

东方金证通货币市场基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 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：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| §7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 40 |
| 7.2 债券回购融资情况 | 41 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限 | 41 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 42 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 42 |

| | |
|---|-----------|
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 | 43 |
| 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细 | 43 |
| 7.9 投资组合报告附注 | 43 |
| §8 基金份额持有人信息 | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 45 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 | 46 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 46 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 46 |
| §9 开放式基金份额变动 | 46 |
| §10 重大事件揭示 | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 47 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 47 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 48 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 | 51 |
| 10.9 其他重大事件 | 51 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 56 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 56 |
| §12 备查文件目录 | 57 |
| 12.1 备查文件目录 | 57 |
| 12.2 存放地点 | 57 |
| 12.3 查阅方式 | 57 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|------------------|------------------|
| 基金名称 | 东方金证通货币市场基金 | |
| 基金简称 | 东方金证通货币 | |
| 基金主代码 | 002243 | |
| 前端交易代码 | 002243 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 3 月 18 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 | 986,861,965.80 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基 金简称 | 东方金证通货币 A | 东方金证通货币 B |
| 下属分级基金的交 易代码 | 002243 | 009976 |
| 报告期末下属分级 基金的份额总额 | 451,390,082.74 份 | 535,471,883.06 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在确保基金资产低风险和高流动性的前提下，通过基金主动的投资管理，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 | 人民币活期存款利率（税后） |
| 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 负责人 | 姓名 | 李景岩 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 010-66295888 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | xxpl@orient-fund.com | tgxxpl@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 010-66578578 或 400-628-5888 | 95568 |
| 传真 | | 010-66578700 | 010-57093382 |
| 注册地址 | | 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |
| 办公地址 | | 北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |
| 邮政编码 | | 100073 | 100031 |
| 法定代表人 | | 崔伟 | 高迎欣 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券日报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |
|--------|--------------|---------------------------------|
| 注册登记机构 | 东方基金管理股份有限公司 | 北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据 和指标 | 报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日) | | |
|-------------------|--|----------------|----------------|
| | 东方金证通货币 A | 东方金证通货币 B | |
| 本期已实现收益 | 4,490,764.82 | 7,914,295.03 | |
| 本期利润 | 4,490,764.82 | 7,914,295.03 | |
| 本期净值收益率 | 0.8910% | 1.0111% | |
| 3.1.2 期末数据 和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) | | |
| | 期末基金资产净值 | 451,390,082.74 | 535,471,883.06 |
| | 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末 指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) | | |
| | 累计净值收益率 | 17.3325% | 4.3804% |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

东方金证通货币 A

| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.1309% | 0.0041% | 0.0288% | 0.0000% | 0.1021% | 0.0041% |
| 过去三个月 | 0.4045% | 0.0026% | 0.0873% | 0.0000% | 0.3172% | 0.0026% |
| 过去六个月 | 0.8910% | 0.0022% | 0.1736% | 0.0000% | 0.7174% | 0.0022% |
| 过去一年 | 1.8924% | 0.0018% | 0.3500% | 0.0000% | 1.5424% | 0.0018% |
| 过去三年 | 6.4091% | 0.0019% | 1.0500% | 0.0000% | 5.3591% | 0.0019% |
| 自基金合同生效 起至今 | 17.3325% | 0.0030% | 2.1999% | 0.0000% | 15.1326% | 0.0030% |

东方金证通货币 B

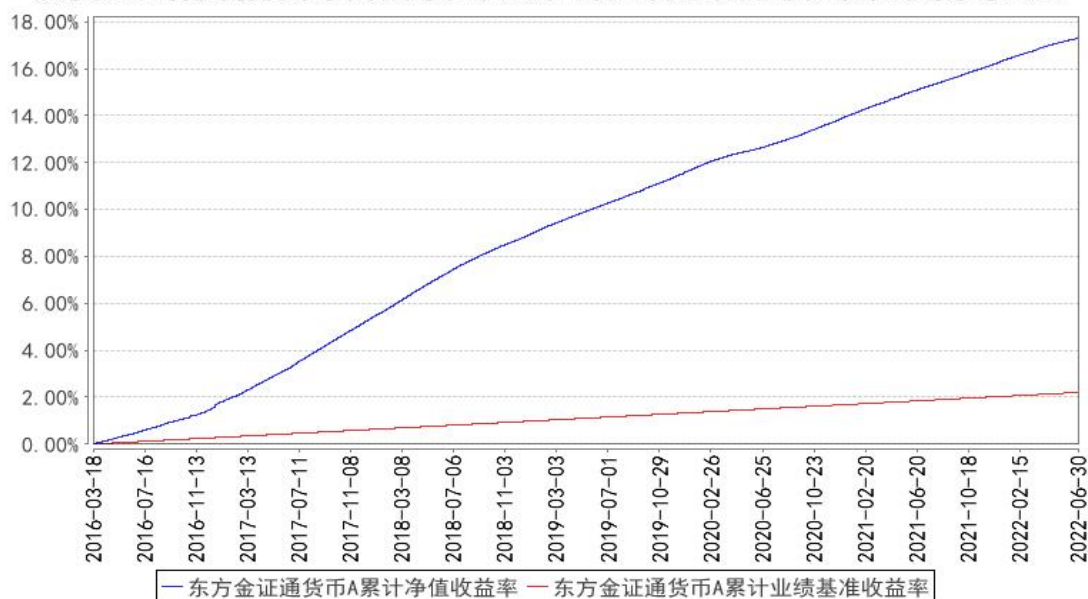
| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.1507% | 0.0041% | 0.0288% | 0.0000% | 0.1219% | 0.0041% |
| 过去三个月 | 0.4645% | 0.0026% | 0.0873% | 0.0000% | 0.3772% | 0.0026% |
| 过去六个月 | 1.0111% | 0.0022% | 0.1736% | 0.0000% | 0.8375% | 0.0022% |
| 过去一年 | 2.1375% | 0.0018% | 0.3500% | 0.0000% | 1.7875% | 0.0018% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 自基金合同生效 起至今 | 4.3804% | 0.0018% | 0.6594% | 0.0000% | 3.7210% | 0.0018% |
|----------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|

