

# 东方金证通货币市场基金 2024 年年度报告

2024 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：2025 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17        |
| 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       | 17        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17        |
| 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 | 17        |
| 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      | 17        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 18        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 19        |
| 7.2 利润表                                 | 21        |
| 7.3 净资产变动表                              | 22        |
| 7.4 报表附注                                | 24        |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | <b>49</b> |

|                                                        |           |
|--------------------------------------------------------|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                                   | 49        |
| 8.2 债券回购融资情况 .....                                     | 49        |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限 .....                                 | 50        |
| 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 .....                  | 50        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                             | 50        |
| 8.6 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 .....         | 51        |
| 8.7 “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 .....               | 52        |
| 8.8 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资产支持证券投资明<br>细 ..... | 52        |
| 8.9 投资组合报告附注 .....                                     | 52        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                              | <b>55</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                            | 55        |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                           | 55        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                         | 55        |
| 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情况 .....                 | 56        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                             | <b>56</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                                | <b>56</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                                 | 56        |
| 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 .....                 | 57        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                      | 57        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                                   | 57        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                            | 57        |
| 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 .....                    | 57        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                           | 57        |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                            | 61        |
| 11.9 其他重大事件 .....                                      | 61        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                        | <b>66</b> |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....               | 66        |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                                | <b>67</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                      | 67        |
| 13.2 存放地点 .....                                        | 67        |
| 13.3 查阅方式 .....                                        | 67        |

§ 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<br>额总额      | 492,645,274.36 份 |                 |
| 基金合同存续期             | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基<br>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<br>易代码     | 002243           | 009976          |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 482,641,616.40 份 | 10,003,657.96 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<br>负责人 | 姓名   | 李景岩                                 | 林盛                 |
|             | 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<br>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》                                                |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.orient-fund.com 或<br>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或办公场所                                  |

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                  | 办公地址                            |
|--------|---------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层        |
| 注册登记机构 | 东方基金管理股份有限公司        | 北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2024 年         |               | 2023 年         |                | 2022 年         |                |
|---------------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
|               | 东方金证通<br>货币 A  | 东方金证通<br>货币 B | 东方金证通<br>货币 A  | 东方金证通<br>货币 B  | 东方金证通<br>货币 A  | 东方金证通<br>货币 B  |
| 本期已实现收益       | 6,990,251.10   | 1,866,518.55  | 7,918,941.70   | 10,230,411.08  | 8,105,103.63   | 15,140,240.34  |
| 本期利润          | 6,990,251.10   | 1,866,518.55  | 7,918,941.70   | 10,230,411.08  | 8,105,103.63   | 15,140,240.34  |
| 本期净值收益率       | 1.5275%        | 1.7674%       | 1.7086%        | 1.9530%        | 1.5884%        | 1.8327%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024 年末        |               | 2023 年末        |                | 2022 年末        |                |
|               | 东方金证通<br>货币 A  | 东方金证通<br>货币 B | 东方金证通<br>货币 A  | 东方金证通<br>货币 B  | 东方金证通<br>货币 A  | 东方金证通<br>货币 B  |
| 期末基金资产净值      | 482,641,616.40 | 10,003,657.96 | 317,059,983.00 | 128,826,453.24 | 396,740,992.79 | 218,083,625.58 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000         | 1.0000        | 1.0000         | 1.0000         | 1.0000         | 1.0000         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024 年末        |               | 2023 年末        |                | 2022 年末        |                |
|               | 东方金证通<br>货币 A  | 东方金证通<br>货币 B | 东方金证通<br>货币 A  | 东方金证通<br>货币 B  | 东方金证通<br>货币 A  | 东方金证通<br>货币 B  |
| 累计净值收益率       | 21.9977%       | 9.1806%       | 20.1622%       | 7.2845%        | 18.1436%       | 5.2293%        |

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

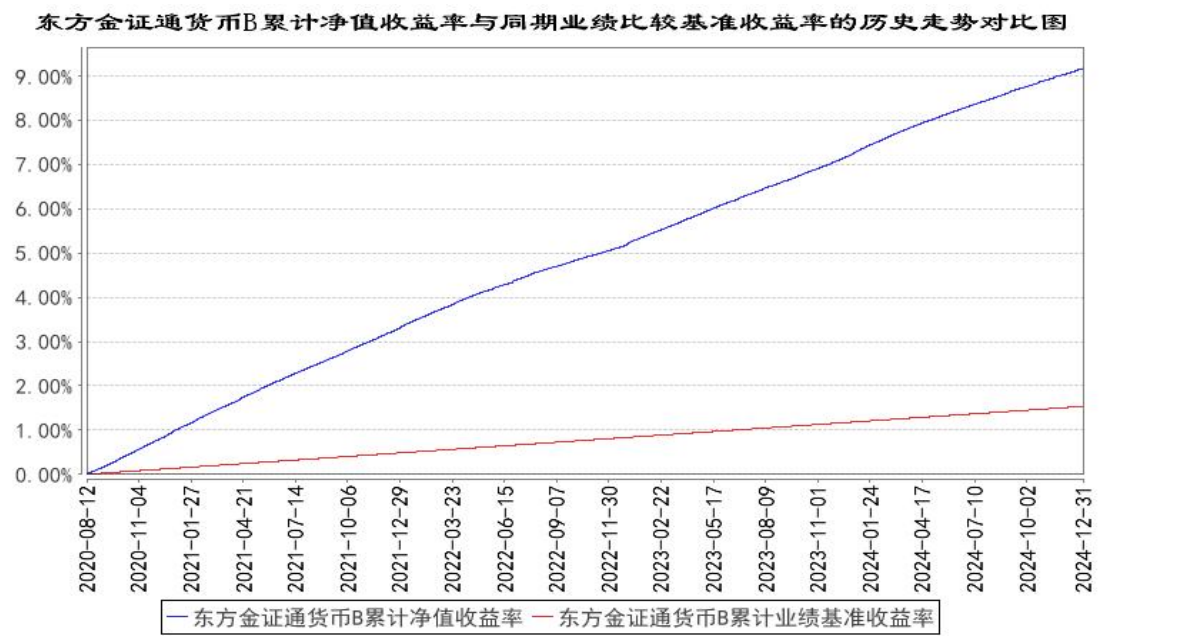
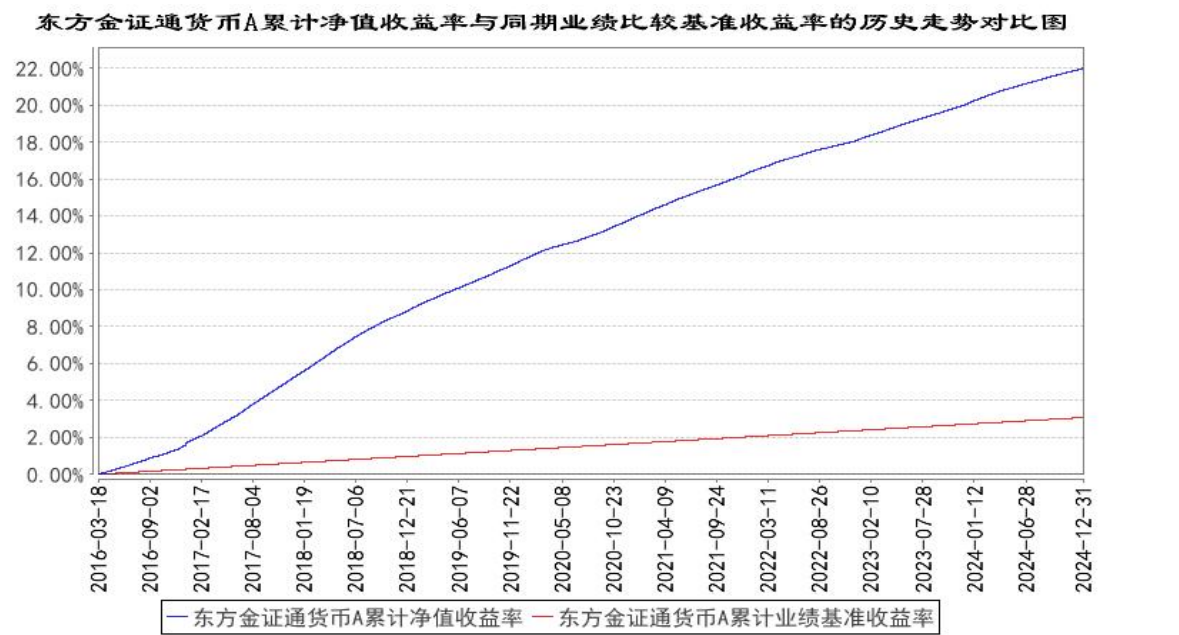
| 阶段             | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①－③      | ②－④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|---------------------------|----------|---------|
| 过去三个月          | 0.3262%      | 0.0019%             | 0.0880%        | 0.0000%                   | 0.2382%  | 0.0019% |
| 过去六个月          | 0.6782%      | 0.0021%             | 0.1760%        | 0.0000%                   | 0.5022%  | 0.0021% |
| 过去一年           | 1.5275%      | 0.0018%             | 0.3500%        | 0.0000%                   | 1.1775%  | 0.0018% |
| 过去三年           | 4.9025%      | 0.0019%             | 1.0500%        | 0.0000%                   | 3.8525%  | 0.0019% |
| 过去五年           | 9.3053%      | 0.0019%             | 1.7500%        | 0.0000%                   | 7.5553%  | 0.0019% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 21.9977%     | 0.0030%             | 3.0764%        | 0.0000%                   | 18.9213% | 0.0030% |

