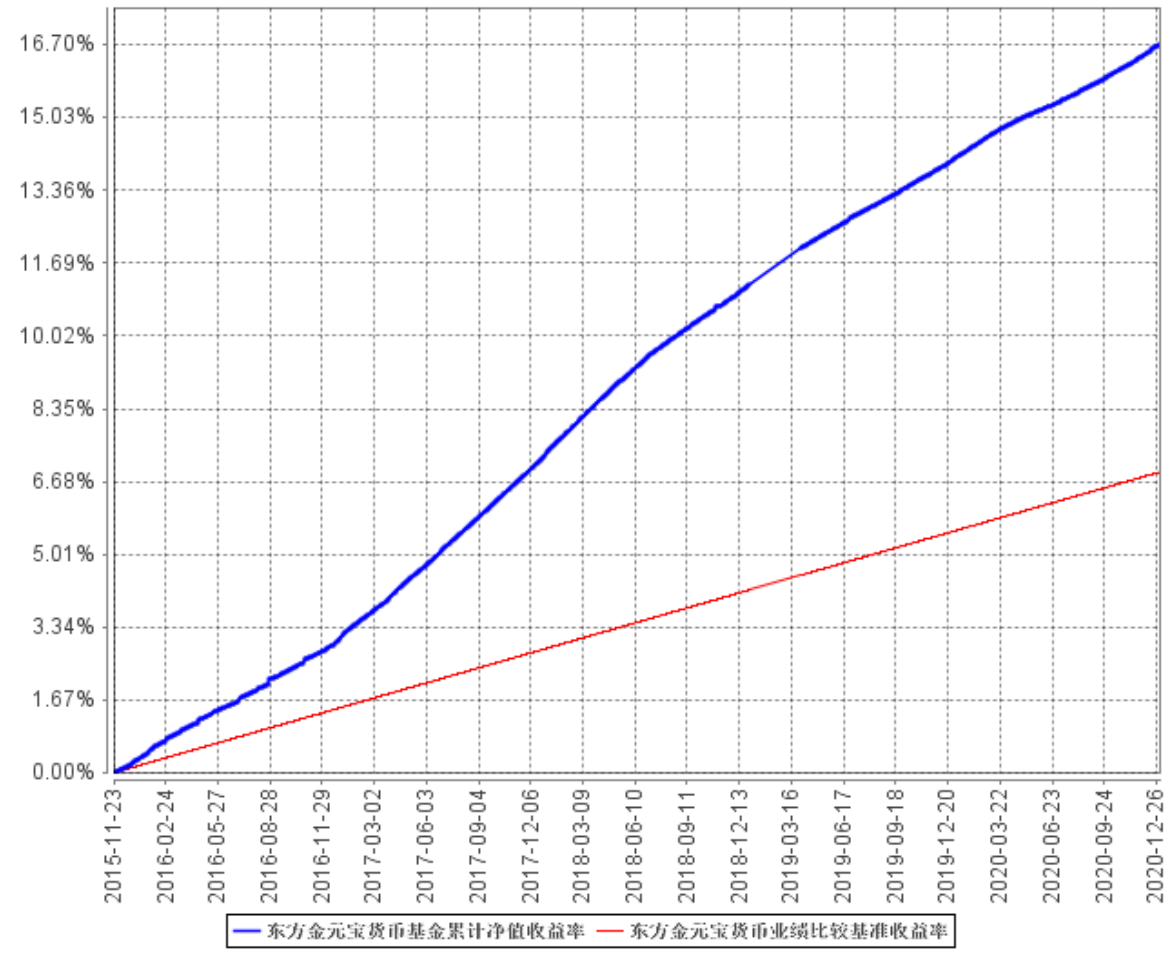
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.6334%	0.0032%	0.3393%	0.0000%	0.2941%	0.0032%
过去六个月	1.1737%	0.0028%	0.6787%	0.0000%	0.4950%	0.0028%
过去一年	2.2944%	0.0023%	1.3500%	0.0000%	0.9444%	0.0023%
过去三年	8.7788%	0.0041%	4.0500%	0.0000%	4.7288%	0.0041%
过去五年	16.3744%	0.0053%	6.7518%	0.0000%	9.6226%	0.0053%
自基金合同生效起至今	16.7007%	0.0053%	6.8961%	0.0000%	9.8046%	0.0053%