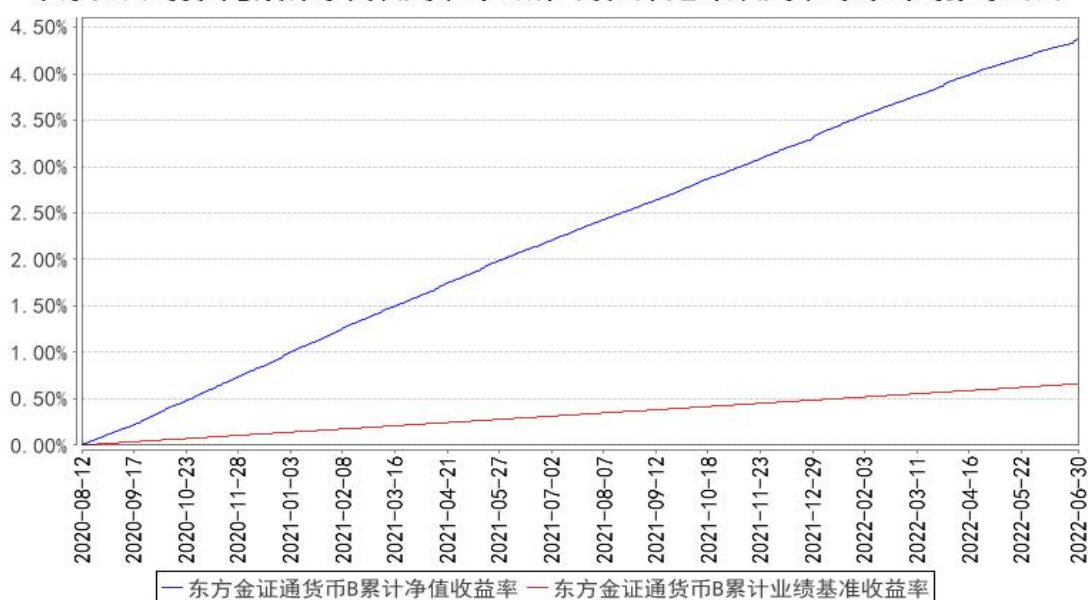
注：本基金每日分配收益，按日结转份额。

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

东方金证通货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方金证通货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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，于2004年6月11日成立。

截至2022年6月30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2022年6月30日，本公司管理57只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力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、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方成长回报平衡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、东方新兴成长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、东方主题精选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、东方鼎新灵活配置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、东方新策略灵活配置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、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金证通货币市场基金、东方互联网嘉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、东方区域发展混合型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方民丰回报赢安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、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方量化成长灵活配置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、东方臻宝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、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃3个月定期

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

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 | 本基金基金经理 | 2020 年 4 月 30 日 | - | 7 年 | 复旦大学财务学专业硕士，7 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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资

基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《东方金证通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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段同向交易价差、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。

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

4.3.2 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。

本报告期内，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

2022 年上半年，流动性宽松仍是影响债券市场的重要因素；在疫情的扰动下，基本面弱复苏和宽信用预期反复博弈。具体来看，开年以来，市场主要体现为宽货币主导下的行情，1 月 17 日

央行降低 MLF、OMO 利率 10BP，国新办金融数据发布会中提到“把货币政策工具箱开得再大一些、靠前发力”，叠加对经济较弱的预期，利率整体下行，10 年国债收益率一度向下突破 2.7%；春节后，市场的宽信用预期逐步强化，叠加 1-2 月基本面数据整体稳定、1 月金融信贷数据走强、多地房地产政策边际放松等，债券收益率整体上行，10 年国债收益率最高回归至 2.85%附近；4 月至 5 月下旬，宽松的流动性推动债券收益率下行，1Y 存单收益率、10 年国债收益率一度向下至 2.25%、2.7%；6 月以来，随着疫情缓和、复工复产的推进、叠加美债利率上行等因素，债券收益率整体上行，10 年国债收益率反弹至 2.82%附近。整体来看，曲线呈现牛平状态，短端下行明显，shibor3m 从 2021 年底 2.50%下行至 2022 半年末 2.0%的水平，长端收益率在 2.7-2.85%区间震荡。