东方金证通货币 B

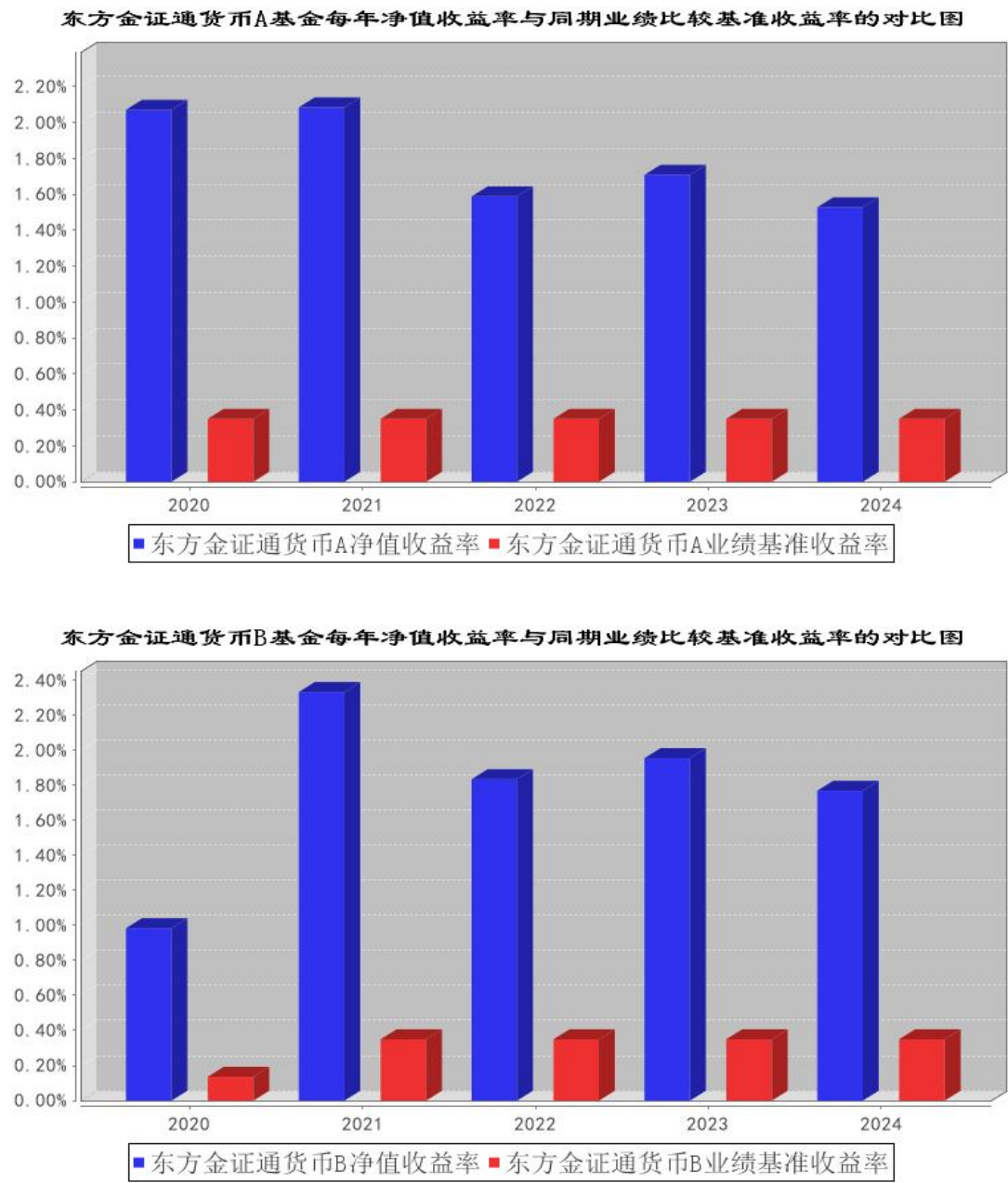
| 阶段             | 份额净<br>值收益<br>率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①－③     | ②－④     |
|----------------|------------------|---------------------|----------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去三个月          | 0.3831%          | 0.0020%             | 0.0880%        | 0.0000%                   | 0.2951% | 0.0020% |
| 过去六个月          | 0.7959%          | 0.0021%             | 0.1760%        | 0.0000%                   | 0.6199% | 0.0021% |
| 过去一年           | 1.7674%          | 0.0018%             | 0.3500%        | 0.0000%                   | 1.4174% | 0.0018% |
| 过去三年           | 5.6564%          | 0.0019%             | 1.0500%        | 0.0000%                   | 4.6064% | 0.0019% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 9.1806%          | 0.0019%             | 1.5358%        | 0.0000%                   | 7.6448% | 0.0019% |

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



3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 东方金证通货币 A |                  |                   |              |               |    |
|-----------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 年度        | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计  | 备注 |
| 2024 年    | 6,997,040.58     | -                 | -6,789.48    | 6,990,251.10  | -  |
| 2023 年    | 7,921,916.20     | -                 | -2,974.50    | 7,918,941.70  | -  |
| 2022 年    | 8,113,443.43     | -                 | -8,339.80    | 8,105,103.63  | -  |
| 合计        | 23,032,400.21    | -                 | -18,103.78   | 23,014,296.43 | -  |

东方金证通货币 B

| 年度     | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计  | 备注 |
|--------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 2024 年 | 1,875,117.97     | -                 | -8,599.42    | 1,866,518.55  | -  |
| 2023 年 | 10,235,489.68    | -                 | -5,078.60    | 10,230,411.08 | -  |
| 2022 年 | 15,179,740.29    | -                 | -39,499.95   | 15,140,240.34 | -  |
| 合计     | 27,290,347.94    | -                 | -53,177.97   | 27,237,169.97 | -  |

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，于 2004 年 6 月 11 日成立。

截至 2024 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%；海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份 1170 万股，持股比例 3.51%；海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份 1123 万股，持股比例 3.37%；海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份 1040 万股，持股比例 3.12%。