注：本基金每日分配收益，按日结转份额。

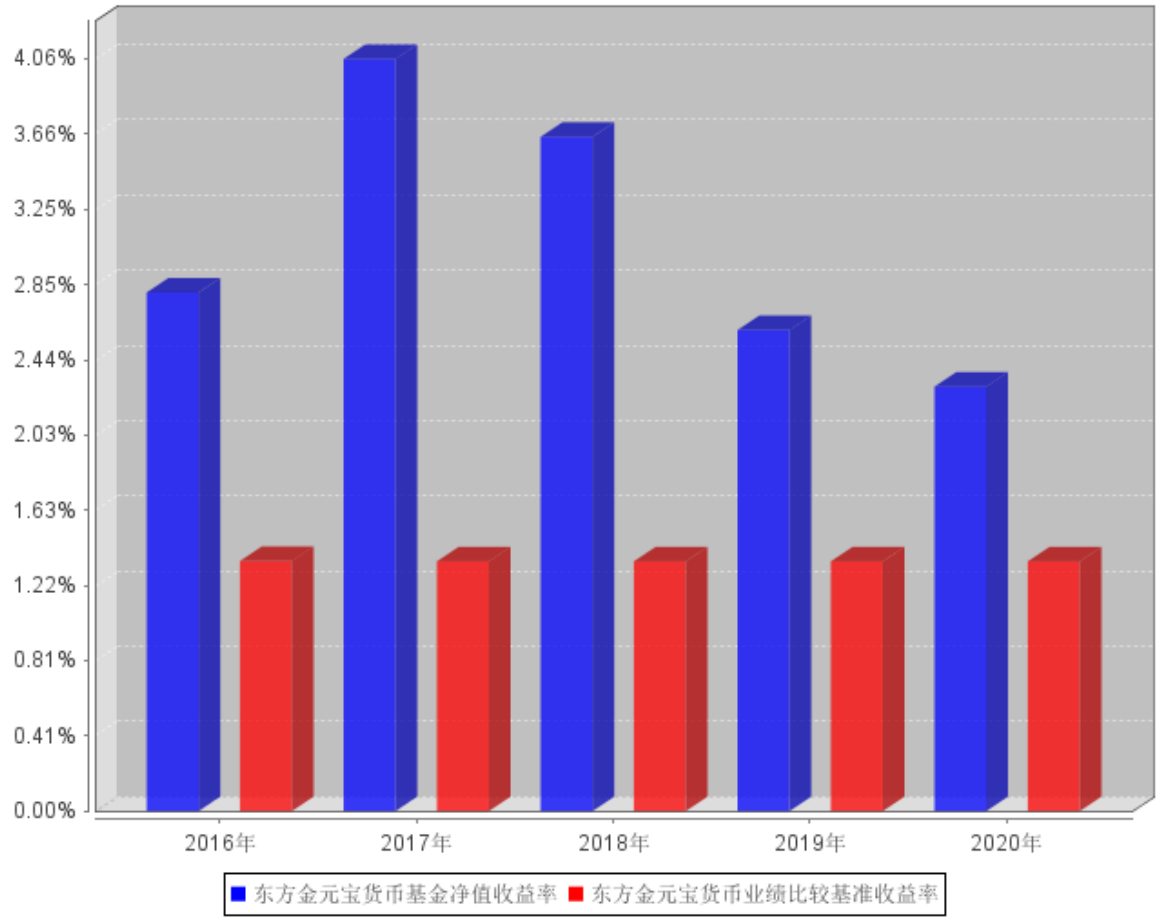
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方金元宝货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方金元宝货币过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2020	5,553,477.14	-	-3,052.96	5,550,424.18	
2019	15,617,626.90	-	-26,420.43	15,591,206.47	
2018	18,734,461.26	-	-65,053.35	18,669,407.91	
合计	39,905,565.30	-	-94,526.74	39,811,038.56	

注：本基金每日分配收益，按日结转份额。即以每万份基金份额净收益为基准，每日为基金份额持有人计算当日收益并分配，每日支付收益。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80 号”批复批准于 2004 年 6 月 11 日成立。截至 2020 年 12 月 31 日，本公司注册资本 3.3333 亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份 19200 万股，持股比例 57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份 8100 万股，持股比例 24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份 2700 万股，持股比例 8.1%；天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份 1170 万股，持股比例 3.51%；天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份 1123 万股，持有本公司股份 3.37%；天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份 1040 万股，持股比例 3.12%。

截止 2020 年 12 月 31 日，本公司管理 49 只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长回报平衡混合型证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开

放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣利混合型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑 雪 莹（女士）	本基金基金经理	2020 年 4 月 30 日	-	5 年	复旦大学财务学专业硕士，5 年证券从业经历。2015 年 7 月加盟本基金管理人，曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员，东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方金元宝货币市场基金基金经理助理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理助理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理助理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助

					理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金证通货币市场基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，现任东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。
李雅蓉（女士）	本基金基金经理助理	2020 年 7 月 23 日	-	3 年	中国人民大学梳理经济专业硕士，3 年证券从业经历。2017 年加盟本基金管理人，曾任固定收益研究研究员、