报告期内，本基金侧重流动性管理，月末、季末等时点规模有所波动，组合整体以 3M-6M 存单为主，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

2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 0.8910%，业绩比较基准收益率为 0.1736%，高于业绩比较基准 0.7174%；本基金 B 类净值增长率为 1.0111%，业绩比较基准收益率为 0.1736%，高于业绩比较基准 0.8375%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

考虑到二季度以来，DR007 已进入与政策利率的负偏离区间，并接近历史最大偏离均值，预计本轮短端已下行至极值水平附近；预计三季度资金中枢将有所上移，长端在疫后经济弱修复、通胀上行的环境下，或将也有所盘整。未来，本基金将继续确保组合的流动性和收益的稳定性，不断调整持有人结构，提高货币基金的操作空间，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通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

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

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

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

4. 风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 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 12,405,059.85 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方金证通货币市场基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 10,546,028.76 | 102,626.71 |
| 结算备付金 | | 2,005,792.50 | - |
| 存出保证金 | | 5,541.27 | 9,931.23 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 816,392,514.66 | 800,046,943.33 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 816,392,514.66 | 800,046,943.33 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 238,835,284.89 | 330,118,575.18 |
| 债权投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | 1,685,348.61 |
| 资产总计 | | 1,067,785,162.08 | 1,131,963,425.06 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 79,735,262.69 | 10,000,000.00 |
| 应付清算款 | | 955.69 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 468,898.45 | 472,768.26 |
| 应付托管费 | | 150,047.52 | 151,285.84 |
| 应付销售服务费 | | 115,063.37 | 117,056.35 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 16,651.04 | 28,485.02 |
| 应付利润 | | 214,757.09 | 84,763.20 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 221,560.43 | 333,498.80 |
| 负债合计 | | 80,923,196.28 | 11,187,857.47 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 986,861,965.80 | 1,120,775,567.59 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | - | - |
| 净资产合计 | | 986,861,965.80 | 1,120,775,567.59 |
| 负债和净资产总计 | | 1,067,785,162.08 | 1,131,963,425.06 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 986,861,965.80 份，其中东方金证通货币 A 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 451,390,082.74 份；东方金证通货币 B 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 535,471,883.06 份。

6.2 利润表

会计主体：东方金证通货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------------|------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | 16,048,290.37 | 19,316,245.87 |
| 1. 利息收入 | | 4,296,877.37 | 18,944,724.95 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 156,566.55 | 3,541,387.25 |
| 债券利息收入 | | - | 10,555,569.68 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 4,140,310.82 | 4,847,768.02 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 11,751,413.00 | 371,520.92 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 11,751,413.00 | 371,520.92 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.12 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 3,643,230.52 | 4,157,116.29 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,696,052.62 | 1,714,181.27 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 542,736.87 | 548,537.98 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 672,623.29 | 1,120,291.60 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 565,323.51 | 606,461.73 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 565,323.51 | 606,461.73 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 9,124.19 | 12,726.97 |

| | | | |
|---------------------|----------|---------------|---------------|
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 157,370.04 | 154,916.74 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 12,405,059.85 | 15,159,129.58 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 12,405,059.85 | 15,159,129.58 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 12,405,059.85 | 15,159,129.58 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东方金证通货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|-----------------------|---------------------------------------|--------|---------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 1,120,775,567.59 | - | - | 1,120,775,567.59 |
| 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） | 1,120,775,567.59 | - | - | 1,120,775,567.59 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -133,913,601.79 | - | - | -133,913,601.79 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 12,405,059.85 | 12,405,059.85 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动 | -133,913,601.79 | - | - | -133,913,601.79 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|----------------|-------------------|
| 数 (净值减少以“-”号填列) | | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 8,139,080,351.84 | - | - | 8,139,080,351.84 |
| 2. 基金赎回款 | -8,272,993,953.63 | - | - | -8,272,993,953.63 |
| (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) | - | - | -12,405,059.85 | -12,405,059.85 |
| (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) | 986,861,965.80 | - | - | 986,861,965.80 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 851,647,903.85 | - | - | 851,647,903.85 |
| 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) | 851,647,903.85 | - | - | 851,647,903.85 |

| | | | | |
|--|--------------------|---|----------------|--------------------|
| 三、本期 增减变动 额（减少 以“-”号 填列） | 117,965,064.84 | - | - | 117,965,064.84 |
| （一）、综 合收益总 额 | - | - | 15,159,129.58 | 15,159,129.58 |
| （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） | 117,965,064.84 | - | - | 117,965,064.84 |
| 其中：1. 基金申购 款 | 11,046,170,311.13 | - | - | 11,046,170,311.13 |
| 2. 基金赎回 款 | -10,928,205,246.29 | - | - | -10,928,205,246.29 |
| （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） | - | - | -15,159,129.58 | -15,159,129.58 |
| （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） | 969,612,968.69 | - | - | 969,612,968.69 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 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 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方金证通货币市场基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 11 月 19 日中国证监会《关于准予东方金证通货币市场基金注册的批复》（证监许可【2015】2652 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《东方金证通货币市场基金基金合同》自 2016 年 3 月 14 日至 2016 年 3 月 16 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 200,054,098.90 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字【2016】第 01300004 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方金证通货币市场基金基金合同》于 2016 年 3 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,057,099.15 份基金单位，其中认购资金利息折合 3,000.25 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。

