

东方金账簿货币市场证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|-----------------------------------------------|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表..... | 15 |
| 6.2 利润表..... | 16 |
| 6.3 净资产变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 20 |
| §7 投资组合报告 | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 41 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 41 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 42 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明..... | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 42 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细..... | 43 |

| | |
|---------------------------------------------------------|-----------|
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 | 43 |
| 7.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细 | 44 |
| 7.9 投资组合报告附注 | 44 |
| §8 基金份额持有人信息 | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 46 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 | 47 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 47 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 47 |
| §9 开放式基金份额变动 | 48 |
| §10 重大事件揭示 | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 48 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 48 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 49 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 | 50 |
| 10.9 其他重大事件 | 50 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 52 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 52 |
| §12 备查文件目录 | 52 |
| 12.1 备查文件目录 | 52 |
| 12.2 存放地点 | 52 |
| 12.3 查阅方式 | 52 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|--------------------|
| 基金名称 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 | |
| 基金简称 | 东方金账簿货币 | |
| 基金主代码 | 400005 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2006 年 8 月 2 日 | |
| 基金管理人 | 东方基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 10,728,826,863.97 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 东方金账簿货币 A | 东方金账簿货币 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 400005 | 400006 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 929,999,544.39 份 | 9,798,827,319.58 份 |

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|---------------------------------|----------------------|
| 名称 | 东方基金管理股份有限公司 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李景岩 |
| | 联系电话 | 010-66295888 |
| | 电子邮箱 | xxpl@orient-fund.com |
| 客户服务电话 | 010-66578578 或 400-628-5888 | 95568 |
| 传真 | 010-66578700 | 010-57093382 |
| 注册地址 | 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |
| 办公地址 | 北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层 | 北京市西城区复兴门内大街 2 号 |
| 邮政编码 | 100073 | 100031 |

| | | |
|-------|----|-----|
| 法定代表人 | 崔伟 | 高迎欣 |
|-------|----|-----|

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com |
| 基金中期报告备置地点 | 本基金管理人及本基金托管人住所或办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|------------------------------------|
| 注册登记机构 | 东方基金管理股份有限公司 | 北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据 和指标 | 报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) | |
|-------------------|-------------------------------------|----------------|
| | 东方金账簿货币 A | 东方金账簿货币 B |
| 本期已实现收益 | 6,410,188.62 | 81,896,418.47 |
| 本期利润 | 6,410,188.62 | 81,896,418.47 |
| 本期净值收益率 | 0.8009% | 0.8010% |
| 3.1.2 期末数据 和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) | |
| | 期末基金资产净值 | 929,999,544.39 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末 指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) | |
| | 累计净值收益率 | 71.3506% |

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

东方金账簿货币 A

| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较 基准收益 率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|---------------------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.1254% | 0.0005% | 0.0288% | 0.0000% | 0.0966% | 0.0005% |
| 过去三个月 | 0.3860% | 0.0004% | 0.0873% | 0.0000% | 0.2987% | 0.0004% |
| 过去六个月 | 0.8009% | 0.0005% | 0.1736% | 0.0000% | 0.6273% | 0.0005% |
| 过去一年 | 1.7014% | 0.0006% | 0.3495% | 0.0000% | 1.3519% | 0.0006% |
| 过去三年 | 5.8798% | 0.0011% | 1.0500% | 0.0000% | 4.8298% | 0.0011% |
| 自基金合同生效起 至今 | 71.3506% | 0.0053% | 11.7328% | 0.0021% | 59.6178% | 0.0032% |