截止 2024 年 12 月 31 日，本公司管理六十余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、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金、东方锦合一年定期开放债券型发起式证券投资基金、东方享悦 90 天滚动持有债券型证券投资基金、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金、东方享誉 30 天滚动持有债券型证券投资基金、东方招益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 | 本基金基金经理、固定收益投资部副总经理、公募投资决策委员会委员 | 2020 年 4 月 30 日 | -    | 9 年    | 固定收益投资部副总经理、公募投资决策委员会委员，复旦大学财务学专业硕士，9 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、东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 裴安琪 | 本基金基金经理助理 | 2024 年 6 月 7 日   | -              | 9 年 | 北京交通大学统计学硕士，9 年证券从业经历。2015 年 7 月加盟本基金管理人，曾任公募业务部渠道管理、机构业务二部渠道管理、交易部债券交易员、交易部部门总经理助理、固定收益研究部研究员。现任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金元宝货币市场基金基金经理助理、东方金证通货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、东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理助理、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方兴润债券型证券投资基金基金经理助理、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金经理助理、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻慧纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻善纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理助理。 |
| 刘妍  | 本基金基金经理助理 | 2022 年 12 月 15 日 | 2024 年 6 月 7 日 | 7 年 | 华中科技大学会计学专业硕士，7 年证券从业经历。2017 年 3 月加盟本基金管理人，曾任交易员、信评研究员、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、东方金元宝货币市场基金基金经理助理、东方金证通货币市场基金基金经理助理、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻选                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方恒瑞短债债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻裕债券型证券投资基金基金经理助理、东方锦合一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方享悦 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理助理，现任东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻裕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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

回顾 2024 年全年，债券市场整体走强，尽管在 4 月下旬、9 月末、10 月初等时点出现调整，但收益率整体仍呈现大幅下行的态势，久期策略占优。具体来看，年初至 4 月中旬，资金平稳偏松、降准降息落地、权益市场表现偏弱、叠加债市面临资产荒的格局，债券收益率快速下行，利差持续压缩，截至 4 月 23 日，根据 wind 数据显示，中债 10 年期、30 年期国债收益率分别收报 2.22%、2.42%，分别较 2023 年末下行 33BP、40BP 左右。4 月下旬，地产放松政策陆续出台、政府债供给放量、叠加央行提示长端利率风险等因素，债券收益率快速反弹，30 年国债收益率从 4 月下旬 2.42%的低位快速上行至 5 月上旬 2.6%附近。5 月以来，手工补息被叫停后，流动性分层大幅减弱，资金面供给充裕，基本面也维持在偏弱格局，债券市场逐步修复，各期限收益率整体下行，截至 9 月 14 日，10 年期中债国债收益率下行至 2.04%附近。9 月下旬至 10 月，在权益市场大幅上涨、刺激政策频出等影响下，市场风险偏好有所提升，股债跷跷板效应明显，叠加基金赎回压力所带来的负反馈，债券收益率大幅上行，信用利差走扩，10 年国债在 2.1%-2.2%附近波

动。进入 11 月，债市围绕地方债供给、后续政策预期等展开博弈，11 月底随着存款自律协议出台，短端向下的空间打开，推动利率整体下行。12 月，政治局会议定调货币政策“适度宽松”，市场对货币宽松的预期大幅升温，叠加年末机构抢配行为，收益率快速下行，12 月 31 日长端 10 年期、30 年期国债收益率下行至 1.68%、1.91% 附近，三个月 Shibor 收于 1.69%。

报告期内，本基金月底、年末等时点面临了一定的申赎冲击，持仓以回购和 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

2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为 1.5275%，业绩比较基准收益率为 0.3500%，高于业绩比较基准 1.1775%；本基金 B 类净值增长率为 1.7674%，业绩比较基准收益率为 0.3500%，高于业绩比较基准 1.4174%。

#### 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 2025 年，预计基本面延续修复态势；财政政策仍多管齐下、定位积极、地方债放量；货币政策面临多目标制约，表现为有约束的放松，降息降准仍有空间。狭义流动性层面，存款自律协议颁布后，同业存款定价整改持续，非银活期存款、大行存款持续外流，致使银行体系融出低位、存单持续提价、叠加汇率压力，预计流动性维持中性偏紧平衡，银行缺负债问题仍存在，资金波动率提高。此外，权益市场表现偏强，政策刺激下的经济修复预期和风险偏好持续回暖，预计也将对大类资金流向带来一定分流。

后续来看，预计债券利率处于高波动、低票息的环境，债市的赚钱效应边际减弱，预计整体维持震荡调整行情，考虑到机构一致性较强，组合的流动性提升显得更为重要，票息与交易波段为较好的组合策略。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，开展定期和不定期监察，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”), 估值委员会委员包括公司总经理、分管运营高级管理人员、分管投研高级管理人员、督察长以及运营部负责人、投研部门指定负责人、合规法务部负责人、风险管理部负责人及总办会其他指定人员。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

负责召集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, 由指定的副主任代理其行使召集职责。

##### 2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法, 提出估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法及估值模型而最终确认的具体投资品种公允价值与托管行协商一致后, 对相应产品进行估值。

④负责编制相应产品持有的投资品种变更估值方法的相关公告, 协调相关部门对外发布公告, 并根据公告内容协助相关部门做好客户沟通。

⑤负责起草估值相关制度、办法等, 并履行规定流程后执行。

##### 3. 投研部门

根据现行法律法规及各产品相关法律文件, 适时评估各产品持有投资品种的现有估值政策及估值方法是否公允、适当; 对估值方法有失公允性时, 投研部门必要时可向运营部提交估值方法调整说明, 由运营部提请估值委员会召集估值会议进行审议。

##### 4. 合规法务部、风险管理部

在日常合规监控及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

部提请估值委员会召集估值会议。

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）或影子定价（适用货币基金）。

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 8,856,769.65 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》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，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约定进行。

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 | 毕马威华振审字第 2507112 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         | 东方金证通货币市场基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 审计意见            | <p>我们审计了后附的东方金证通货币市场基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表,2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“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,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>                                                                                                                                              |
| 强调事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 其他事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 其他信息            | <p>该基金管理人东方基金管理股份有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>                   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该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,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p>                                                                             |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |     |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|                 | 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |     |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称       | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     |
| 注册会计师的姓名        | 龚凯                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 楼竹君 |
| 会计师事务所的地址       | 北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |     |
| 审计报告日期          | 2025 年 3 月 28 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |     |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方金证通货币市场基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产       | 附注号     | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产:      |         |                         |                          |
| 货币资金      | 7.4.7.1 | 195,163.99              | 69,262.23                |
| 结算备付金     |         | 19,410.42               | 212,903.53               |
| 存出保证金     |         | 1,801.05                | 4,383.59                 |
| 交易性金融资产   | 7.4.7.2 | 544,142,022.73          | 370,406,146.14           |
| 其中: 股票投资  |         | -                       | -                        |
| 基金投资      |         | -                       | -                        |
| 债券投资      |         | 544,142,022.73          | 370,406,146.14           |
| 资产支持证券投资  |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资     |         | -                       | -                        |
| 其他投资      |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产    | 7.4.7.3 | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产  | 7.4.7.4 | 30,007,974.90           | 110,797,932.55           |
| 债权投资      | 7.4.7.5 | -                       | -                        |
| 其中: 债券投资  |         | -                       | -                        |
| 资产支持证券投资  |         | -                       | -                        |
| 其他投资      |         | -                       | -                        |
| 其他债权投资    |         | -                       | -                        |
| 其他权益工具投资  |         | -                       | -                        |
| 应收清算款     |         | -                       | -                        |
| 应收股利      |         | -                       | -                        |
| 应收申购款     |         | 10,005,915.28           | 2,200.00                 |
| 递延所得税资产   |         | -                       | -                        |
| 其他资产      | 7.4.7.6 | -                       | -                        |
| 资产总计      |         | 584,372,288.37          | 481,492,828.04           |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 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 |         | 91,055,018.58           | 35,006,217.06            |
| 应付清算款     |         | 143,364.44              | -                        |
| 应付赎回款     |         | -                       | -                        |
| 应付管理人报酬   |         | 120,428.42              | 152,066.32               |
| 应付托管费     |         | 38,537.06               | 48,661.24                |
| 应付销售服务费   |         | 117,129.62              | 79,815.27                |
| 应付投资顾问费   |         | -                       | -                        |
| 应交税费      |         | 2,911.36                | 9,897.76                 |
| 应付利润      |         | 13,481.45               | 28,870.35                |
| 递延所得税负债   |         | -                       | -                        |

|          |         |                |                |
|----------|---------|----------------|----------------|
| 其他负债     | 7.4.7.7 | 236,143.08     | 280,863.80     |
| 负债合计     |         | 91,727,014.01  | 35,606,391.80  |
| 净资产：     |         |                |                |
| 实收基金     | 7.4.7.8 | 492,645,274.36 | 445,886,436.24 |
| 其他综合收益   |         | -              | -              |
| 未分配利润    | 7.4.7.9 | -              | -              |
| 净资产合计    |         | 492,645,274.36 | 445,886,436.24 |
| 负债和净资产总计 |         | 584,372,288.37 | 481,492,828.04 |