本基金自 2020 年 8 月 12 日起增加收取销售服务费的 B 类基金份额，此前已持有本基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金份额余额为 A 类基金份额。A 类基金份额指按照 0.25% 年费率计提销售服务费的基金份额类别，B 类基金份额指按照 0.01% 年费率计提销售服务费的基金份额类别。两级基金份额将分别设置基金代码，并分别公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。详情请见本公司于 2020 年 8 月 11 日刊登的《关于东方金证通货币市场基金增设 B 类基金份额并修改基金合同的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方金证通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；期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具及法律

法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述会计政策说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.2 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。对于以常规方式购买或出

售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，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。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

债券投资收益包括债券利息收入以及买卖债券价差收入。基金持有的附息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应收利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括资产支持证券利息收入以及买卖资产支持证券价差收入。基金持有的资产支持证券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应收利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

(3) 信用减值损失

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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会[2020]22 号),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。本基金在编制本中期财务报表时已采用新金融工具准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0 元,本基金执行新金融工具准则的影响如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、卖出回购金融资产款和应付利息,金额分别为人民币 102,626.71 元、人民币 0 元、人民币 9,931.23 元、人民币 330,118,575.18 元、人民币 1,685,348.61 元、人民币 10,000,000.00 元和人民币 1,123.05 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括

银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、债权投资、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、债权投资和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。债权投资确认预期信用损失准备人民币 0 元。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、债权投资、卖出回购金融资产款的金额分别为人民币 102,697.04 元、人民币 45.00 元、人民币 9,935.73 元、人民币 330,278,354.22 元、人民币 0 元、人民币 10,001,123.05 元，应收利息转入交易性金融资产为人民币 1,525,449.74 元。

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 450,750.36 |
| 等于：本金 | 450,675.86 |
| 加：应计利息 | 74.50 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | 10,095,278.40 |
| 等于：本金 | 10,000,000.00 |
| 加：应计利息 | 95,278.40 |
| 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 | 10,095,278.40 |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 10,546,028.76 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | | | |
|--------|------------------------|----------------|----------------|------------|---------|
| | 按实际利率计算的 账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) | |
| 债券 | 交易所市场 | 11,366,734.88 | 11,365,949.10 | -785.78 | -0.0001 |
| | 银行间市场 | 805,025,779.78 | 805,695,793.22 | 670,013.44 | 0.0679 |
| | 合计 | 816,392,514.66 | 817,061,742.32 | 669,227.66 | 0.0678 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |

| | | | | |
|----|----------------|----------------|------------|--------|
| 合计 | 816,392,514.66 | 817,061,742.32 | 669,227.66 | 0.0678 |
|----|----------------|----------------|------------|--------|

注：①偏离金额=影子定价-摊余成本

②偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 238,835,284.89 | - |
| 合计 | 238,835,284.89 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 58,422.08 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 58,422.08 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 163,138.35 |
| 合计 | 221,560.43 |

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东方金证通货币 A

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|----|----------------------------|------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |

| | | |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末 | 436,144,514.76 | 436,144,514.76 |
| 本期申购 | 4,345,877,330.67 | 4,345,877,330.67 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,330,631,762.69 | -4,330,631,762.69 |
| 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 | 451,390,082.74 | 451,390,082.74 |

东方金证通货币 B

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 684,631,052.83 | 684,631,052.83 |
| 本期申购 | 3,793,203,021.17 | 3,793,203,021.17 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,942,362,190.94 | -3,942,362,190.94 |
| 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 | 535,471,883.06 | 535,471,883.06 |

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东方金证通货币 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 4,490,764.82 | - | 4,490,764.82 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -4,490,764.82 | - | -4,490,764.82 |
| 本期末 | - | - | - |

东方金证通货币 B

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 7,914,295.03 | - | 7,914,295.03 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -7,914,295.03 | - | -7,914,295.03 |

| | | | |
|-----|---|---|---|
| 本期末 | - | - | - |
|-----|---|---|---|

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 2,292.18 |
| 定期存款利息收入 | 139,667.29 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 14,541.52 |
| 其他 | 65.56 |
| 合计 | 156,566.55 |