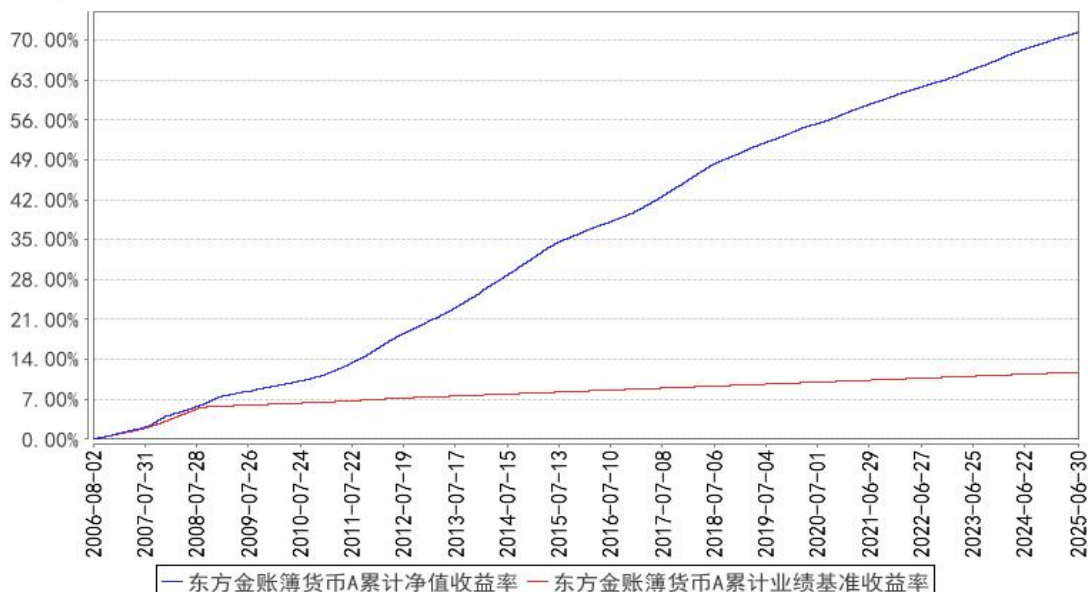
东方金账簿货币 B

| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较 基准收益 率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|---------------------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.1254% | 0.0005% | 0.0288% | 0.0000% | 0.0966% | 0.0005% |
| 过去三个月 | 0.3860% | 0.0004% | 0.0873% | 0.0000% | 0.2987% | 0.0004% |
| 过去六个月 | 0.8010% | 0.0005% | 0.1736% | 0.0000% | 0.6274% | 0.0005% |
| 过去一年 | 1.7014% | 0.0006% | 0.3495% | 0.0000% | 1.3519% | 0.0006% |
| 过去三年 | 6.0750% | 0.0011% | 1.0500% | 0.0000% | 5.0250% | 0.0011% |
| 自基金合同生效起 至今 | 34.1596% | 0.0033% | 3.7421% | 0.0000% | 30.4175% | 0.0033% |

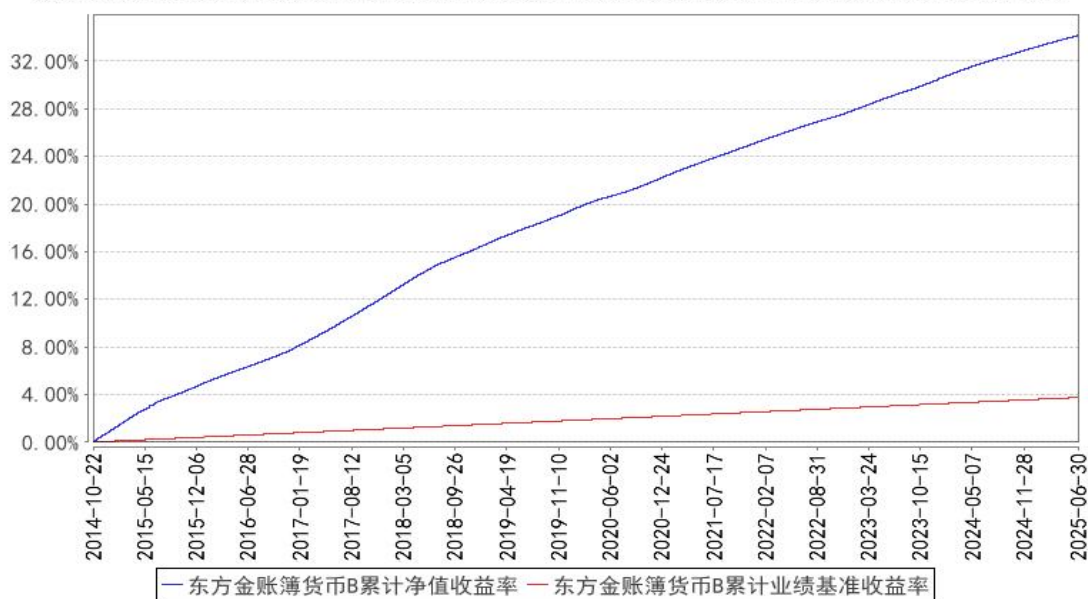
注：自 2022 年 4 月 13 日起，本基金收益分配由“每日分配收益，按月结转份额”变更为“每日分配收益，按日结转份额”。

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

东方金账簿货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方金账簿货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复，于2004年6月11日成立。

截至2025年6月30日，本公司注册资本3.3333亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份19200万股，持股比例57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份8100万股，

持股比例 24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份 2700 万股，持股比例 8.1%；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 2025 年 6 月 30 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）、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、东方低碳经济混合型证券投资基金、东方养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