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 492,645,274.36 份，其中东方金证通货币 A 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 482,641,616.40 份；东方金证通货币 B 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 10,003,657.96 份。

7.2 利润表

会计主体：东方金证通货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                           | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 |
|-------------------------------|----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 一、营业总收入                       |          | 13,279,575.37                             | 24,460,589.27                                  |
| 1. 利息收入                       |          | 1,742,602.05                              | 6,168,297.24                                   |
| 其中：存款利息收入                     | 7.4.7.10 | 115,732.17                                | 95,717.65                                      |
| 债券利息收入                        |          | -                                         | -                                              |
| 资产支持证券利<br>息收入                |          | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资<br>产收入                |          | 1,626,869.88                              | 6,072,579.59                                   |
| 其他利息收入                        |          | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”<br>填列）         |          | 11,536,973.32                             | 18,292,292.03                                  |
| 其中：股票投资收益                     | 7.4.7.11 | -                                         | -                                              |
| 基金投资收益                        |          | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                        | 7.4.7.12 | 11,536,973.32                             | 18,292,292.03                                  |
| 资产支持证券投<br>资收益                | 7.4.7.13 | -                                         | -                                              |
| 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 | -                                         | -                                              |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产<br>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） | 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、营业总支出              |            | 4,422,805.72 | 6,311,236.49  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 1,427,178.05 | 2,544,769.95  |
| 其中：暂估管理人报酬             |            | -            | -             |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 456,696.92   | 814,326.34    |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | 1,182,487.30 | 1,231,446.20  |
| 4. 投资顾问费               |            | -            | -             |
| 5. 利息支出                |            | 1,114,844.61 | 1,429,806.30  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 1,114,844.61 | 1,429,806.30  |
| 6. 信用减值损失              | 7.4.7.19   | -            | -             |
| 7. 税金及附加               |            | 4,472.14     | 13,840.93     |
| 8. 其他费用                | 7.4.7.20   | 237,126.70   | 277,046.77    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 8,856,769.65 | 18,149,352.78 |
| 减：所得税费用                |            | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 8,856,769.65 | 18,149,352.78 |
| 五、其他综合收益的税后净额          |            | -            | -             |
| 六、综合收益总额               |            | 8,856,769.65 | 18,149,352.78 |

7.3 净资产变动表

会计主体：东方金证通货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |        |       |                |
|-----------|----------------------------------------|--------|-------|----------------|
|           | 实收基金                                   | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产 | 445,886,436.24                         | -      | -     | 445,886,436.24 |
| 加：会计政策变更  | -                                      | -      | -     | -              |
| 前期差错更正    | -                                      | -      | -     | -              |
| 其他        | -                                      | -      | -     | -              |
| 二、本期期初净资产 | 445,886,436.24                         | -      | -     | 445,886,436.24 |

|                                          |                                             |        |               |                   |
|------------------------------------------|---------------------------------------------|--------|---------------|-------------------|
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 46,758,838.12                               | -      | -             | 46,758,838.12     |
| (一)、综合收益总额                               | -                                           | -      | 8,856,769.65  | 8,856,769.65      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 46,758,838.12                               | -      | -             | 46,758,838.12     |
| 其中：1. 基金申购款                              | 8,710,490,918.22                            | -      | -             | 8,710,490,918.22  |
| 2. 基金赎回款                                 | -8,663,732,080.10                           | -      | -             | -8,663,732,080.10 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                           | -      | -8,856,769.65 | -8,856,769.65     |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                           | -      | -             | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 492,645,274.36                              | -      | -             | 492,645,274.36    |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |        |               |                   |
|                                          | 实收基金                                        | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 614,824,618.37                              | -      | -             | 614,824,618.37    |
| 加：会计政策变更                                 | -                                           | -      | -             | -                 |
| 前期差错更正                                   | -                                           | -      | -             | -                 |
| 其他                                       | -                                           | -      | -             | -                 |
| 二、本期期初净资产                                | 614,824,618.37                              | -      | -             | 614,824,618.37    |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -168,938,182.13                             | -      | -             | -168,938,182.13   |
| (一)、综合收益总额                               | -                                           | -      | 18,149,352.78 | 18,149,352.78     |

|                                          |                    |   |                |                    |
|------------------------------------------|--------------------|---|----------------|--------------------|
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -168,938,182.13    | - | -              | -168,938,182.13    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 12,986,773,956.78  | - | -              | 12,986,773,956.78  |
| 2. 基金赎回款                                 | -13,155,712,138.91 | - | -              | -13,155,712,138.91 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                  | - | -18,149,352.78 | -18,149,352.78     |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                  | - | -              | -                  |
| 四、本期期末净资产                                | 445,886,436.24     | - | -              | 445,886,436.24     |

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）和《关于东方金证通货币市场基金备案确认的函》（机构部函【2016】519 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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 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；
- 该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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有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。

##### (2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金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。

#### 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

##### (1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

##### (2) 金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

### (3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

### (4) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产公允价值。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时遵循如下原则：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认利息收入。

债券投资利息收入按债券投资的账面价值与实际利率计算的金额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按实际利率法逐日计算利息收入。

债券投资收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 由于基金 A 类基金份额、B 类基金份额收取销售服务费不同，各类基金份额对应的可供分配利润将有所不同；本基金同一类别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

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方

政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 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。

d) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 195,163.99              | 69,262.23                |
| 等于：本金          | 195,101.25              | 69,235.20                |
| 加：应计利息         | 62.74                   | 27.03                    |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 等于：本金          | -                       | -                        |
| 加：应计利息         | -                       | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | -                       | -                        |
| 存款期限 3 个月以上    | -                       | -                        |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 等于：本金          | -                       | -                        |
| 加：应计利息         | -                       | -                        |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 合计             | 195,163.99              | 69,262.23                |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 |      |      |     |
|----|-------------------------|------|------|-----|
|    | 按实际利率计算的                | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 |

|        |       | 账面价值                     |                |            | (%)        |
|--------|-------|--------------------------|----------------|------------|------------|
| 债券     | 交易所市场 | 24,819,874.53            | 24,844,687.35  | 24,812.82  | 0.0050     |
|        | 银行间市场 | 519,322,148.20           | 519,974,861.24 | 652,713.04 | 0.1325     |
|        | 合计    | 544,142,022.73           | 544,819,548.59 | 677,525.86 | 0.1375     |
| 资产支持证券 |       | -                        | -              | -          | -          |
| 合计     |       | 544,142,022.73           | 544,819,548.59 | 677,525.86 | 0.1375     |
| 项目     |       | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |                |            |            |
|        |       | 按实际利率计算的<br>账面价值         | 影子定价           | 偏离金额       | 偏离度<br>(%) |
| 债券     | 交易所市场 | 11,185,643.05            | 11,146,769.87  | -38,873.18 | -0.0087    |
|        | 银行间市场 | 359,220,503.09           | 359,562,920.22 | 342,417.13 | 0.0768     |
|        | 合计    | 370,406,146.14           | 370,709,690.09 | 303,543.95 | 0.0681     |
| 资产支持证券 |       | -                        | -              | -          | -          |
| 合计     |       | 370,406,146.14           | 370,709,690.09 | 303,543.95 | 0.0681     |