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 11,424,846.36 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 326,566.64 |
| 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 | 11,751,413.00 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 3,374,180,773.38 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,363,707,864.60 |
| 减：应计利息总额 | 10,143,692.14 |
| 减：交易费用 | 2,650.00 |
| 买卖债券差价收入 | 326,566.64 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 44,630.98 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 36,441.69 |
| 账户维护费 | 16,790.00 |
| 合计 | 157,370.04 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------|--------------------|
| 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 |

| | |
|------------|---------------|
| 东北证券股份有限公司 | 本基金管理人股东、销售机构 |
|------------|---------------|

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|------------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) |
| 东北证券股份有限公司 | 56,006,422.10 | 100.00 | 21,160,152.70 | 100.00 |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|------------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) |
| 东北证券股份有限公司 | 495,680,000.00 | 100.00 | 57,160,000.00 | 100.00 |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,696,052.62 | 1,714,181.27 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 389,218.22 | 370,367.82 |

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：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前三个工作日内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三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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 542,736.87 | 548,537.98 |

注：①计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前三个工作日内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三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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------------|-----------|------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 东方金证通货币 A | 东方金证通货币 B | 合计 |
| 东方基金管理股份有限公司 | 933.45 | 31,612.93 | 32,546.38 |
| 东北证券股份有限公司 | 510,538.63 | - | 510,538.63 |
| 合计 | 511,472.08 | 31,612.93 | 543,085.01 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |

| | 东方金证通货币 A | 东方金证通货币 B | 合计 |
|--------------|------------|-----------|------------|
| 东北证券股份有限公司 | 549,671.87 | - | 549,671.87 |
| 东方基金管理股份有限公司 | 273,117.95 | - | 273,117.95 |
| 合计 | 822,789.82 | - | 822,789.82 |

注：①计提标准：A 类基金份额和 B 类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，A 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.25% 年费率计提，B 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.01% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为各级基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费率

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|--------------|----------------------------|-----------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 450,750.36 | 13,713.18 | 138,094.65 | 533,504.75 |

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 东方金证通货币 A | | | | |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 已按再投资形式转 实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分配合计 | 备注 |
| 4,425,444.79 | - | 65,320.03 | 4,490,764.82 | - |
| 东方金证通货币 B | | | | |
| 已按再投资形式转 实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分配合计 | 备注 |
| 7,849,621.17 | - | 64,673.86 | 7,914,295.03 | - |

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。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 73,535,262.69 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 |
|-----------|-----------------|-------------------|------------|---------|---------------|
| 012280478 | 22 电网 SCP003 | 2022 年 7 月 1 日 | 100.80 | 295,000 | 29,736,449.26 |
| 170412 | 17 农发 12 | 2022 年 7 月 1 日 | 103.92 | 200,000 | 20,784,009.01 |
| 190407 | 19 农发 07 | 2022 年 7 月 1 日 | 103.05 | 279,000 | 28,750,624.18 |
| 合计 | | | | 774,000 | 79,271,082.45 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,200,000.00 元，于 2022 年 7 月 4 日到期。该交易要求本基金在回购期内持有的证

券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：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、合规法务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。

6.4.13.2 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。本基金投资于具有良好信用等级的证券，并在法律法规规定和本基金基金合同约定的基础上，进一步进行分散化投资管理。

除通过上述措施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。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 181,205,354.54 | 123,966,028.88 |
| 合计 | 181,205,354.54 | 123,966,028.88 |

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。

6.4.13.2.2 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 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 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 |

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 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 |

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 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。

6.4.13.2.5 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 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 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 |

6.4.13.2.6 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 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 564,326,125.04 | 602,291,495.15 |
| AAA 以下 | 9,959,667.01 | 9,939,584.72 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 574,285,792.05 | 612,231,079.87 |

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 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（6.4.12 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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| | | | | | | |
|-----|--------|----------|-------|-----|-----|----|
| 本期末 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年 | 不计息 | 合计 |
|-----|--------|----------|-------|-----|-----|----|

| 2022 年 6 月 30 日 | | | 年 | 以上 | | |
|--------------------------|------------------|--------------|----------|-----------|---------------|------------------|
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 10,546,028.76 | | - | - | - | 10,546,028.76 |
| 结算备付金 | 2,005,792.50 | | - | - | - | 2,005,792.50 |
| 存出保证金 | 5,541.27 | | - | - | - | 5,541.27 |
| 交易性金融资产- 股票投资 | - | | - | - | - | - |
| 交易性金融资产- 债券投资 | 816,392,514.66 | | - | - | - | 816,392,514.66 |
| 交易性金融资产- 资产支持证券投资 | - | | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 238,835,284.89 | | - | - | - | 238,835,284.89 |
| 应收清算款 | - | | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,067,785,162.08 | | - | - | - | 1,067,785,162.08 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产 款 | 79,735,262.69 | | - | - | - | 79,735,262.69 |
| 应付清算款 | - | | - | - | 955.69 | 955.69 |
| 应付赎回款 | - | | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | | - | - | 468,898.45 | 468,898.45 |
| 应付托管费 | - | | - | - | 150,047.52 | 150,047.52 |
| 应付销售服务费 | - | | - | - | 115,063.37 | 115,063.37 |
| 应交税费 | - | | - | - | 16,651.04 | 16,651.04 |
| 其他负债 | - | | - | - | 436,317.52 | 436,317.52 |
| 负债总计 | 79,735,262.69 | | - | - | 1,187,933.59 | 80,923,196.28 |
| 利率敏感度缺口 | 988,049,899.39 | | - | - | -1,187,933.59 | 986,861,965.80 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年 以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 102,626.71 | | - | - | - | 102,626.71 |
| 结算备付金 | - | | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 9,931.23 | | - | - | - | 9,931.23 |
| 交易性金融资产- 股票投资 | - | | - | - | - | - |
| 交易性金融资产- 债券投资 | 790,188,953.51 | 9,857,989.82 | - | - | - | 800,046,943.33 |
| 交易性金融资产- 资产支持证券投资 | - | | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 330,118,575.18 | | - | - | - | 330,118,575.18 |
| 应收证券清算款 | - | | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | | - | - | 1,685,348.61 | 1,685,348.61 |