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 | - | 10 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，10 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 | - | 10 年 | 北京交通大学统计学硕士，10 年证券从业经历。2015 年 7 月加盟本基金管理人，曾任交易部债券交易员、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。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2025 年上半年，债券市场收益率整体先上后下。具体来看，1 月中旬以来，存款自律协议对银行流动性的影响逐渐体现，银行缺负债问题明显，叠加稳汇率目标、重提资金空转、央行暂停购债等，资金面明显收紧，存单价格持续上行；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，也对大类资金流向带来了一定分流。截至 3 月 17 日，10Y、30Y 中债国债收益率分别最高上行至 1.89%、2.11% 附近，较 2024 年末上行 20BP 左右；三个月 Shibor 上行至 2.0% 附近，较 2024 年末上行 32BP，短端调整幅度大于长端。3 月下旬以来，央行持续净投放，释放呵护流动性的信号，债券收益率震荡下行。4 月初，美国宣布实施对等关税政策，超出市场预期，全球风险偏好快速下降，国内债券利率大幅下行，4 月 7 日中债 10 年期国债收益率从 1.72% 下行至 1.63%，债券快速下行后转为低位震荡横盘。5 月债券市场多空交织，上旬央行公告降准降息、中旬中美关税谈判结果转向积极，债券收益率随之反复，中债 10 年期国债收益率再次回升至 1.7%。进入 6 月，央行提前公告买断式回购操作，市场对平稳跨季的预期较为明确，债券各期限收益率窄幅下行，中债 10 年期国债收益率再度向下至 1.64% 附近。截至半年末，根据 wind 数据显示，三个月 Shibor 收于 1.63%，较 2024 年末下行 5BP 左右；中债 10 年期国债、中债 30 年期国债收益率分别收报 1.65%、1.86%，分别较 2024 年末下行 2.5BP、5BP 左右。

报告期内，本基金灵活调整杠杆和剩余期限，整体持仓以回购和 3-6M 存单为主，在缴税、季末等季节性时点增加了配置力度，在保证组合流动性安全的前提下，追求较好的收益稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 0.8009%，业绩比较基准收益率为 0.1736%，高于业绩比较基准 0.6273%；本基金 B 类净值增长率为 0.8010%，业绩比较基准收益率为 0.1736%，高于业绩比较基准 0.6274%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望来看，宏观政策效力集中于上半年释放，下半年经济基本面伴随着高基数扰动，基数效应可能对下半年增速读数产生影响。货币政策方面，外部扰动降低，仍有进一步加码的空间，即便总量性货币政策落地时点不确定，但当前央行呵护资金面的意图不变，流动性整体充裕宽松。基本面、资金面对债市的潜在支撑仍在，后续市场或继续博弈央行重启买债等宽松措施落地的预期。债市的潜在扰动来自于大类资产比价下的负债端变化。当前债基、理财收益率进入 1 时代，存款利率持续下调，叠加市场风险偏好回升明显，债券类资产的赚钱效应整体下降，产品负债端的行为变化可能会对市场产生持续影响。总体来说，预计债券收益率处于低位区间震荡状态，基本面、流动性对其有支撑但定价能力弱化，关注负债端的资金变化，警惕后续市场可能产生的调整风险。

未来，本基金将继续追求组合的流动性和收益的稳定性，不断优化持有人结构，提升组合收益，力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员包括公司总经理、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）。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金应分配且已分配利润 88,306,607.09 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 895,466.10 | 1,843,853,365.86 |
| 结算备付金 | | - | 3,000,122.22 |
| 存出保证金 | | 13,578.39 | 15,442.78 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 7,457,055,643.29 | 8,293,125,880.70 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 7,457,055,643.29 | 8,293,125,880.70 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 3,511,326,344.93 | 6,444,055,942.07 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 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 | | 411,978,126.23 | 3,219,765.73 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 11,381,269,158.94 | 16,587,270,519.36 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 649,555,724.65 | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | 11,000.00 |
| 应付管理人报酬 | | 1,298,624.15 | 1,777,879.81 |
| 应付托管费 | | 432,874.72 | 592,626.62 |
| 应付销售服务费 | | 86,574.97 | 118,525.35 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 70,822.39 | 142,642.95 |
| 应付利润 | | 433,472.25 | 765,686.90 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.7 | 564,201.84 | 779,934.00 |
| 负债合计 | | 652,442,294.97 | 4,188,295.63 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.8 | 10,728,826,863.97 | 16,583,082,223.73 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.9 | - | - |
| 净资产合计 | | 10,728,826,863.97 | 16,583,082,223.73 |
| 负债和净资产总计 | | 11,381,269,158.94 | 16,587,270,519.36 |

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，东方金账簿货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 929,999,544.39 份；东方金账簿货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 9,798,827,319.58 份。东方金账簿货币份额总额合计为 10,728,826,863.97 份。