					交易部债券交易员。现任东方添益债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金证通货币市场基金的基金经理助理。
周薇（女士）	本基金基金经理	2019 年 3 月 1 日	2020 年 5 月 14 日	11 年	中国人民银行研究生部金融学博士，11 年证券从业经历，曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012 年 7 月加盟本基金管理人，曾任固定收益部债券研究员、投资经理、东方金账

					簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金(于 2017 年 8 月 23 日起转型为东方永润债券型证券投资基金)基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方永润债券型证券投资基金基金经理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理、东方永熙

					18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。
郑雪莹（女士）	本基金基金经理助理	2019 年 8 月 5 日	2020 年 4 月 29 日	5 年	复旦大学财务学专业硕士，5 年证券从业经历。2015 年 7 月加盟本基金管理人，曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员，东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方金元宝货币市场基金

					基金经理助理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理助理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理助理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金证通货币市场基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，现任东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金账簿货币市场证

					券投资基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方金元宝货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、

投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2020 年市场走势，年初至四月，债市的主导因素为疫情演进，国内货币政策持续宽松，央行调降超额存款准备金利率，收益率大幅回落，DR007 最底下行至 1.14%，10 年期国债利率一度触及 2.5%；五月以来，主导因素更多体现为后疫情期的政策发酵及资金利率的重定价，随着疫情缓和，货币政策向中性修复，机构负债压力也较大，超储率回落至历史低位；四季度信用风险事件爆发，显著冲击市场情绪，信用风险向流动性风险蔓延，国债收益率一度逼近至 3.35%，R007 加权利率上行至 3%以上，随着央行维稳叠加监管表态，流动性明显改善，债券收益率再度下行，信用利差持续扩大。截止 12 月 31 日，1 年、10 年期国债利率分别收报 2.47%、3.14%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为 2.2944%，业绩比较基准收益率为 1.3500%，高于业绩比较基准 0.9444%。

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 2021 年，低基数效应下预计基本面呈前高后低的走势，增长动力主要来自制造业投资及净出口，社融增速整体回落，信用格局偏紧；海外疫苗普及速度、PPI 走势，以及对总需求的推高仍为较大的中期影响变量。2020 年海外经济体经历了最大规模的信用扩张，如疫情有所控制、

需求释放，补库存周期将拉动商品价格大幅回升，2021 年下半年国内 PPI 的回落幅度可能不及预期（假设月均环比 0.5%，中枢超过 3%）。

货币政策方面，央行操作将偏中性，MLF 概率较大，全面降准概率较低；一方面，2020 年底中央经济会议重提“稳杠杆”以及“要稳住宏观杠杆率”，与 2019 年底会议相同；另一方面，经济持续修复，全面降准概率不大。

从利率的供需来看，发行总量回落明显，净融资额缩减也缓和了供给压力，需求端银行、境外机构仍为增持亮点。短端，随着银行结构性存款逐步压降完成，定价由存单负债定价转向资金面定价，期限利差预计有所修复；长端，面临经济复苏及 PPI 上移，利率仍未到拐点。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，开展定期和实时监察，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：（1）开展对公司各项业务的日常监察，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强基金投资运作的监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（3）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。（4）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营高管、分管投研高管、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益投资部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任 1 名，委员

会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1.委员会主任

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

2.运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

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

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3.投研部门

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

4.风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金应分配且已分配利润 5,550,424.18 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2021]第 ZB30136 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方金元宝货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东方金元宝货币市场基金（以下简称东方金元宝基金）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东方龙基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东方金元宝基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	东方金元宝基金的基金管理人东方基金管理股份有限公司（以下简称基金管理人）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人负责评估东方金元宝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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对基金管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东方金元宝基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方金元宝基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	朱锦梅	高慧丽
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号 4 层	
审计报告日期	2021 年 3 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方金元宝货币市场基金

报告截止日： 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	36,059,895.36	70,842,244.68
结算备付金		1,104,777.78	-
存出保证金		2,166.32	-
交易性金融资产	7.4.7.2	217,269,590.50	160,397,286.06
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		217,269,590.50	150,397,286.06
资产支持证券投资		-	10,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	95,713,863.58	38,852,298.28
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	636,695.39	877,808.02
应收股利		-	-
应收申购款		157,816.75	3,329.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		350,944,805.68	270,972,966.64
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 12 月 31 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		34,379,782.81	24,439,787.78
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,227.40	-
应付管理人报酬		66,236.05	59,065.95
应付托管费		26,494.43	23,626.37
应付销售服务费		39,741.63	35,439.60
应付交易费用	7.4.7.7	18,180.51	13,527.15
应交税费		9,279.56	4,793.83
应付利息		1,749.75	2,114.88
应付利润		23,529.00	26,581.96
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	184,000.00	191,000.00
负债合计		34,758,221.14	24,795,937.52
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	316,186,584.54	246,177,029.12
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		316,186,584.54	246,177,029.12
负债和所有者权益总计		350,944,805.68	270,972,966.64

