
东方 优 一年持有期混合型 券投
基
2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基 人：上海东方 券 产 有 公司

基 托 人：中国光大 份有 公司

出日期：2022 年 3 月 31 日

1.2 录

| | |
|---|----|
| §1 提 及 录..... | 2 |
| 1.1 提 | 2 |
| 1.2 录..... | 3 |
| §2 基 介..... | 5 |
| 2.1 基 基本情况..... | 5 |
| 2.2 基 产品 明..... | 5 |
| 2.3 基 人和基 托 人..... | 6 |
| 2.4 信息披 方式..... | 6 |
| 2.5 其他 关 料..... | 6 |
| §3 主 务指标、基 净值 现及利润分 情况..... | 6 |
| 3.1 主 会 数据和 务指标..... | 6 |
| 3.2 基 净值 现..... | 8 |
| 3.3 去三年基 利润分 情况..... | 10 |
| §4 人报告..... | 11 |
| 4.1 基 人及基 情况..... | 11 |
| 4.2 人对报告期内本基 作 守信情况 明..... | 13 |
| 4.3 人对报告期内公平交易情况 专 明..... | 14 |
| 4.4 人对报告期内基 投 和业 现 明..... | 14 |
| 4.5 人对宏 济、 券市场及 业 势 展望..... | 15 |
| 4.6 人内 有关本基 察 核工作情况..... | 16 |
| 4.7 人对报告期内基 估值 序 事 明..... | 16 |
| 4.8 人对报告期内基 利润分 情况 明..... | 17 |
| 4.9 报告期内 人对本基 持有人数或基 产净值 情形 明..... | 17 |
| §5 托 人报告..... | 17 |
| 5.1 报告期内本基 托 人 守信情况声明..... | 17 |
| 5.2 托 人对报告期内本基 投 作 守信、净值 、利润分 情况 明..... | 17 |
| 5.3 托 人对本年度报告中 务信息 内容 实、准 和完整发 意 | 18 |
| §6 审 报告..... | 18 |
| 6.1 审 报告基本信息..... | 18 |
| 6.2 审 报告 基本内容..... | 18 |
| §7 年度 务报 | 20 |
| 7.1 产 债 | 20 |
| 7.2 利润 | 21 |
| 7.3 所有 权 （基 净值）变动 | 22 |
| 7.4 报 注..... | 24 |
| §8 投 合报告..... | 61 |

| | |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 61 |
| 8.2 报告期末按行业分类投资组合..... | 61 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有投资明细..... | 62 |
| 8.4 报告期内投资组合大变动..... | 65 |
| 8.5 期末按债券品种分类债券投资组合..... | 66 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前五名债券投资明细..... | 66 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细..... | 67 |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前五名属投资明细..... | 67 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前五名股权投资明细..... | 67 |
| 8.10 报告期末本基金投资股指期货交易情况 明..... | 67 |
| 8.11 报告期末本基金投资国债期货交易情况 明..... | 67 |
| 8.12 投资组合报告注..... | 67 |
| § 9 基金份额持有人信息..... | 69 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 69 |
| 9.2 期末基金从业人员持有本基金情况..... | 69 |
| 9.3 期末基金从业人员持有本开放式基金份额总区情况..... | 70 |
| 9.4 期末兼任募产划投基本人及其亲属持有本人产品情况..... | 70 |
| § 10 开放式基金份额变动..... | 70 |
| § 11 大事件揭..... | 71 |
| 11.1 基金份额持有人大会决..... | 71 |
| 11.2 基金人、基金托人专基托大人事变动..... | 71 |
| 11.3 涉及基金人、基金产、基金托业务..... | 71 |
| 11.4 基金投改变..... | 71 |
| 11.5 为基金审会师事务所情况..... | 71 |
| 11.6 基金人、托人及其人员受查或处情况..... | 71 |
| 11.7 基金券公司交易单元有关情况..... | 71 |
| 11.8 其他大事件..... | 72 |
| § 12 影响投决其他信息..... | 77 |
| 12.1 报告期内单一投持有基金份额比例到或 20% 情况..... | 77 |
| 12.2 影响投决其他信息..... | 77 |
| § 13 备查文件录..... | 77 |
| 13.1 备查文件录..... | 77 |
| 13.2 存放地点..... | 77 |
| 13.3 查方式..... | 77 |