6.2 利润表

会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | 102,800,642.75 | 151,937,954.91 |
| 1. 利息收入 | | 37,791,407.76 | 76,903,374.60 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.10 | 6,583,132.49 | 22,305,788.32 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 31,015,455.54 | 54,597,586.28 |
| 其他利息收入 | | 192,819.73 | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 65,009,234.99 | 75,034,580.31 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | 65,009,234.99 | 75,034,580.31 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.13 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 14,494,035.66 | 17,881,062.23 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 8,243,491.49 | 9,655,213.21 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 2,747,830.39 | 3,218,404.36 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 549,566.18 | 643,680.99 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 2,768,489.38 | 4,172,497.91 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,768,489.38 | 4,172,497.91 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.19 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 44,822.05 | 43,087.02 |

| | | | |
|---------------------|----------|---------------|----------------|
| 8. 其他费用 | 6.4.7.20 | 139,836.17 | 148,178.74 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 88,306,607.09 | 134,056,892.68 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 88,306,607.09 | 134,056,892.68 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 88,306,607.09 | 134,056,892.68 |

6.3 净资产变动表

会计主体：东方金账簿货币市场证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|---------------|-------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 16,583,082,223.73 | - | - | 16,583,082,223.73 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 16,583,082,223.73 | - | - | 16,583,082,223.73 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -5,854,255,359.76 | - | - | -5,854,255,359.76 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 88,306,607.09 | 88,306,607.09 |
| （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） | -5,854,255,359.76 | - | - | -5,854,255,359.76 |
| 其中：1. 基金申购款 | 26,983,020,596.17 | - | - | 26,983,020,596.17 |
| 2. 基金赎回款 | -32,837,275,95 | - | - | -32,837,275,955 |

| | | | | |
|------------------------------------------|---------------------------------|--------|----------------|--------------------|
| | 5.93 | | | .93 |
| (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) | - | - | -88,306,607.09 | -88,306,607.09 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 10,728,826,863.97 | - | - | 10,728,826,863.97 |
| 项目 | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 11,358,656,776.99 | - | - | 11,358,656,776.99 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 11,358,656,776.99 | - | - | 11,358,656,776.99 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -715,135,162.95 | - | - | -715,135,162.95 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 134,056,892.68 | 134,056,892.68 |
| (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) | -715,135,162.95 | - | - | -715,135,162.95 |
| 其中：1. 基金申购款 | 18,244,286,619.15 | - | - | 18,244,286,619.15 |
| 2. 基金赎回款 | -18,959,421,782.10 | - | - | -18,959,421,782.10 |

| | | | | |
|------------------------------------------|-------------------|---|-----------------|-------------------|
| （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） | - | - | -134,056,892.68 | -134,056,892.68 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 10,643,521,614.04 | - | - | 10,643,521,614.04 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>刘鸿鹏</u> | <u>刘鸿鹏</u> | <u>王丹丹</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方金账簿货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2006 年 6 月 6 日中国证监会《关于同意东方金账簿货币市场证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2006】106 号）和《关于东方金账簿货币市场证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2006】146 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》自 2006 年 7 月 3 日至 2006 年 7 月 28 日公开募集设立。本基金为货币市场基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 489,924,256.22 元人民币，业经天华会计师事务所“天华验字（2006）第 58-06 号”及“天华验字（2006）第 58-07 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》于 2006 年 8 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 489,989,508.84 份基金单位，其中认购资金利息折合 65,252.62 份基金单位。本基金的基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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

市场基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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

6.4.2 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。

6.4.3 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 6.4.2 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 895,466.10 |
| 等于：本金 | 895,420.08 |
| 加：应计利息 | 46.02 |
| 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 | 895,466.10 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|----|--------|------------------------|------------------|--------------|---------|
| | | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
| 债券 | 交易所市场 | 180,894,431.08 | 181,054,634.57 | 160,203.49 | 0.0015 |
| | 银行间市场 | 7,276,161,212.21 | 7,280,928,678.60 | 4,767,466.39 | 0.0444 |
| | 合计 | 7,457,055,643.29 | 7,461,983,313.17 | 4,927,669.88 | 0.0459 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| | 合计 | 7,457,055,643.29 | 7,461,983,313.17 | 4,927,669.88 | 0.0459 |

注：①偏离金额=影子定价-摊余成本

②偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 3,511,326,344.93 | - |
| 合计 | 3,511,326,344.93 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 203,384.10 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 203,384.10 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 295,286.32 |
| 应付申购款利息 | 65,531.42 |
| 合计 | 564,201.84 |

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方金账簿货币 A

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 649,995,844.27 | 649,995,844.27 |
| 本期申购 | 5,105,140,200.18 | 5,105,140,200.18 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,825,136,500.06 | -4,825,136,500.06 |
| 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 | 929,999,544.39 | 929,999,544.39 |