注:报告截止日 2020 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.0000 元,基金份额总额 316,186,584.54 份。

7.2 利润表

会计主体：东方金元宝货币市场基金

本报告期： 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至

		2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
一、收入		7,262,762.63	19,392,007.24
1.利息收入		7,318,751.13	18,802,990.47
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,147,772.52	2,015,230.57
债券利息收入		4,068,538.00	10,892,142.13
资产支持证券利息收入		391,580.89	409,095.41
买入返售金融资产收入		1,710,859.72	5,486,522.36
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-55,988.50	589,016.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-55,988.50	433,101.45
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	155,915.32
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		1,712,338.45	3,800,800.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	610,849.45	1,528,869.44
2. 托管费	7.4.10.2.2	244,339.84	611,547.82
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	366,509.65	917,321.79
4. 交易费用	7.4.7.19	1,136.25	-
5. 利息支出		237,807.50	469,481.95
其中：卖出回购金融资产支出		237,807.50	469,481.95
6. 税金及附加		6,329.09	4,711.71

7．其他费用	7.4.7.20	245,366.67	268,868.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,550,424.18	15,591,206.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,550,424.18	15,591,206.47

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方金元宝货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	246,177,029.12	-	246,177,029.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,550,424.18	5,550,424.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	70,009,555.42	-	70,009,555.42
其中：1.基金申购款	1,565,929,507.43	-	1,565,929,507.43
2.基金赎回款	-1,495,919,952.01	-	-1,495,919,952.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-5,550,424.18	-5,550,424.18
五、期末所有者权益（基金	316,186,584.54	-	316,186,584.54

净值）			
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	592,060,432.92	-	592,060,432.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,591,206.47	15,591,206.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-345,883,403.80	-	-345,883,403.80
其中：1.基金申购款	2,630,874,111.49	-	2,630,874,111.49
2.基金赎回款	-2,976,757,515.29	-	-2,976,757,515.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-15,591,206.47	-15,591,206.47
五、期末所有者权益（基金净值）	246,177,029.12	-	246,177,029.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘鸿鹏	刘鸿鹏	王丹丹
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方金元宝货币市场基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 11 月 2 日中国证监会《关于准予东方金元宝货币市场基金注册的批复》（证监许可【2015】2441 号）和《关于东方金元宝货币

市场基金备案确认的函》（机构部函【2015】2967 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方金元宝货币市场基金基金合同》自 2015 年 11 月 16 日至 2015 年 11 月 18 日公开募集设立。本基金为货币市场基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 243,379,922.02 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字【2015】第 01300063 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方金元宝货币市场基金基金合同》于 2015 年 11 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 243,382,594.41 份基金单位，其中认购资金利息折合 2,672.39 份基金单位。本基金的基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方金元宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于：现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。

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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和中期报告》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

1.金融资产的分类

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

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

本基金持有的其他金融资产包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。

2.金融负债的分类

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

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

本基金的金融负债在初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

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

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

1.债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于交易日确认为债券投资。

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

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

2.回购协议

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

3. 同业存单

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

具体投资品种的估值方法如下：

（1）股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票，根据 2017 年 9 月 5 日中国证监会发布的【2017】13 号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》内容：如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价，如指数收益法。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值。

首次公开发行但未上市的股票采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（2）债券投资

①证券交易所上市实行净价交易的债券按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

②证券交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值。

③发行未上市流通的债券，按成本估值。

④同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

⑤在全国银行间债券市场交易的债券，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

（3）权证投资

①证券交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价估值。

②首次发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

③因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

④因认购或获配新发行的分离交易可转债而取得的债券和权证，上市日前，分别按照中国证券业协会公布的债券报价和权证报价确定当日债券和权证的估值；自上市日起，上市流通的债券

和权证分别按上述相关原则进行估值。

（4）资产支持证券等其他有价证券按国家有关规定进行估值。

（5）同业存单根据其交易场所，采用相应的估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

（1）存款利息收入：按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

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

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

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

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

（6）同业存单投资收益：于同业存单成交日确认，并按卖出同业存单成交金额与其账面价值

及相关费用的差额入账；

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

7.4.4.9 费用的确认和计量

（1）基金管理费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率逐日计提并确认。

（2）基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率逐日计提并确认。

（3）基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率逐日计提并确认。

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

（5）其他费用

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

7.4.4.10 基金的收益分配政策

（1）本基金每份基金份额享有同等分配权；

（2）本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

（3）“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；

（4）本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

（5）本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每日收益支付时，其当日净收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其当日净收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