| | | | | | | |
|-----------|------------------|--------------|---|---|--------------|------------------|
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,120,420,086.63 | 9,857,989.82 | - | - | 1,685,348.61 | 1,131,963,425.06 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 10,000,000.00 | - | - | - | - | 10,000,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 472,768.26 | 472,768.26 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 151,285.84 | 151,285.84 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | 73,375.75 | 73,375.75 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 117,056.35 | 117,056.35 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 28,485.02 | 28,485.02 |
| 应付利息 | - | - | - | - | 1,123.05 | 1,123.05 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 343,763.20 | 343,763.20 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 负债总计 | 10,000,000.00 | - | - | - | 1,187,857.47 | 11,187,857.47 |
| 利率敏感度缺口 | 1,110,420,086.63 | 9,857,989.82 | - | - | 497,491.14 | 1,120,775,567.59 |

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。

6.4.13.4.1.2 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 | | |
| | 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6月30日） | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 市场利率上调 0.25% | -557,774.24 | -570,358.13 |
| | 市场利率下调 0.25% | 195,363.54 | 322,426.07 |

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

本基金按照基金合同的约定和法律法规的规定进行投资，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021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 | 816,392,514.66 | 82.73 | 800,046,943.33 | 71.38 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 816,392,514.66 | 82.73 | 800,046,943.33 | 71.38 |

6.4.13.4.3.2 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 | | |
| 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6月30日） | 上年度末（2021年12月31日） | |
| 分析 | 沪深 300 指数上涨 5% | - | - |
| | 沪深 300 指数下跌 5% | - | - |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 816,392,514.66 | 800,046,943.33 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 816,392,514.66 | 800,046,943.33 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至中期报告报出日，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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|------------|----------------|---------------|
| 1 | 固定收益投资 | 816,392,514.66 | 76.46 |
| | 其中：债券 | 816,392,514.66 | 76.46 |
| | 资产支持证 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 238,835,284.89 | 22.37 |

| | | | |
|---|-----------------------|------------------|--------|
| | 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 | 12,551,821.26 | 1.18 |
| 4 | 其他各项资产 | 5,541.27 | 0.00 |
| 5 | 合计 | 1,067,785,162.08 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 4.94 | |
| | 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 | 79,735,262.69 | 8.08 |
| | 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

本基金本报告期内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。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 53 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 69 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 36 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|----------------------------|---------------------|---------------------|
| 1 | 30 天以内 | 43.56 | 8.08 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 27.36 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 10.60 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |

| | | | |
|----|----------------------------|--------|------|
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 20.84 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 5.53 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 107.89 | 8.08 |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 按实际利率计算的账面价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------------------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 11,366,734.88 | 1.15 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 49,534,633.19 | 5.02 |
| | 其中：政策性 金融债 | 49,534,633.19 | 5.02 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融 资券 | 181,205,354.54 | 18.36 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 574,285,792.05 | 58.19 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 816,392,514.66 | 82.73 |
| 10 | 剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券 | - | - |

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资 明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 按实际利率计 算的账面价值 （元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------------------|-----------|-------------------------|--------------|
| 1 | 112108156 | 21 中信银行 CD156 | 1,000,000 | 99,344,794.01 | 10.07 |
| 2 | 012280478 | 22 电网 SCP003 | 500,000 | 50,400,761.46 | 5.11 |
| 3 | 112219093 | 22 恒丰银行 CD093 | 400,000 | 39,770,189.18 | 4.03 |
| 4 | 112296842 | 22 广州农村商 业银行 CD046 | 400,000 | 39,732,013.35 | 4.03 |

| | | | | | |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|------|
| 5 | 112219129 | 22 恒丰银行 CD129 | 300,000 | 29,965,943.24 | 3.04 |
| 6 | 112298480 | 22 中原银行 CD111 | 300,000 | 29,935,165.77 | 3.03 |
| 7 | 112292661 | 22 徽商银行 CD010 | 300,000 | 29,909,934.52 | 3.03 |
| 8 | 190407 | 19 农发 07 | 279,000 | 28,750,624.18 | 2.91 |
| 9 | 170412 | 17 农发 12 | 200,000 | 20,784,009.01 | 2.11 |
| 10 | 012280185 | 22 中化股 SCP003 | 200,000 | 20,202,413.76 | 2.05 |