东方金账簿货币 B

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|--------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 15,933,086,379.46 | 15,933,086,379.46 |
| 本期申购 | 21,877,880,395.99 | 21,877,880,395.99 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -28,012,139,455.87 | -28,012,139,455.87 |
| 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 | 9,798,827,319.58 | 9,798,827,319.58 |

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。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

东方金账簿货币 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 6,410,188.62 | - | 6,410,188.62 |
| 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 | -6,410,188.62 | - | -6,410,188.62 |
| 本期末 | - | - | - |

东方金账簿货币 B

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 81,896,418.47 | - | 81,896,418.47 |
| 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 | -81,896,418.47 | - | -81,896,418.47 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|---------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 7,014.72 |
| 定期存款利息收入 | 6,568,985.46 |
| 其他存款利息收入 | - |

| | |
|-----------|--------------|
| 结算备付金利息收入 | 7,098.89 |
| 其他 | 33.42 |
| 合计 | 6,583,132.49 |

6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 60,964,976.52 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,044,258.47 |
| 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 | 65,009,234.99 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 10,303,338,505.63 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 10,262,982,294.03 |
| 减：应计利息总额 | 36,311,828.13 |
| 减：交易费用 | 125.00 |
| 买卖债券差价收入 | 4,044,258.47 |

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 26,778.95 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 34,777.35 |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 交易费用 | 172.50 |
| 合计 | 139,836.17 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|------------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) |
| 东北证券股份有限公司 | 174,608,220.00 | 100.00 | 475,783,562.92 | 100.00 |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|------------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|--------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) |
| 东北证券股份有限公司 | 4,335,798,000.00 | 100.00 | 13,894,393,000.00 | 100.00 |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,243,491.49 | 9,655,213.21 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,550,808.81 | 1,438,713.27 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 6,692,682.68 | 8,216,499.94 |

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,747,830.39 | 3,218,404.36 |

注：①计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 东方金账簿货币 A | 东方金账簿货币 B | 合计 |
| 东方基金管理股份有限公司 | 8,553.86 | 214,526.43 | 223,080.29 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 39.51 | 12,472.97 | 12,512.48 |
| 东北证券股份有限公司 | - | 1.58 | 1.58 |
| 合计 | 8,593.37 | 227,000.98 | 235,594.35 |
| 获得销售服务费的各关联方 | 上年度可比期间 | | |
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |

| 方名称 | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
|--------------|------------------|------------|------------|
| | 东方金账簿货币 A | 东方金账簿货币 B | 合计 |
| 东方基金管理股份有限公司 | 1,077.09 | 332,020.86 | 333,097.95 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 30.05 | 13,666.54 | 13,696.59 |
| 东北证券股份有限公司 | - | 32.78 | 32.78 |
| 合计 | 1,107.14 | 345,720.18 | 346,827.32 |

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 0.01% 年费率计提，B 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.01% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为各级基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费率

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

③自 2023 年 4 月 7 日起东方金账簿货币 A 类份额实行销售服务费率优惠调整，费率由 0.25% 调整到 0.01%，截至本报告期末优惠方案未结束。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | | | | |
|--------------------------------------------|--------|------|-------|------|----------------|-----------|
| 银行间市场交易的 各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国民生银行股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的 各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国民生银行股份有限公司 | - | - | - | - | 290,000,000.00 | 21,589.04 |

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | |
|--------------------------------|--------------------------------------------|----------------|
| | 东方金账簿货币 A | 东方金账簿货币 B |
| 基金合同生效日（2006 年 8 月 2 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | 92,174,710.74 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | 218,045,027.06 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | 252,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 58,219,737.80 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 0.59% |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
| | 东方金账簿货币 A | 东方金账簿货币 B |
| 基金合同生效日（2006 年 8 月 2 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | 96,568,116.40 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | 139,292,676.52 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | 0.00 |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | 122,000,000.00 |

| | | |
|---------------------|---|----------------|
| 报告期末持有的基金份额 | - | 113,860,792.92 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 1.11% |

注：①基金管理人投资本基金时按照基金合同、招募说明书及相关公告约定的费率标准支付相应的手续费。

②报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2025年1月1日至2025年6月30日 | | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|--------------|----------------------------|------------|---------------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 895,466.10 | 805,458.81 | 552,636,992.15 | 8,255,963.52 |

注：当期利息收入包括由关联方保管的活期存款、定期存款的利息收入。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 东方金账簿货币 A | | | | |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 已按再投资形式转 实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分配合 计 | 备注 |
| 6,402,618.88 | - | 7,569.74 | 6,410,188.62 | - |
| 东方金账簿货币 B | | | | |
| 已按再投资形式转 实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分配合 计 | 备注 |
| 82,236,202.86 | - | -339,784.39 | 81,896,418.47 | - |