（6）当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

（7）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

3、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，

暂不征收企业所得税。

4、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	59,895.36	842,244.68
定期存款	36,000,000.00	70,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	20,000,000.00
存款期限 3 个月以上	36,000,000.00	50,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	36,059,895.36	70,842,244.68

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	8,424,229.55	8,422,041.00	-2,188.55	-0.0007%
	银行间市场	208,845,360.95	209,116,200.00	270,839.05	0.0857%
	合计	217,269,590.50	217,538,241.00	268,650.50	0.0850%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		217,269,590.50	217,538,241.00	268,650.50	0.0850%
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债	交易所市场	-	-	-	-

券	银行间市场	150,397,286.06	150,484,450.00	87,163.94	0.0354%
	合计	150,397,286.06	150,484,450.00	87,163.94	0.0354%
资产支持证券		10,000,000.00	10,001,000.00	1,000.00	0.0004%
合计		160,397,286.06	160,485,450.00	88,163.94	0.0358%

注：①偏离金额＝影子定价－摊余成本

②偏离度＝偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	95,713,863.58	-
合计	95,713,863.58	-
项目	上年度末 2019 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	38,852,298.28	-
合计	38,852,298.28	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	38.59	142.58
应收定期存款利息	68,488.83	302,516.46
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	429.70	-
应收债券利息	528,010.70	459,929.85
应收资产支持证券利息	-	57,512.33
应收买入返售证券利息	39,726.57	57,706.80
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	1.00	-
合计	636,695.39	877,808.02

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	18,180.51	13,527.15
合计	18,180.51	13,527.15

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	184,000.00	191,000.00
合计	184,000.00	191,000.00

注：预提费用包括按日计提的审计费、信息披露费和银行间账户维护费。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	246,177,029.12	246,177,029.12
本期申购	1,565,929,507.43	1,565,929,507.43
本期赎回(以"-"号填列)	-1,495,919,952.01	-1,495,919,952.01
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	316,186,584.54	316,186,584.54

注：本期申购包含红利再投资、基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	5,550,424.18	-	5,550,424.18
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-5,550,424.18	-	-5,550,424.18
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	27,252.17	67,153.01
定期存款利息收入	1,090,960.15	1,948,077.56
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	29,550.32	-
其他	9.88	-
合计	1,147,772.52	2,015,230.57

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-55,988.50	433,101.45
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	-55,988.50	433,101.45

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	722,235,013.51	2,197,782,522.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	720,042,316.33	2,190,493,436.55
减：应收利息总额	2,248,685.68	6,855,984.57
买卖债券差价收入	-55,988.50	433,101.45

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	20,389,786.30	30,628,815.04
减：卖出资产支持证券成本总额	20,000,000.00	30,000,000.00
减：应收利息总额	389,786.30	470,899.72
资产支持证券投资收益	-	155,915.32

7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	1,136.25	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,136.25	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	62,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
账户维护费用	37,200.00	37,200.00
银行费用	33,166.67	49,668.06
合计	245,366.67	268,868.06

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东北证券股份有限公司	38,413,713.30	100.00%	20,467,143.56	100.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东北证券股份有限公司	8,000,000.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	610,849.45	1,528,869.44
其中：支付销售机构的客户维护费	153,111.79	488,823.10

注：①计提标准：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	244,339.84	611,547.82

注：①计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
东方基金管理股份有限公司	111,968.59
中国民生银行股份有限公司	31,861.85
合计	143,830.44
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
东方基金管理股份有限公司	74,461.78
中国民生银行股份有限公司	80,194.38
合计	154,656.16

注：①计提标准：基金销售费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	59,895.36	56,731.22	70,842,244.68	595,416.89

注：当期利息收入包括由关联方保管的活期存款和清算备付金产生的利息收入。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
5,553,477.14	-	-3,052.96	5,550,424.18	-

注：本基金每日分配收益，按日结转份额。即本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额净收益为基准，每日为基金份额持有人计算当日收益并分配，每日支付收益。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 34,379,782.81 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112018061	20 华夏银行 CD061	2021 年 1 月 4 日	99.52	200,000	19,904,935.27

112013120	20 浙商银行 CD120	2021 年 1 月 4 日	98.66	180,000	17,759,074.29
合计				380,000	37,664,009.56

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	59,946,688.96	10,004,598.82
合计	59,946,688.96	10,004,598.82

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	10,000,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	10,000,000.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	134,959,632.19	118,861,207.83
AAA 以下	3,936,091.03	3,970,992.19
未评级	0.00	0.00
合计	138,895,723.22	122,832,200.02