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0821% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0161% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0392% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

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

本基金所持有 22 恒丰银行 CD093（112219093）、22 恒丰银行 CD129（112219129），发行人恒丰银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 22 广州农村商业银行 CD046（112296842），发行人广州农村商业银行股份有限

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

本基金所持有 21 中信银行 CD156（112108156），发行人中信银行股份有限公司（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 22 中原银行 CD111（112298480），发行人中原银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 22 徽商银行 CD010（112292661），发行人徽商银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金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 22 恒丰银行 CD093 (112219093)、22 恒丰银行 CD129 (112219129)、22 广州农村商业银行 CD046 (112296842)、21 中信银行 CD156 (112108156)、22 中原银行 CD111 (112298480)、22 徽商银行 CD010 (112292661) 主要基于以下原因：

上述债券主体评级为 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 5,541.27 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,541.27 |

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------|-----------|-----------|--------------|------------|----------------|------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 东方金证 | 18,752 | 24,071.57 | 7,666,258.95 | 1.70 | 443,723,823.79 | 98.30 |

| | | | | | | |
|-----------|--------|----------------|----------------|--------|----------------|-------|
| 通货币 A | | | | | | |
| 东方金证通货币 B | 5 | 107,094,376.61 | 535,471,883.06 | 100.00 | - | - |
| 合计 | 18,757 | 52,613.00 | 543,138,142.01 | 55.04 | 443,723,823.79 | 44.96 |

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份） | 占总份额比例（%） |
|----|-------------|----------------|-----------|
| 1 | 信托公司资管资金 | 243,268,617.92 | 24.65 |
| 2 | 其他机构客户委托资金 | 202,948,181.81 | 20.57 |
| 3 | 信托公司委托资金 | 81,867,716.86 | 8.3 |
| 4 | 个人客户委托资金 | 10,628,046.16 | 1.08 |
| 5 | 个人客户委托资金 | 8,392,363.88 | 0.85 |
| 6 | 个人客户委托资金 | 5,969,889.65 | 0.6 |
| 7 | 信托公司资管资金 | 5,469,176.80 | 0.55 |
| 8 | 个人客户委托资金 | 5,003,568.05 | 0.51 |
| 9 | 个人客户委托资金 | 4,969,522.91 | 0.5 |
| 10 | 私募基金管理人资管资金 | 4,412,590.40 | 0.45 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|-----------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 东方金证通货币 A | 43,279.97 | 0.01 |
| | 东方金证通货币 B | 0.00 | 0.00 |
| | 合计 | 43,279.97 | 0.00 |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东方金证通货币 A | 东方金证通货币 B |
|-------------------------|----------------|-----------|
| 基金合同生效日 (2016年3月18日) | 200,057,099.15 | - |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 基金份额总额 | | |
| 本报告期期初基金份额总额 | 436,144,514.76 | 684,631,052.83 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4,345,877,330.67 | 3,793,203,021.17 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 4,330,631,762.69 | 3,942,362,190.94 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 451,390,082.74 | 535,471,883.06 |

注：基金总申购份额包含红利再投资、基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

2022 年 2 月 12 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，自 2022 年 2 月 11 日起，聘任许文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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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

或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 东北证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华金证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 华龙证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 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资历雄厚，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，本基金交易单元未发生变更

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------------|---------------|------------------|----------------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 东北证券股份有限公司 | 56,006,422.10 | 100.00 | 495,680,000.00 | 100.00 | - | - |
| 华金证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华龙证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 股份有限 公司 | | | | | | |
| 华泰证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 证券有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河 证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际 金融股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 证券有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|---|------------------|
| 1 | 关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 01 月 04 日 |
| 2 | 东方基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 01 月 05 日 |
| 3 | 关于增加浙商银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠的 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及 | 2022 年 01 月 07 日 |

| | | | |
|----|---|---|------------------|
| | 公告 | 中国证监会基金电子披露网站 | |
| 4 | 关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 01 月 07 日 |
| 5 | 关于增加通华财富(上海)基金销售有限公司等 3 家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 01 月 11 日 |
| 6 | 关于增加京东肯特瑞基金销售有限公司等 2 家代销机构为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 01 月 12 日 |
| 7 | 关于增加北京创金启富基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 01 月 13 日 |
| 8 | 关于增加中国民生银行股份有限公司为东方金证通货币市场基金销售机构同时开通转换业务的公告 | 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 | 2022 年 01 月 13 日 |
| 9 | 关于增加上海长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 01 月 13 日 |
| 10 | 关于增加交通银行为东方金证通货币市场基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 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 | 2022 年 01 月 18 日 |
| 11 | 东方基金管理股份有限公司关于开展直销电子交易系统基金申购费率优惠的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 01 月 20 日 |
| 12 | 关于增加爱建基金为东方金证通货币市场基金 B 份额销售机构同时开通转换业务的公告 | 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 | 2022 年 01 月 21 日 |
| 13 | 东方金证通货币市场基金 2021 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 | 2022 年 01 月 21 日 |