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

6.4.12 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日，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 649,555,724.65 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 112409280 | 24 浦发银行 CD280 | 2025 年 7 月 1 日 | 99.37 | 1,890,000 | 187,810,991.79 |
| 112503149 | 25 农业银行 CD149 | 2025 年 7 月 1 日 | 99.39 | 2,000,000 | 198,787,642.60 |
| 220406 | 22 农发 06 | 2025 年 7 月 1 日 | 102.36 | 500,000 | 51,177,623.71 |
| 240309 | 24 进出 09 | 2025 年 7 月 1 日 | 101.20 | 230,000 | 23,275,578.69 |
| 240421 | 24 农发 21 | 2025 年 7 月 1 日 | 101.35 | 830,000 | 84,121,464.89 |
| 240431 | 24 农发 31 | 2025 年 7 月 1 日 | 101.12 | 1,600,000 | 161,799,882.08 |
| 合计 | | | | 7,050,000 | 706,973,183.76 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金投资于具有良好信用等级的证券，并在法律法规规定和本基金基金合同约定的基础上，进一步进行分散化投资管理。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 30,098,945.75 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 1,422,585,206.03 | 1,616,297,871.85 |
| 合计 | 1,422,585,206.03 | 1,646,396,817.60 |

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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 182,992,358.14 | 295,329,274.68 |

| | | |
|--------|----------------|----------------|
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 122,060,838.72 | 201,523,191.43 |
| 合计 | 305,053,196.86 | 496,852,466.11 |

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 5,176,501,966.94 | 5,150,434,218.82 |
| AAA 以下 | 0.00 | 158,967,443.04 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 5,176,501,966.94 | 5,309,401,661.86 |

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基

金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理,保持组合必要的流动性和可变现能力,未发生流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

| 本期末 2025年6月30 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 | 895,466.10 | - | - | - | - | 895,466.10 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 13,578.39 | - | - | - | - | 13,578.39 |
| 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 | 6,870,166,713.96 | 586,888,929.33 | - | - | - | 7,457,055,643.29 |
| 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 | 3,511,326,344.93 | - | - | - | - | 3,511,326,344.93 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 411,978,126.23 | 411,978,126.23 |

| | | | | | | |
|-------------------------|-------------------|------------------|------|------|----------------|-------------------|
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 10,382,402,103.38 | 586,888,929.33 | - | - | 411,978,126.23 | 11,381,269,158.94 |
| 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 | 649,555,724.65 | - | - | - | - | 649,555,724.65 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,298,624.15 | 1,298,624.15 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 432,874.72 | 432,874.72 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 86,574.97 | 86,574.97 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | 70,822.39 | 70,822.39 |
| 应付利润 | - | - | - | - | 433,472.25 | 433,472.25 |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | 564,201.84 | 564,201.84 |
| 负债总计 | 649,555,724.65 | - | - | - | 2,886,570.32 | 652,442,294.97 |
| 利率敏感度缺口 | 9,732,846,378.73 | 586,888,929.33 | - | - | 409,091,555.91 | 10,728,826,863.97 |
| 上年度末 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 | 1,843,853,365.86 | - | - | - | - | 1,843,853,365.86 |
| 结算备付金 | 3,000,122.22 | - | - | - | - | 3,000,122.22 |
| 存出保证金 | 15,442.78 | - | - | - | - | 15,442.78 |
| 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 | 6,641,410,766.52 | 1,651,715,114.18 | - | - | - | 8,293,125,880.70 |
| 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 | 6,444,055,942.07 | - | - | - | - | 6,444,055,942.07 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 3,219,765.73 | 3,219,765.73 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 14,932,335,639.45 | 1,651,715,114.18 | - | - | 3,219,765.73 | 16,587,270,519.36 |
| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 11,000.00 | 11,000.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,777,879.81 | 1,777,879.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 592,626.62 | 592,626.62 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 118,525.35 | 118,525.35 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | 142,642.95 | 142,642.95 |
| 应付利润 | - | - | - | - | 765,686.90 | 765,686.90 |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | 779,934.00 | 779,934.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 4,188,295.63 | 4,188,295.63 |
| 利率敏感度缺口 | 14,932,335,639.45 | 1,651,715,114.18 | - | - | -968,529.90 | 16,583,082,223.73 |