注：上述同业存单按主体评级列示。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	36,059,895.36	-	-	-	-	36,059,895.36
结算备付金	1,104,777.78	-	-	-	-	1,104,777.78
存出保证金	2,166.32	-	-	-	-	2,166.32
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融资产-债券投资	185,968,972.28	31,300,618.22	0.00	0.00	-	217,269,590.50
交易性金融资产-资产支持证券投资	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
买入返售金融资产	95,713,863.58	-	-	-	-	95,713,863.58
应收证券清算	-	-	-	-	0.00	0.00

款						
应收利息	-	-	-	-	636,695.39	636,695.39
应收股利	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	-	157,816.75	157,816.75
资产总计	318,849,675.32	31,300,618.22	0.00	0.00	794,512.14	350,944,805.68
负债						
卖出回购金融资产款	34,379,782.81	-	-	-	-	34,379,782.81
应付赎回款	-	-	-	-	9,227.40	9,227.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	66,236.05	66,236.05
应付托管费	-	-	-	-	26,494.43	26,494.43
应付交易费用	-	-	-	-	18,180.51	18,180.51
应付销售服务费	-	-	-	-	39,741.63	39,741.63
应交税费	-	-	-	-	9,279.56	9,279.56
应付利息	-	-	-	-	1,749.75	1,749.75
其他负债	-	-	-	-	207,529.00	207,529.00
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	34,379,782.81	0.00	0.00	0.00	378,438.33	34,758,221.14
利率敏感度缺口	284,469,892.51	31,300,618.22	0.00	0.00	416,073.81	316,186,584.54
上年度末 2019 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	70,842,244.68	-	-	-	-	70,842,244.68
结算备付金	0.00	-	-	-	-	0.00
存出保证金	0.00	-	-	-	-	0.00
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融资产-债券投资	130,695,074.64	19,702,211.42	0.00	0.00	-	150,397,286.06
交易性金融资产-资产支持证券投资	10,000,000.00	0.00	0.00	0.00	-	10,000,000.00
买入返售金融资产	38,852,298.28	-	-	-	-	38,852,298.28
应收证券清算款	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	877,808.02	877,808.02
应收股利	-	-	-	-	0.00	0.00

应收申购款	-	-	-	-	3,329.60	3,329.60
资产总计	250,389,617.60	19,702,211.42	0.00	0.00	881,137.62	270,972,966.64
负债						
卖出回购金融资产款	24,439,787.78	-	-	-	-	24,439,787.78
应付赎回款	-	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	59,065.95	59,065.95
应付托管费	-	-	-	-	23,626.37	23,626.37
应付交易费用	-	-	-	-	13,527.15	13,527.15
应付销售服务费	-	-	-	-	35,439.60	35,439.60
应交税费	-	-	-	-	4,793.83	4,793.83
应付利息	-	-	-	-	2,114.88	2,114.88
其他负债	-	-	-	-	217,581.96	217,581.96
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	24,439,787.78	0.00	0.00	0.00	356,149.74	24,795,937.52
利率敏感度缺口	225,949,829.82	19,702,211.42	0.00	0.00	524,987.88	246,177,029.12

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2020 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下调 0.25%	104,572.94	102,316.50
	市场利率上调 0.25%	-224,466.31	-142,325.75

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	217,269,590.50	68.72	150,397,286.06	61.09
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	10,000,000.00	4.06
合计	217,269,590.50	68.72	160,397,286.06	65.16

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动	
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步	
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2020 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数下跌 5%	0.00	0.00
	沪深 300 指数上涨 5%	0.00	0.00

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 17,570.90 元，占基金资产净值比例为 0.01%；上年度末本基金风险价值为 9,689.28 元，占基金资产净值比例为 0.00%。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	217,269,590.50	61.91
	其中：债券	217,269,590.50	61.91
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	95,713,863.58	27.27
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	37,164,673.14	10.59
4	其他各项资产	796,678.46	0.23
5	合计	350,944,805.68	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.88	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	34,379,782.81	10.87
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	40.92	10.87
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	20.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	9.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	6.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	33.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		110.74	10.87

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	8,424,229.55	2.66
2	央行票据	-	-

3	金融债券	10,002,948.77	3.16
	其中：政策性金融债	10,002,948.77	3.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	59,946,688.96	18.96
6	中期票据	-	-
7	同业存单	138,895,723.22	43.93
8	其他	-	-
9	合计	217,269,590.50	68.72
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	112092921	20 徽商银行 CD008	205,000	20,392,521.75	6.45
2	112018061	20 华夏银行 CD061	200,000	19,904,935.27	6.30
3	112021484	20 渤海银行 CD484	200,000	19,893,859.05	6.29
4	112014060	20 江苏银行 CD060	200,000	19,784,707.36	6.26
5	112013120	20 浙商银行 CD120	200,000	19,732,304.77	6.24
6	160413	16 农发 13	100,000	10,002,948.77	3.16
7	012004358	20 首旅 SCP034	100,000	10,000,220.40	3.16
8	012004328	20 闽冶金 SCP007	100,000	9,996,588.66	3.16