| | | | |
|----|--|---|------------------|
| 14 | 东方基金管理股份有限公司高级管理人员变更公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 02 月 12 日 |
| 15 | 关于增加北京中植基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 02 月 18 日 |
| 16 | 关于增加北京创金启富基金销售有限公司等 2 家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 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 | 2022 年 03 月 01 日 |
| 17 | 关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 03 月 10 日 |
| 18 | 关于增加宁波银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 03 月 10 日 |
| 19 | 关于增加北京汇成为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 03 月 17 日 |
| 20 | 关于增加天津市润泽基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 03 月 23 日 |
| 21 | 东方金证通货币市场基金 2021 年年度报告 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022 年 03 月 25 日 |
| 22 | 关于旗下部分基金参与广发证券股份有限公司等两家机构申购费率优惠的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 03 月 26 日 |
| 23 | 关于增加上海好买基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金 | 2022 年 03 月 30 日 |

| | | | |
|----|--|---|------------------|
| | 时开通定投及转换业务的公告 | 电子披露网站 | |
| 24 | 关于增加招商银行股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 03 月 30 日 |
| 25 | 关于旗下部分基金参与东方财富证券股份有限公司费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 04 月 11 日 |
| 26 | 关于旗下部分基金参与京东肯特瑞基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 04 月 11 日 |
| 27 | 关于增加青岛银行为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 04 月 13 日 |
| 28 | 关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为旗下部分基金销售机构的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 04 月 13 日 |
| 29 | 关于增加和讯信息科技有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 04 月 18 日 |
| 30 | 关于增加华夏银行为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 04 月 19 日 |
| 31 | 东方金证通货币市场基金 2022 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 | 2022 年 04 月 21 日 |
| 32 | 关于增加上海好买基金销售有限公司等 3 家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 04 月 28 日 |
| 33 | 东方金证通货币市场基金招募说明书 | 基金管理人网站及中国 | 2022 年 04 月 29 日 |

| | | | |
|----|--|---|------------------|
| | (更新)(2022 年第 1 号) | 证监会基金电子披露网站 | |
| 34 | 东方金证通货币市场基金基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022 年 04 月 29 日 |
| 35 | 关于增加珠海盈米基金销售有限公司等 2 家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 05 月 05 日 |
| 36 | 关于增加西部证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 05 月 10 日 |
| 37 | 东方基金管理股份有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 05 月 11 日 |
| 38 | 关于增加宁波银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 05 月 18 日 |
| 39 | 关于东方基金在直销中心(含网上交易)开展部分基金赎回费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 05 月 24 日 |
| 40 | 关于增加中信百信银行股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 05 月 26 日 |
| 41 | 关于增加洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 05 月 27 日 |
| 42 | 关于增加大连网金基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 05 月 30 日 |

| | | | |
|----|---|---|------------------|
| | | 露网站 | |
| 43 | 关于增加安信证券股份有限公司等三家机构为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 06 月 01 日 |
| 44 | 关于在国信证券股份有限公司等两家机构开通旗下部分基金定投及转换业务并参加申购费率优惠的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 06 月 07 日 |
| 45 | 关于增加上海万得基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 06 月 14 日 |
| 46 | 关于增加上海中正达广基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 06 月 20 日 |
| 47 | 关于增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 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 | 2022 年 06 月 22 日 |
| 48 | 东方基金直销中心办公地址及联系方式变更公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 06 月 22 日 |
| 49 | 关于增加阳光人寿保险股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、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 | 2022 年 06 月 29 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|------|----------------|------------|
|------|----------------|------------|

| 别 | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比(%) |
|--|----|------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------|
| 机构 | 1 | 20220608 - 20220627 | - | 1,197,387.78 | 1,197,387.78 | - | - |
| | 2 | 20220101 - 20220104 | 324,676,635.25 | 268,591,982.67 | 350,000,000.00 | 243,268,617.92 | 24.65 |
| | 3 | 20220629 - 20220630 | 324,676,635.25 | 268,591,982.67 | 350,000,000.00 | 243,268,617.92 | 24.65 |
| | 4 | 20220325 - 20220406 | 200,945,265.46 | 2,002,916.35 | - | 202,948,181.81 | 20.57 |
| | 5 | 20220428 - 20220505 | 200,945,265.46 | 2,002,916.35 | - | 202,948,181.81 | 20.57 |
| | 6 | 20220629 - 20220630 | 200,945,265.46 | 2,002,916.35 | - | 202,948,181.81 | 20.57 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> | | | | | | | |

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、《东方金证通货币市场基金基金合同》
- 二、《东方金证通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、基金份额净值及其临时公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

12.3 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

2022 年 8 月 31 日