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | |
|----|---------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值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 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

| | 动 | 本期末 (2025 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2024 年 12 月 31 日) |
|-----------------|-----------------|-----------------------|-------------------------|
| | 市场利率上调 0.25% | | -7,000,223.13 |
| 市场利率下调 0.25% | | 3,544,946.32 | 5,326,057.98 |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金按照基金合同的约定和法律法规的规定进行投资，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 7,457,055,643.29 | 69.50 | 8,293,125,880.70 | 50.01 |
| 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 | 7,457,055,643.29 | 69.50 | 8,293,125,880.70 | 50.01 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | |
|----|-------------------------------------------|
| 假设 | 根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资 |
|----|-------------------------------------------|

| | | | |
|----|--------------------------------------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------|
| | 产变动 | | |
| | Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到, 对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票, 默认其波动与市场同步 | | |
| | 假定沪深 300 指数变动 5%, 其他市场变量均不发生变化, 计算本基金资产净值变动 | | |
| 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 (2025 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2024 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 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 7,457,055,643.29 | 8,293,125,880.70 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 7,457,055,643.29 | 8,293,125,880.70 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|-------------------|---------------|
| 1 | 固定收益投资 | 7,457,055,643.29 | 65.52 |
| | 其中：债券 | 7,457,055,643.29 | 65.52 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| | 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 3,511,326,344.93 | 30.85 |
| | 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 | 895,466.10 | 0.01 |
| 4 | 其他各项资产 | 411,991,704.62 | 3.62 |
| 5 | 合计 | 11,381,269,158.94 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|----------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 3.00 | |
| | 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 | 649,555,724.65 | 6.05 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 72 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 88 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 51 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1 | 30 天以内 | 41.19 | 6.05 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 12.65 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 10.51 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 9.59 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 28.11 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 102.04 | 6.05 |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 按实际利率计算的账面价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|---------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 99,504,366.83 | 0.93 |

| | | | |
|----|----------------------|------------------|-------|
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 605,646,011.41 | 5.65 |
| | 其中：政策性金融债 | 453,410,906.63 | 4.23 |
| 4 | 企业债券 | 91,516,748.93 | 0.85 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,422,585,206.03 | 13.26 |
| 6 | 中期票据 | 61,301,343.15 | 0.57 |
| 7 | 同业存单 | 5,176,501,966.94 | 48.25 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 7,457,055,643.29 | 69.50 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 按实际利率计算的账面价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|-----------|-----------------|--------------|
| 1 | 112483486 | 24 宁波银行 CD102 | 2,000,000 | 199,704,500.52 | 1.86 |
| 2 | 112405284 | 24 建设银行 CD284 | 2,000,000 | 199,518,820.88 | 1.86 |
| 3 | 112406294 | 24 交通银行 CD294 | 2,000,000 | 199,251,092.19 | 1.86 |
| 4 | 112503149 | 25 农业银行 CD149 | 2,000,000 | 198,787,642.60 | 1.85 |
| 5 | 112409280 | 24 浦发银行 CD280 | 2,000,000 | 198,741,790.25 | 1.85 |
| 6 | 240431 | 24 农发 31 | 1,600,000 | 161,799,882.08 | 1.51 |
| 7 | 112503172 | 25 农业银行 CD172 | 1,500,000 | 149,589,542.40 | 1.39 |
| 8 | 112403257 | 24 农业银行 CD257 | 1,500,000 | 149,146,463.63 | 1.39 |
| 9 | 112417214 | 24 光大银行 CD214 | 1,500,000 | 149,142,921.82 | 1.39 |
| 10 | 112505051 | 25 建设银行 CD051 | 1,500,000 | 149,104,383.16 | 1.39 |

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|----------------------------------|------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含) -0.5% 间的次数 | 0 |

| | |
|------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0568% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0187% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0312% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

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

本基金所持有 24 宁波银行 CD102 (112483486. IB), 发行人宁波银行股份有限公司 (以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等, 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。

本基金所持有 24 建设银行 CD284 (112405284. IB)、25 建设银行 CD051 (112505051. IB), 发行人中国建设银行股份有限公司 (以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等, 被国家金融监督管理总局、中国人民银行、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 交通银行 CD294 (112406294. IB), 发行人交通银行股份有限公司 (以下简称“公司”), 受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等, 被国家金融监督管理总局、中国人民银行、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。

本基金所持有 25 农业银行 CD149 (112503149. IB)、25 农业银行 CD172 (112503172. IB)、24 农业银行 CD257 (112403257. 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。公司因未依法履行其他职责等, 被国家金融监督管理总局、国家外汇管理局、中国人民银行、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 浦发银行 CD280 (112409280. IB)，发行人上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等，被国家金融监督管理总局、国家外汇管理局、中国人民银行、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 农发 31 (240431. IB)，发行人中国农业发展银行（以下简称“农发行”），受到行政处罚。农发行因未依法履行其他职责等，被国家金融监督管理总局、国家外汇管理局公开处罚。该行目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有 24 光大银行 CD214 (112417214. IB)，发行人中国光大银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等，被国家金融监督管理总局、国家外汇管理局、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，基金经理基于投研部门的支持，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 宁波银行 CD102 (112483486. IB)、24 建设银行 CD284 (112405284. IB)、25 建设银行 CD051 (112505051. IB)、24 交通银行 CD294 (112406294. IB)、25 农业银行 CD149 (112503149. IB)、25 农业银行 CD172 (112503172. IB)、24 农业银行 CD257 (112403257. IB)、24 浦发银行 CD280 (112409280. IB)、24 光大银行 CD214 (112417214. IB) 主要基于以下原因：