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

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024 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 | 30,007,974.90            | -         |
| 合计    | 30,007,974.90            | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2023 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 | 110,797,932.55           | -         |
| 合计    | 110,797,932.55           | -         |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 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   | -                       | -                        |
| 应付交易费用      | 24,143.08               | 39,863.80                |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 24,143.08               | 39,863.80                |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提费用        | 212,000.00              | 241,000.00               |
| 合计          | 236,143.08              | 280,863.80               |

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和银行间账户维护费。

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方金证通货币 A

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|----------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额              |
| 上年度末          | 317,059,983.00                         | 317,059,983.00    |
| 本期申购          | 8,195,509,126.16                       | 8,195,509,126.16  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,029,927,492.76                      | -8,029,927,492.76 |
| 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           | 482,641,616.40                         | 482,641,616.40    |

东方金证通货币 B

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                 |
|---------------|----------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额            |
| 上年度末          | 128,826,453.24                         | 128,826,453.24  |
| 本期申购          | 514,981,792.06                         | 514,981,792.06  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -633,804,587.34                        | -633,804,587.34 |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 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           | 10,003,657.96 | 10,003,657.96 |

注：本期申购包含基金转换入、红利再投份额；赎回包含基金转换出份额。

7.4.7.9 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       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 加：会计政策变更       | -             | -     | -             |
| 前期差错更正         | -             | -     | -             |
| 其他             | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 6,990,251.10  | -     | 6,990,251.10  |
| 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        | -6,990,251.10 | -     | -6,990,251.10 |
| 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       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 加：会计政策变更       | -             | -     | -             |
| 前期差错更正         | -             | -     | -             |
| 其他             | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 1,866,518.55  | -     | 1,866,518.55  |
| 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        | -1,866,518.55 | -     | -1,866,518.55 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 1,131.37                               | 2,837.46                                    |

|           |            |           |
|-----------|------------|-----------|
| 定期存款利息收入  | 93,916.67  | -         |
| 其他存款利息收入  | -          | -         |
| 结算备付金利息收入 | 20,645.64  | 92,838.07 |
| 其他        | 38.49      | 42.12     |
| 合计        | 115,732.17 | 95,717.65 |

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 11,348,389.62               | 18,110,401.51                    |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 188,583.70                  | 181,890.52                       |
| 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                           | 11,536,973.32               | 18,292,292.03                    |

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,806,693,628.02            | 6,174,708,186.57                 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,800,263,370.57            | 6,159,278,369.67                 |
| 减：应计利息总额               | 6,241,673.75                | 15,248,573.88                    |
| 减：交易费用                 | -                           | -647.50                          |
| 买卖债券差价收入               | 188,583.70                  | 181,890.52                       |

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|---------|----------------------------------|----------------------------------|
|         | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
| 审计费用    | 33,000.00                        | 62,000.00                        |
| 信息披露费   | 120,000.00                       | 120,000.00                       |
| 证券出借违约金 | -                                | -                                |
| 银行费用    | 46,926.70                        | 60,036.27                        |
| 账户维护费   | 37,200.00                        | 34,980.00                        |
| 交易费用    | -                                | 30.50                            |
| 合计      | 237,126.70                       | 277,046.77                       |

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           |
| 海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙） | 本基金管理人股东           |
| 海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙） | 本基金管理人股东           |
| 海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙） | 本基金管理人股东           |
| 东方汇智资产管理有限公司           | 本基金管理人全资子公司        |

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。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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 | 76,176,601.78                          | 100.00          | 78,147,396.86                               | 100.00          |

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                   | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 | 1,910,098,000.00                       | 100.00            | 282,250,000.00                              | 100.00            |

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,427,178.05                           | 2,544,769.95                                |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 591,926.87                             | 853,584.93                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 835,251.18                             | 1,691,185.02                                |

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 456,696.92                             | 814,326.34                                  |

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                               |           |              |
|----------------|----------------------------------|-----------|--------------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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     | 1,010,004.93                     | -         | 1,010,004.93 |
| 东方基金管理股份有限公司   | 260.92                           | 8,224.99  | 8,485.91     |
| 中国民生银行股份有限公司   | 16.81                            | -         | 16.81        |
| 合计             | 1,010,282.66                     | 8,224.99  | 1,018,507.65 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                          |           |              |
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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     | 930,168.24                       | -         | 930,168.24   |
| 东方基金管理股份有限公司   | 315.11                           | 18,732.26 | 19,047.37    |
| 合计             | 930,483.35                       | 18,732.26 | 949,215.61   |

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、休息日，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日      |        |               |       |      |       |      |
|---------------------------------------------|--------|---------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                          | 债券交易金额 |               | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                             | 基金买入   | 基金卖出          | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国民生银行股份有限公司                                | -      | 10,058,568.63 | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |        |               |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                          | 债券交易金额 |               | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                             | 基金买入   | 基金卖出          | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| -                                           | -      | -             | -     | -    | -     | -    |

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月<br>31 日 |          | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023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 | 195,163.99                                | 1,131.37 | 69,262.23                        | 93,732.96 |

7.4.10.7 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。

7.4.11 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<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计 | 备注 |
| 6,997,040.58     | -                 | -6,789.48    | 6,990,251.10 | -  |
| 东方金证通货币 B        |                   |              |              |    |
| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计 | 备注 |
| 1,875,117.97     | -                 | -8,599.42    | 1,866,518.55 | -  |

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。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

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

截至到本报告期末 2024 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 88,005,230.33 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<br>价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|-------------------|-------------------|------------|---------|---------------|
| 112419216 | 24 恒丰银<br>行 CD216 | 2025 年 1 月 2<br>日 | 99.64      | 200,000 | 19,928,956.98 |
| 112421183 | 24 渤海银<br>行 CD183 | 2025 年 1 月 2<br>日 | 99.61      | 200,000 | 19,921,622.72 |
| 112486189 | 24 台州银<br>行 CD048 | 2025 年 1 月 2<br>日 | 99.61      | 30,000  | 2,988,355.38  |
| 112495411 | 24 江西银<br>行 CD057 | 2025 年 1 月 2<br>日 | 99.55      | 200,000 | 19,909,785.78 |
| 112495960 | 24 长沙银<br>行 CD062 | 2025 年 1 月 2<br>日 | 99.52      | 300,000 | 29,856,587.27 |
| 合计        |                   |                   |            | 930,000 | 92,605,308.13 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本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 3,049,788.25 元，于 2025 年 01 月 02 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持

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

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：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、风控部门组成的风险管理组织体系，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 20,065,963.84           | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 40,317,470.55           | 20,040,236.59            |
| 合计     | 60,383,434.39           | 20,040,236.59            |

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等。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
|--------|-------------------------|--------------------------|

|        |      |      |
|--------|------|------|
| A-1    | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级    | 0.00 | 0.00 |
| 合计     | 0.00 | 0.00 |

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                    | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                    | 0.00                     |

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 40,746,981.66           | 10,273,921.39            |
| AAA 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 10,066,560.05           | 0.00                     |
| 合计     | 50,813,541.71           | 10,273,921.39            |

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

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 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                     |

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 407,770,237.61          | 298,168,674.13           |
| AAA 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 407,770,237.61          | 298,168,674.13           |