§ 2 基 介

2.1 基 基本情况

| | | |
|------------------|---|----------------|
| 基 名 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 | |
| 基 | 东方 优 一年持有混合 | |
| 基 主代 | 009725 | |
| 基 作方式 | 契 型开放式 本基 每份基 份 1 年 定持有期， 利再投 来 基 份 不 受 定持有期 制。 | |
| 基 合同 效日 | 2020 年 7 月 23 日 | |
| 基 人 | 上海东方 券 产 有 公司 | |
| 基 托 人 | 中国光大 份有 公司 | |
| 报告期末基 份 总 | 1, 315, 587, 265. 26 份 | |
| 基 合同存 期 | 不定期 | |
| 下属分 基 基 | 东方 优 一年持有混合 A | 东方 优 一年持有混合 C |
| 下属分 基 交 易代 | 009725 | 013785 |
| 报告期末下属分 基 份 总 | 1, 315, 189, 720. 09 份 | 397, 545. 17 份 |

2.2 基 产品 明

| | |
|--------|---|
| 投 标 | 本基 在严格控制投 合 前提下， 求 产净值 期 健增值。 |
| 投 | 本基 严 大 产 和个券 ，在做好 基 上， 多样化 投 努力实现基 产 定增 值。 |
| 业 比 基准 | 沪深 300 指数收 率×8%+恒 指数收 率×2%+中债 合指数收 率×90% |
| 收 特征 | 本基 是一只混合型基 ，其 期 与 期收 于债券型基 与 币市场基 ，低于 型基 。本基 了投 A 外， 可 根据法律法 定投 港 合交易所上市 。 了 承担 与境内 券投 基 似 市场波动 一 投 之外，本 基 临港 机制下因投 环境、投 标 、市场制度以及交 |

易 则 差异带来 特有 。

2.3 基 人和基 托 人

| | | 基 人 | 基 托 人 |
|-------|----|-----------------------------------|---------------------------------------|
| 名 | | 上海东方 券 产 有 公司 | 中国光大 份有 公司 |
| 信息披 人 | 姓名 | 张 | 平 |
| | 子 | 021-33315895 service@dfham.com | 010-63639180 shiliping@cebbank.com |
| 客户服务 | | 4009200808 | 95595 |
| 传 | | 021-63326381 | 010-63639132 |
| 注册地址 | | 上海市 浦区中山南 109 号 7 层-11 层 | 北京市 城区太平桥大 25 号、25 号中国光大中心 |
| 办公地址 | | 上海市 浦区外 108 号供 大厦 7 层-11 层 | 北京市 城区太平桥大 25 号 中国光大中心 |
| 政 | | 200010 | 100033 |
| 法定代 人 | | 宋 枫 | 李晓 |

2.4 信息披 方式

| | |
|--------------|-----------------------|
| 本基 定 信息披 报 名 | 上海 券报 |
| 基 年度报告正文 址 | www.dfham.com |
| 基 年度报告备 地点 | 上海市 浦区外 108 号供 大厦 7 层 |

2.5 其他 关 料

| | 名 | 办公地址 |
|--------|-----------------------|---|
| 会 师事务所 | 普华永 中天会 师事务所 (特殊普 合伙) | 上海市 浦区湖滨 202 号 展企业广场二座 普华永 中心 11 楼 |
| 注册 机构 | 中国 券 有 任公 司 | A 份 : 北京市 城区太平桥大 17 号 C 份 : 上海市 浦区外 108 号供 大 厦 7 层 |