以上债券主体评级为 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 农发 31 (240431. IB) 主要基于以下原因：

该债券为政策银行债，发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

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

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 13,578.39 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 411,978,126.23 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 411,991,704.62 |

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | |
|------|-------|-----------|-------|-------|
| | | | 机构投资者 | 个人投资者 |
| | | | | |

| | (户) | | 持有份额 | 占总份 额比例 (%) | 持有份额 | 占总 份额 比例 (%) |
|-----------|--------|------------|------------------|-------------------|----------------|-----------------------|
| 东方金账簿货币 A | 31,297 | 29,715.29 | 502,858,172.42 | 54.07 | 427,141,371.97 | 45.93 |
| 东方金账簿货币 B | 49,647 | 197,369.98 | 9,438,863,645.02 | 96.33 | 359,963,674.56 | 3.67 |
| 合计 | 80,944 | 132,546.29 | 9,941,721,817.44 | 92.66 | 787,105,046.53 | 7.34 |

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额 (份) | 占总份额比例 (%) |
|----|-------|----------------|------------|
| 1 | 其他机构 | 815,922,911.59 | 7.60 |
| 2 | 银行类机构 | 806,670,877.43 | 7.52 |
| 3 | 其他机构 | 702,644,315.23 | 6.55 |
| 4 | 银行类机构 | 516,961,019.34 | 4.82 |
| 5 | 银行类机构 | 309,787,980.84 | 2.89 |
| 6 | 券商类机构 | 307,537,085.70 | 2.87 |
| 7 | 银行类机构 | 304,925,991.35 | 2.84 |
| 8 | 银行类机构 | 302,500,876.33 | 2.82 |
| 9 | 银行类机构 | 300,051,158.18 | 2.80 |
| 10 | 基金类机构 | 297,241,008.14 | 2.77 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|-----------|--------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 东方金账簿货币 A | 2,911,683.38 | 0.31 |
| | 东方金账簿货币 B | 105,619.02 | 0.00 |
| | 合计 | 3,017,302.40 | 0.03 |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|-----------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 东方金账簿货币 A | 50~100 |
| | 东方金账簿货币 B | 0 |
| | 合计 | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 东方金账簿货币 A | 0 |
| | 东方金账簿货币 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东方金账簿货币 A | 东方金账簿货币 B |
|---------------------------------------|------------------|-------------------|
| 基金合同生效日 (2006 年 8 月 2 日) 基金份额总额 | 489,989,508.84 | - |
| 本报告期期初基金份 额总额 | 649,995,844.27 | 15,933,086,379.46 |
| 本报告期基金总申购 份额 | 5,105,140,200.18 | 21,877,880,395.99 |
| 减：本报告期基金总 赎回份额 | 4,825,136,500.06 | 28,012,139,455.87 |
| 本报告期基金拆分变 动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份 额总额 | 929,999,544.39 | 9,798,827,319.58 |

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2025 年 4 月 8 日，基金管理人发布了《东方基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，自 2025 年 4 月 7 日起张晓丹女士担任公司副总经理，秦熠群先生担任首席信息官，刘鸿鹏先生不再担任首席信息官。上述人员的变更已报北京监管局及中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 东北证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------------|----------------|------------------|------------------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 东北证券股份有限公司 | 174,608,220.00 | 100.00 | 4,335,798,000.00 | 100.00 | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5% 的情况。

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|
| 1 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2024 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 | 2025 年 1 月 22 日 |
| 2 | 关于增加海通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同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025 年 3 月 15 日 |
| 3 | 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 | 2025 年 3 月 29 日 |
| 4 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2024 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 | 2025 年 3 月 31 日 |

| | | | |
|----|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|
| 5 | 东方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 下半年度） | 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 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 6 | 关于增加华西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同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025 年 4 月 2 日 |
| 7 | 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 | 2025 年 4 月 8 日 |
| 8 | 关于增加杭州银行股份有限公司杭 E 家平台为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025 年 4 月 8 日 |
| 9 | 东方基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025 年 4 月 8 日 |
| 10 | 东方金账簿货币市场证券投资基金 2025 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 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 11 | 关于东方基金管理股份有限公司旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司转换补差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 | 2025 年 5 月 13 日 |
| 12 | 东方基金管理股份有限公司关于终止民商基金销售（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 | 2025 年 5 月 28 日 |
| 13 | 关于增加中邮证券有限责任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 | 2025 年 6 月 12 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2025 年 8 月 29 日