9	012003786	20 大唐新能 SCP005	100,000	9,994,589.59	3.16
10	012003370	20 大众交通 SCP002	100,000	9,994,360.96	3.16

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1892%
报告期内偏离度的最低值	-0.0052%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0617%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

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

本基金所持有 20 徽商银行 CD008(112092921),发行人徽商银行股份有限公司(以下简称“公司”),受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责,被中国人民银行、中国银行业监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常,上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 20 华夏银行 CD061(112018061),发行人华夏银行股份有限公司(以下简称“公司”),受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责,被中国人民银行、中国银行业监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常,上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 20 渤海银行 CD484(112021484),发行人渤海银行股份有限公司(以下简称“公

司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，被中国人民银行、中国银行业监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 20 江苏银行 CD060（112014060），发行人江苏银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 20 浙商银行 CD120（112013120），发行人浙商银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行、中国银行业监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金决策依据及投资程序：

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

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

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

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

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

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

此检讨投资策略，进而调整和优化投资组合。

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

本基金投资 20 徽商银行 CD008 主要基于以下原因：

20 徽商银行 CD008 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 20 华夏银行 CD061 主要基于以下原因：

20 华夏银行 CD061 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 20 渤海银行 CD484 主要基于以下原因：

20 渤海银行 CD484 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 20 江苏银行 CD060 主要基于以下原因：

20 江苏银行 CD060 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 20 浙商银行 CD120 主要基于以下原因：

20 浙商银行 CD120 主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,166.32
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	636,695.39
4	应收申购款	157,816.75
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	796,678.46

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
66,611	4,746.76	71,071,829.26	22.48%	245,114,755.28	77.52%

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	保险公司资管资金	52,859,349.44	16.72%
2	其他委托资金	5,012,842.64	1.59%
3	个人客户委托资金	4,921,446.29	1.56%
4	个人客户委托资金	4,104,877.37	1.30%
5	个人客户委托资金	3,788,974.11	1.20%
6	个人客户委托资金	3,484,299.58	1.10%
7	本公司资管资金	3,402,352.00	1.08%
8	个人客户委托资金	3,151,253.55	1.00%
9	个人客户委托资金	3,001,568.99	0.95%
10	本公司资管资金	2,862,220.58	0.91%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	200,559.53	0.06%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 11 月 23 日）基金份额总额	243,382,594.41
本报告期期初基金份额总额	246,177,029.12
本报告期基金总申购份额	1,565,929,507.43
减:本报告期基金总赎回份额	1,495,919,952.01
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	316,186,584.54

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2020 年 7 月 1 日，公司发布高级管理人员变更公告，自 2020 年 7 月 1 日起，聘任杨贵宾先生为公司副总经理，关洪波先生为公司副总经理。上述人员的变更已报北京监管局及中国证券投资基金业协会备案。

2020 年 8 月 24 日，公司发布高级管理人员变更公告，自 2020 年 8 月 24 日起，聘任张科先生为公司副总经理。上述人员的变更已报北京监管局及中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 55,000.00 元；截至 2020 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 5 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未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	
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证	1	-	-	-	-	-

券有限公司						
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易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

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

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

（3）本报告期内，本基金退租 3 个交易单元，分别为南京证券股份有限公司上海、深圳交易所交易单元各 1 个，国泰君安证券股份有限公司深圳交易所交易单元 1 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

东北证券股份有限公司	38,413,713.30	100.00%	8,000,000.00	100.00%	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内本基金不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方基金管理有限责任公司年度最后一日基金净值公告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 2 日
2	关于继续参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 2 日
3	关于旗下基金参与中国农业银行基金申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 4 日
4	关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 4 日
5	东方金元宝货币市场基金 2019 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 17 日

6	东方金元宝货币市场基金春节前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 21 日
7	东方金元宝货币市场基金春节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 21 日
8	关于公司旗下部分货币市场基金调整恢复代销机构申购及转换转入业务日期的公告	证券时报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 30 日
9	关于延长 2020 年春节放假及休市时间的通知	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 30 日
10	关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 10 日
11	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）(2020 年第 1 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
12	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2020 年第 1 号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
13	东方金元宝货币市场基金托管协议（2020 年 3 月修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
14	东方金元宝货币市场基金基金合同（2020 年 3 月修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
15	东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同及托管协议的公告（一）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
16	东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同及托管协议的公告（二）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 19 日
17	东方基金管理有限责任公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 27 日
18	东方金元宝货币市场基金清明节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 1 日
19	东方金元宝货币市场基金清明	上海证券报、基金管理人网	2020 年 4 月 1 日