注：上述同业存单按主体评级列示。

7.4.13.3 流动性风险

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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人严密监控基金申购赎回情况，预留充足可用现金头寸与之相匹配。本基金所持资产大部分可在证券交易所或银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告（期末本基金持有的流通受限证券）的列示。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、计算并预留最优现金头寸；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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024 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                      |            |          |       |       |     |            |
| 货币资金                    | 195,163.99 | -        | -     | -     | -   | 195,163.99 |

|                          |                |               |       |       |               |                |
|--------------------------|----------------|---------------|-------|-------|---------------|----------------|
| 结算备付金                    | 19,410.42      | -             | -     | -     | -             | 19,410.42      |
| 存出保证金                    | 1,801.05       | -             | -     | -     | -             | 1,801.05       |
| 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             | 501,900,726.23 | 42,241,296.50 | -     | -     | -             | 544,142,022.73 |
| 交易性金融资产-资产支持证券投资         | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 衍生金融资产                   | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 买入返售金融资产                 | 30,007,974.90  | -             | -     | -     | -             | 30,007,974.90  |
| 应收清算款                    | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 应收股利                     | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 应收申购款                    | -              | -             | -     | -     | 10,005,915.28 | 10,005,915.28  |
| 递延所得税资产                  | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 其他资产                     | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 资产总计                     | 532,125,076.59 | 42,241,296.50 | -     | -     | 10,005,915.28 | 584,372,288.37 |
| 负债                       |                |               |       |       |               |                |
| 短期借款                     | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 交易性金融负债                  | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 衍生金融负债                   | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 卖出回购金融资产款                | 91,055,018.58  | -             | -     | -     | -             | 91,055,018.58  |
| 应付清算款                    | -              | -             | -     | -     | 143,364.44    | 143,364.44     |
| 应付赎回款                    | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 应付管理人报酬                  | -              | -             | -     | -     | 120,428.42    | 120,428.42     |
| 应付托管费                    | -              | -             | -     | -     | 38,537.06     | 38,537.06      |
| 应付销售服务费                  | -              | -             | -     | -     | 117,129.62    | 117,129.62     |
| 应付投资顾问费                  | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 应交税费                     | -              | -             | -     | -     | 2,911.36      | 2,911.36       |
| 应付利润                     | -              | -             | -     | -     | 13,481.45     | 13,481.45      |
| 递延所得税负债                  | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 其他负债                     | -              | -             | -     | -     | 236,143.08    | 236,143.08     |
| 负债总计                     | 91,055,018.58  | -             | -     | -     | 671,995.43    | 91,727,014.01  |
| 利率敏感度缺口                  | 441,070,058.01 | 42,241,296.50 | -     | -     | 9,333,919.85  | 492,645,274.36 |
| 上年度末<br>2023 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                       |                |               |       |       |               |                |
| 货币资金                     | 69,262.23      | -             | -     | -     | -             | 69,262.23      |
| 结算备付金                    | 212,903.53     | -             | -     | -     | -             | 212,903.53     |
| 存出保证金                    | 4,383.59       | -             | -     | -     | -             | 4,383.59       |
| 交易性金融资产-股票投资             | -              | -             | -     | -     | -             | -              |
| 交易性金融资产-债券               | 360,374,255.93 | 10,031,890.21 | -     | -     | -             | 370,406,146.14 |

|            |                |               |  |  |             |                |
|------------|----------------|---------------|--|--|-------------|----------------|
| 投资         |                |               |  |  |             |                |
| 交易性金融资产-资产 |                |               |  |  |             |                |
| 支持证券投资     |                |               |  |  |             |                |
| 衍生金融资产     |                |               |  |  |             |                |
| 买入返售金融资产   | 110,797,932.55 |               |  |  |             | 110,797,932.55 |
| 应收清算款      |                |               |  |  |             |                |
| 应收股利       |                |               |  |  |             |                |
| 应收申购款      |                |               |  |  | 2,200.00    | 2,200.00       |
| 递延所得税资产    |                |               |  |  |             |                |
| 其他资产       |                |               |  |  |             |                |
| 资产总计       | 471,458,737.83 | 10,031,890.21 |  |  | 2,200.00    | 481,492,828.04 |
| 负债         |                |               |  |  |             |                |
| 短期借款       |                |               |  |  |             |                |
| 交易性金融负债    |                |               |  |  |             |                |
| 衍生金融负债     |                |               |  |  |             |                |
| 卖出回购金融资产款  | 35,006,217.06  |               |  |  |             | 35,006,217.06  |
| 应付清算款      |                |               |  |  |             |                |
| 应付赎回款      |                |               |  |  |             |                |
| 应付管理人报酬    |                |               |  |  | 152,066.32  | 152,066.32     |
| 应付托管费      |                |               |  |  | 48,661.24   | 48,661.24      |
| 应付销售服务费    |                |               |  |  | 79,815.27   | 79,815.27      |
| 应付投资顾问费    |                |               |  |  |             |                |
| 应交税费       |                |               |  |  | 9,897.76    | 9,897.76       |
| 应付利润       |                |               |  |  | 28,870.35   | 28,870.35      |
| 递延所得税负债    |                |               |  |  |             |                |
| 其他负债       |                |               |  |  | 280,863.80  | 280,863.80     |
| 负债总计       | 35,006,217.06  |               |  |  | 600,174.74  | 35,606,391.80  |
| 利率敏感度缺口    | 436,452,520.77 | 10,031,890.21 |  |  | -597,974.74 | 445,886,436.24 |

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                                         |                             |                        |
|----|---------------------------------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 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（2024 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率上调 0.25%                                            | -491,408.24                 | -233,628.14            |

|  |                      |            |            |
|--|----------------------|------------|------------|
|  | 市 场 利 率 下 调<br>0.25% | 269,014.29 | 172,999.83 |
|--|----------------------|------------|------------|

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，所面临的重大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 |                  | 上年度末<br>2023年12月31日 |                  |
|---------------|-------------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>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  | 544,142,022.73          | 110.45           | 370,406,146.14      | 83.07            |
| 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            | 544,142,022.73          | 110.45           | 370,406,146.14      | 83.07            |

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（2024 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 沪深 300 指数上涨 5% | 0.00                        | 0.00                   |
|    | 沪深 300 指数下跌 5% | 0.00                        | 0.00                   |

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 544,142,022.73          | 370,406,146.14           |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 544,142,022.73          | 370,406,146.14           |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期及上年度可比期间无第三层次公允价值余额及变动。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

本基金本报告期末及上年度末无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本年度报告报出日，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            | 544,142,022.73 | 93.12        |
|    | 其中：债券             | 544,142,022.73 | 93.12        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 30,007,974.90  | 5.14         |
|    | 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      | 214,574.41     | 0.04         |
| 4  | 其他各项资产            | 10,007,716.33  | 1.71         |
| 5  | 合计                | 584,372,288.37 | 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 | 9.68          |
|    | 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 | 91,055,018.58 | 18.48         |
|    | 其中：买断式回购融资   | -             | -             |

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 98  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 105 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 49  |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 120 天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 14.54              | 18.48              |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 10.15              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 36.40              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 20.31              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 34.87              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 合计 |                        | 116.27             | 18.48              |

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                 | 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                 | 4,753,910.69   | 0.96         |
| 2  | 央行票据                 | -              | -            |
| 3  | 金融债券                 | 81,233,843.83  | 16.49        |
|    | 其中：政策性金融债            | 20,420,898.33  | 4.15         |
| 4  | 企业债券                 | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 40,317,470.55  | 8.18         |
| 6  | 中期票据                 | 10,066,560.05  | 2.04         |
| 7  | 同业存单                 | 407,770,237.61 | 82.77        |
| 8  | 其他                   | -              | -            |
| 9  | 合计                   | 544,142,022.73 | 110.45       |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -              | -            |

8.6 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  | 112420207 | 24 广发银行 CD207    | 500,000 | 49,851,432.72   | 10.12        |
| 2  | 112411097 | 24 平安银行 CD097    | 500,000 | 49,672,300.87   | 10.08        |
| 3  | 112403168 | 24 农业银行 CD168    | 500,000 | 49,538,730.02   | 10.06        |
| 4  | 112495960 | 24 长沙银行 CD062    | 300,000 | 29,856,587.27   | 6.06         |
| 5  | 2228013   | 22 渤海银行小微债       | 200,000 | 20,459,161.64   | 4.15         |
| 6  | 240543    | 24 中证 S2         | 200,000 | 20,065,963.84   | 4.07         |
| 7  | 112499290 | 24 广西北部湾银行 CD141 | 200,000 | 19,939,150.15   | 4.05         |
| 8  | 112419216 | 24 恒丰银行 CD216    | 200,000 | 19,928,956.98   | 4.05         |
| 9  | 112486189 | 24 台州银行 CD048    | 200,000 | 19,922,369.20   | 4.04         |
| 10 | 112421183 | 24 渤海银行 CD183    | 200,000 | 19,921,622.72   | 4.04         |

8.7 “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 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.1375%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0062% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0466%  |

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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

8.9.2 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 24 广发银行 CD207（112420207.IB），发行人广发银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行职责、公司运作，治理违规、违规经营、违反票据管理规定等，被国家金融监督管理总局、国家外汇管理局、中国证券监督管理委员会公开处罚。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 24 平安银行 CD097（112411097.IB），发行人平安银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行职责、公司运作，治理违规等，被国家金融监督管理总局、中国证券监督管理委员会公开处罚。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 24 农业银行 CD168（112403168.IB），发行人中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因公司运作，治理违规、未依法履行职责、违规经营等，被国家金融监督管理总局、国家外汇管理局、中国证券监督管理委员会、中国人民银行公开处罚。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 24 长沙银行 CD062（112495960.IB），发行人长沙银行股份有限公司（以下简

称“公司”), 受到行政处罚。公司因公司运作, 治理违规、未依法履行职责等, 被国家金融监督管理总局、中国人民银行公开处罚。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 渤海银行小微债 (2228013. IB)、24 渤海银行 CD183 (112421183. IB), 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。公司因未依法履行职责等, 被国家金融监督管理总局公开处罚。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 24 中证 S2 (240543. SH), 发行人中信证券股份有限公司 (以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因公司运作, 治理违规、未依法履行职责、特定重大事项披露违规、业绩预告 (快报) 公告违规等, 被中国证券监督管理委员会、北京证券交易所、深圳证券交易所、上海证券交易所公开处罚。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 24 广西北部湾银行 CD141 (112499290. IB), 发行人广西北部湾银行股份有限公司 (以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因公司未依法履行职责、公司运作, 治理违规等, 被国家外汇管理局、国家金融监督管理总局公开处罚。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 24 恒丰银行 CD216 (112419216. IB), 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。公司因未依法履行职责、特定重大事项披露违规、公司运作, 治理违规等, 被国家金融监督管理总局公开处罚。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 24 台州银行 CD048 (112486189. IB), 发行人台州银行股份有限公司 (以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因未依法履行职责、公司运作, 治理违规等, 被国家金融监督管理总局、国家外汇管理局公开处罚。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, 由固定收益研究部负责, 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支持, 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 24 广发银行 CD207 (112420207. IB)、24 平安银行 CD097 (112411097. IB)、24 农业银行 CD168 (112403168. IB)、24 长沙银行 CD062 (112495960. IB)、22 渤海银行小微债 (2228013. IB)、24 渤海银行 CD183 (112421183. IB)、24 广西北部湾银行 CD141 (112499290. IB)、24 恒丰银行 CD216 (112419216. IB)、24 台州银行 CD048 (112486189. IB) 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。

本基金投资 24 中证 S2 (240543. SH) 基于以下原因：

公司为中信集团旗下重要金融平台，外部支持能力强。公司作为国内大型综合性券商之一，业务牌照齐全，多项经营指标位于首位，盈利能力强，备用流动性充足，信用风险可控，具备投资价值。

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

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额            |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | 1,801.05      |
| 2  | 应收清算款 | -             |
| 3  | 应收利息  | -             |
| 4  | 应收申购款 | 10,005,915.28 |
| 5  | 其他应收款 | -             |
| 6  | 待摊费用  | -             |
| 7  | 其他    | -             |
| 8  | 合计    | 10,007,716.33 |

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别          | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 东方金证<br>通货币 A | 17,675           | 27,306.46     | 12,574,455.69 | 2.61              | 470,067,160.71 | 97.39                 |
| 东方金证<br>通货币 B | 2                | 5,001,828.98  | 10,003,657.96 | 100.00            | 0.00           | 0.00                  |
| 合计            | 17,677           | 27,869.28     | 22,578,113.65 | 4.58              | 470,067,160.71 | 95.42                 |

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  | 个人    | 13,194,239.61 | 2.68      |
| 2  | 券商类机构 | 10,005,812.50 | 2.03      |
| 3  | 信托类机构 | 10,000,052.27 | 2.03      |
| 4  | 个人    | 6,840,750.79  | 1.39      |
| 5  | 个人    | 5,843,197.99  | 1.19      |
| 6  | 个人    | 5,733,170.60  | 1.16      |
| 7  | 个人    | 5,117,109.97  | 1.04      |
| 8  | 个人    | 4,877,907.15  | 0.99      |
| 9  | 个人    | 4,258,473.27  | 0.86      |
| 10 | 个人    | 3,889,045.54  | 0.79      |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目            | 份额级别      | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|---------------|-----------|-----------|-------------|
| 基金管<br>理人所有从业 | 东方金证通货币 A | 16,865.63 | 0.00        |
|               | 东方金证通货币 B | 0.00      | 0.00        |

|         |    |           |      |
|---------|----|-----------|------|
| 人员持有本基金 |    |           |      |
|         | 合计 | 16,865.63 | 0.00 |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 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                 |

§ 10 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<br>（2016 年 3 月 18 日）<br>基金份额总额 | 200,057,099.15   | —              |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 317,059,983.00   | 128,826,453.24 |
| 本报告期基金总申购份额                            | 8,195,509,126.16 | 514,981,792.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | 8,029,927,492.76 | 633,804,587.34 |
| 本报告期基金拆分变动份额                           | —                | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 482,641,616.40   | 10,003,657.96  |

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，无涉及基金管理人的重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及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

本基金于 2024 年 1 月 1 日将为基金提供审计服务的会计师事务所由立信会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已经履行了必要的程序。本年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 33,000.00 元；截至 2024 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 交易单元数量 | 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 (%) |    |
| 渤海证券股份有限公司 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东北证券股份有限公司 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 方正证券股份有限   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |

| 公司           |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 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 | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | 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资质雄厚，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。最近一年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚，或处罚未对其研究服务业务产生重大影响；④合规风控能力较强，具备健全的风险管理机制、合规管理机制和信息管理机制；⑤具备为公募基金提供交易服务所需的业务资格，能够提供高效、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具备为公募基金提供研究服务所需的业务资格，建立完善的研究报告质量控制和合规保障机制，具备独立客观的研究观点，能够提供各类研究服务支持，形式包括但不限于线上/线下路演、线上/线下会议、沟通交流、调研活动、数据支持、专题研讨、委托课题、金股推介等；⑦证监系统白名单券商优先纳入合作对象；⑧证监会券商分类标准原则上 CCC 级以下不纳入合作对象；⑨收取的佣金率满足各项法律法规、监管政策的相关规定。

券商选择程序：每年定期根据已租用交易单元的券商提供的资质说明，经交易佣金管理小组审议通过后，建立公司内部券商白名单。如有新增券商，在履行上述程序通过后，可不定期加入公司内部白名单。

(3) 本报告期内本基金交易单元未发生变化。

(4) 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

2024 年 7 月 1 日前，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。自 2024 年 7 月 1 日起，券商仅为本基金提供交易单元租用以及研究服务。

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(%) |
| 渤海证券股份 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |

|            |               |        |                  |        |   |   |
|------------|---------------|--------|------------------|--------|---|---|
| 有限公司       |               |        |                  |        |   |   |
| 东北证券股份有限公司 | 76,176,601.78 | 100.00 | 1,910,098,000.00 | 100.00 | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 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 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | -             | -      | -                | -      | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | -             | -      | -                | -      | - | - |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 司            |   |   |   |   |   |   |
| 招商证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