	节前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
20	东方金元宝货币市场基金 2019 年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 17 日
21	东方金元宝货币市场基金 2020 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 22 日
22	东方基金管理有限责任公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 25 日
23	东方金元宝货币市场基金劳动节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 28 日
24	东方金元宝货币市场基金劳动节前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 28 日
25	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2020 年第 2 号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 30 日
26	东方金元宝货币市场基金 2020 年临时公告_基金经理变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 30 日
27	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）（2020 年第 2 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 30 日
28	关于增加中信证券华南股份有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 30 日
29	关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 5 月 15 日
30	东方金元宝货币市场基金 2020 年临时公告_基金经理变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 5 月 15 日
31	关于增加玄元保险代理有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 5 月 16 日
32	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）（2020 年第 3 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 5 月 16 日
33	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2020 年第 3 号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 5 月 16 日

34	关于旗下部分基金参与和合期货有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 5 月 22 日
35	关于旗下部分基金参与中国国际期货股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 5 月 22 日
36	东方基金管理有限责任公司关于暂停包商银行股份有限公司相关基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 5 月 23 日
37	东方基金管理有限责任公司关于股权变更及增加注册资本的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 5 月 26 日
38	关于东方基金管理有限责任公司在直销中心（含网上交易）开展部分基金赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 3 日
39	东方金元宝货币市场基金端午节后恢复代销机构申购及转换转入业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 22 日
40	东方金元宝货币市场基金端午节前暂停代销机构申购及转换转入业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 22 日
41	关于参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 30 日
42	东方基金管理有限责任公司半年度最后一日基金净值公告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 1 日
43	东方基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 1 日
44	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）（2020 年第 4 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 6 日
45	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2020 年第 4 号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 6 日
46	东方金元宝货币市场基金 2020 年第 2 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 7 月 21 日
47	东方基金管理股份有限公司关	中国证券报、上海证券报、	2020 年 8 月 22 日

	于公司法定名称变更的公告	证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
48	东方基金管理股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 24 日
49	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2020 年第 5 号）	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 25 日
50	东方金元宝货币市场基金招募说明书（更新）（2020 年第 5 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 25 日
51	东方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与恒泰证券申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 28 日
52	东方金元宝货币市场基金 2020 年中期报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 29 日
53	东方金元宝货币市场基金基金产品资料概要	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 31 日
54	关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 9 月 9 日
55	东方基金管理股份有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	基金管理人网站	2020 年 9 月 14 日
56	关于旗下部分基金参与中国银行申购以及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 9 月 19 日
57	关于旗下部分基金参与招商银行招赢通平台费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 9 月 30 日
58	东方金元宝货币市场基金 2020 年第 3 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 28 日
59	东方基金管理股份有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 11 日
60	东方基金管理股份有限公司关于对旗下基金持有的债券调整估值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基	2020 年 11 月 13 日

		金电子披露网站	
61	关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 20 日
62	关于增加宁波银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 27 日
63	关于旗下部分基金参与中国银河证券股份有限公司等 10 家销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 28 日
64	关于旗下部分基金参与上海天天基金销售有限公司等 48 家销售机构费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 28 日
65	东方基金管理股份有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 15 日
66	关于继续参加中国工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 18 日
67	关于继续参加中国工商银行 AI 投服务基金申购费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 18 日
68	关于继续参加中国工商银行 2020 倾心回馈基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 18 日
69	东方基金管理股份有限公司关于设立海口分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 19 日
70	关于增加东北证券股份有限公司和光大证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 22 日
71	关于旗下部分基金继续参与交通银行基金申购及定投手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基	2020 年 12 月 30 日

		金电子披露网站	
72	关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 30 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品	1	20200403 - 20200413	-	52,859,349.44	-	52,859,349.44	16.72%
产品	2	20200417 - 20200524	-	52,859,349.44	-	52,859,349.44	16.72%
产品	3	20200610 - 20200816	-	52,859,349.44	-	52,859,349.44	16.72%
产品	4	20200827	-	52,859,349.44	-	52,859,349.44	16.72%
产品	5	20200901 - 20201124	-	52,859,349.44	-	52,859,349.44	16.72%
产品特有风险							
基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。 （1）当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。 （2）当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

一、《东方金元宝货币市场基金基金合同》

二、《东方金元宝货币市场基金托管协议》

三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告

13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

13.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2021 年 3 月 26 日