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  | 东方基金管理股份有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告                      | 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 | 2024 年 1 月 2 日  |
| 2  | 东方金证通货币市场基金 2023 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                       | 2024 年 1 月 20 日 |
| 3  | 关于增加上海大智慧基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时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 | 2024 年 2 月 5 日  |
| 4  | 东方金证通货币市场基金暂停 500 万元以上（不含 500 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告 | 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                  | 2024 年 2 月 6 日  |
| 5  | 东方金证通货币市场基金恢复 500 万以上申购、转换转入、定期定额投资               | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金                        | 2024 年 2 月 7 日  |

|    | 公告                                                  | 电子披露网站                                      |                 |
|----|-----------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|
| 6  | 东方基金管理股份有限公司关于终止和合期货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 | 2024 年 2 月 23 日 |
| 7  | 关于提醒投资者防范不法分子仿冒我司名义从事诈骗活动的公告                        | 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 | 2024 年 2 月 23 日 |
| 8  | 关于旗下部分基金参与深圳前海微众银行股份有限公司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 | 2024 年 2 月 29 日 |
| 9  | 东方金证通货币市场基金暂停 5000 万元以上（不含 5000 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告 | 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                  | 2024 年 3 月 5 日  |
| 10 | 关于增加江苏银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构并参加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 | 2024 年 3 月 14 日 |
| 11 | 关于旗下部分基金参与玄元保险代理有限公司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 | 2024 年 3 月 15 日 |
| 12 | 关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司等两家机构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 | 2024 年 3 月 27 日 |
| 13 | 东方金证通货币市场基金 2023 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                       | 2024 年 3 月 30 日 |
| 14 | 东方金证通货币市场基金暂停 500 万元以上（不含 500 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告   | 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                  | 2024 年 4 月 1 日  |
| 15 | 东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告             | 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 | 2024 年 4 月 2 日  |

|    |                                                     |                                             |                 |
|----|-----------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|
|    |                                                     | 露网站                                         |                 |
| 16 | 东方金证通货币市场基金暂停 5000 万元以上（不含 5000 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告 | 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                  | 2024 年 4 月 3 日  |
| 17 | 东方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资北交所股票及相关风险提示的公告                 | 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 | 2024 年 4 月 10 日 |
| 18 | 东方金证通货币市场基金 2024 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                       | 2024 年 4 月 20 日 |
| 19 | 东方金证通货币市场基金暂停 500 万元以上（不含 500 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告   | 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                  | 2024 年 4 月 26 日 |
| 20 | 东方金证通货币市场基金暂停 5000 万元以上（不含 5000 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告 | 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                  | 2024 年 4 月 29 日 |
| 21 | 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                       | 2024 年 4 月 30 日 |
| 22 | 东方金证通货币市场基金招募说明书（更新）（2024 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                       | 2024 年 4 月 30 日 |
| 23 | 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、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       | 2024 年 5 月 21 日 |
| 24 | 关于增加北京雪球基金销售有限公司为公司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 | 2024 年 5 月 29 日 |
| 25 | 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                       | 2024 年 6 月 27 日 |
| 26 | 关于增加国联证券股份有限公司等两家机构为东方基金旗下部分基金销售机构的公告               | 证券时报、证券日报、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       | 2024 年 7 月 18 日 |
| 27 | 东方金证通货币市场基金 2024 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                       | 2024 年 7 月 19 日 |
| 28 | 关于增加贵州省贵文文化基金销售有                                    | 证券时报、证券日报、                                  | 2024 年 8 月 5 日  |

|    |                                                                            |                                             |                 |
|----|----------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|
|    | 限公司为公司旗下部分基金销售机构同时参与申购费率优惠活动的公告                                            | 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           |                 |
| 29 | 关于增加中信证券股份有限公司等四家机构为东方基金旗下部分基金销售机构的公告                                      | 证券时报、证券日报、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       | 2024 年 8 月 6 日  |
| 30 | 东方基金管理股份有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司、中国国际期货股份有限公司、中民财富基金销售（上海）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 | 2024 年 8 月 12 日 |
| 31 | 关于增加国投证券股份有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构的公告                                           | 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      | 2024 年 8 月 15 日 |
| 32 | 关于增加民商基金销售（上海）有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时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 | 2024 年 8 月 21 日 |
| 33 | 东方基金管理股份有限公司关于设立深圳分公司的公告                                                   | 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 | 2024 年 8 月 27 日 |
| 34 | 东方金证通货币市场基金 2024 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                       | 2024 年 8 月 31 日 |
| 35 | 东方金证通货币市场基金暂停 500 万元以上（不含 500 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告                          | 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                  | 2024 年 9 月 11 日 |
| 36 | 关于暂停武汉佰崧基金销售有限公司（曾用名：武汉市伯嘉基金销售有限公司）办理旗下基金相关销售业务的公告                         | 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 | 2024 年 9 月 13 日 |
| 37 | 东方金证通货币市场基金暂停 5000 万元以上（不含 5000 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告                        | 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                  | 2024 年 9 月 13 日 |
| 38 | 东方基金管理股份有限公司关于终止天津市润泽基金销售有限公司、北京市增财基金销售有限公司办理本公司                           | 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              | 2024 年 9 月 25 日 |

|    |                                                             |                                             |                  |
|----|-------------------------------------------------------------|---------------------------------------------|------------------|
|    | 旗下基金销售业务的公告                                                 | 中国证监会基金电子披露网站                               |                  |
| 39 | 东方金证通货币市场基金暂停 500 万元以上（不含 500 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告           | 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                  | 2024 年 9 月 26 日  |
| 40 | 东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告                     | 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 | 2024 年 9 月 27 日  |
| 41 | 关于增加吉林银行股份有限公司为东方基金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 | 2024 年 9 月 27 日  |
| 42 | 东方金证通货币市场基金暂停 5000 万元以上（不含 5000 万元）申购、转换转入、定期定额投资公告         | 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                  | 2024 年 9 月 30 日  |
| 43 | 东方金证通货币市场基金 2024 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                       | 2024 年 10 月 25 日 |
| 44 | 东方基金管理股份有限公司关于终止深圳前海财厚基金销售有限公司、深圳富济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 | 2024 年 11 月 6 日  |
| 45 | 东方基金管理股份有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告      | 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 | 2024 年 11 月 15 日 |
| 46 | 东方基金管理股份有限公司关于终止乾道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 | 2024 年 11 月 22 日 |
| 47 | 关于旗下部分基金参与中信银行股份有限公司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 | 2024 年 11 月 27 日 |
| 48 | 关于增加华创证券有限责任公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时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              | 2024 年 12 月 6 日  |

|    |                                              |                                             |                  |
|----|----------------------------------------------|---------------------------------------------|------------------|
|    |                                              | 中国证监会基金电子披露网站                               |                  |
| 49 | 关于增加上海云湾基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时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 | 2024 年 12 月 12 日 |
| 50 | 关于增加华福证券有限责任公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时参与申购费率优惠活动的公告 | 证券日报、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            | 2024 年 12 月 24 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                                                                                                                                                                        | 1              | 20240101<br>– 20240201  | 113,020,944.03 | 1,425,097.66 | 114,446,041.69 | 0.00       | 0.00    |
|                                                                                                                                                                           | 2              | 20240229<br>– 20240311  | 113,020,944.03 | 1,425,097.66 | 114,446,041.69 | 0.00       | 0.00    |
|                                                                                                                                                                           | 3              | 20240313<br>– 20240408  | 113,020,944.03 | 1,425,097.66 | 114,446,041.69 | 0.00       | 0.00    |
|                                                                                                                                                                           | 4              | 20240412<br>– 20240418  | 113,020,944.03 | 1,425,097.66 | 114,446,041.69 | 0.00       | 0.00    |
|                                                                                                                                                                           | 5              | 20240430<br>– 20240505  | 113,020,944.03 | 1,425,097.66 | 114,446,041.69 | 0.00       | 0.00    |
|                                                                                                                                                                           | 6              | 20240628<br>– 20240630  | 113,020,944.03 | 1,425,097.66 | 114,446,041.69 | 0.00       | 0.00    |
|                                                                                                                                                                           | 7              | 20240822<br>– 20240825  | 113,020,944.03 | 1,425,097.66 | 114,446,041.69 | 0.00       | 0.00    |
|                                                                                                                                                                           | 8              | 20240827<br>– 20240828  | 113,020,944.03 | 1,425,097.66 | 114,446,041.69 | 0.00       | 0.00    |
|                                                                                                                                                                           | 9              | 20240830<br>– 20240902  | 113,020,944.03 | 1,425,097.66 | 114,446,041.69 | 0.00       | 0.00    |
| 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。<br>(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。<br>(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、基金份额净值及其他临时公告

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2025 年 3 月 31 日