§ 3 主 务指标、基 净值 现及利润分 情况

3.1 主 会 数据和 务指标

单位：人民币元

| 3.1.1 期 数 据和指 标 | 2021 年 | 2021 年 10 月 28 日 (基 合同 效 日)-2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 7 月 23 日(基 合同 效日)-2020 年 12 月 31 日 | 2020 年 |
|-----------------|----------------|--|---|----------------|
| | 东方 优 一年持 有混合 A | 东方 优 一年持有混合 C | 东方 优 一年持 有混合 A | 东方 优 一年持 有混合 C |
| 本期已 实现收 | 70,504,664.86 | -3,796.49 | 19,475,711.28 | - |

| | | | | |
|---------------|------------------|------------|------------------|---|
| 本期利润 | 67,617,164.69 | 891.39 | 36,618,876.77 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0596 | 0.0043 | 0.0365 | - |
| 本期加权平均净值利润率 | 5.74% | 0.42% | 3.60% | - |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.64% | 0.00% | 3.65% | - |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末 | | 2020 年末 | |
| 期末可供分利润 | 10,486,094.33 | 2,964.59 | 19,475,711.28 | - |
| 期末可供基金份额利润 | 0.0080 | 0.0075 | 0.0194 | - |
| 期末资产净值 | 1,347,239,692.04 | 407,016.76 | 1,041,174,387.62 | - |
| 期末基金份额净值 | 1.0244 | 1.0238 | 1.0365 | - |
| 3.1.3 期末指标 | 2021 年末 | | 2020 年末 | |
| 基金份额净值增长率 | 10.53% | 0.00% | 3.65% | - |

注：1、所 基 业 指标不包括持有人 或交易基 各 ， 入 后实 收 水平 低于所列数字。

2、本期已实现收 指基 本期利息收入、投 收 、其他收入（不含公允价值变动收 ）扣 关 后 余 ，本期利润为本期已实现收 加上本期公允价值变动收 。

3、期末可供分 利润， 期末 产 债 中未分 利润与未分 利润中已实现 分 孰低
数（为期末余 ，不是当期发 数）。

3.2 基 净值 现

3.2.1 基 份 净值增 率及其与同期业 比 基准收 率 比

东方 优 一年持有混合 A

| 段 | 份 净值增 率① | 份 净值增 率标准差 ② | 业 比 基 准收 率③ | 业 比 基 准收 率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------------|-------------|--------------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 去三个月 | 0.09% | 0.11% | 0.59% | 0.08% | -0.50% | 0.03% |
| 去六个月 | 1.74% | 0.14% | 0.49% | 0.11% | 1.25% | 0.03% |
| 去一年 | 6.64% | 0.14% | 1.31% | 0.12% | 5.33% | 0.02% |
| 基 合同 效 今 | 10.53% | 0.14% | 2.06% | 0.11% | 8.47% | 0.03% |

东方 优 一年持有混合 C

| 段 | 份 净值增 率① | 份 净值增 率标准差 ② | 业 比 基 准收 率③ | 业 比 基 准收 率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-----------------------------------|-------------|--------------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 基 合同 效 (2021 年 10 月 28 日) 今 | 0.00% | 0.11% | 0.75% | 0.07% | -0.75% | 0.04% |

注：本基 业 比 基准为：沪深 300 指数收 率×8%+恒 指数收 率×2%+中债 合指数收
率×90%。

本基 每个交易日对业 比 基准 再平 处 t 日收 率(benchmarkt)按下列公式

:

$$\text{benchmarkt} = 90\% * [\text{t 日中债 合指数} / (\text{t-1 日中债 合指数}) - 1] + 8\% * [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 2\% * [\text{t 日恒 指数} / (\text{t-1 日恒 指数}) - 1];$$

期 T 日收 率(benchmarkT)按下列公式 :

$benchmark_T = [\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)] - 1$ 其中, $t=1, 2, 3, \dots, T, T$ 时 截 日;

$\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)$ $(1 + benchmark_t)$ 数学 乘。

3.2.2 基 合 效 以 来 基 份 净 值 增 率 变 动 及 其 与 同 期 业 比 基 准 收 率 变 动 比

东方红优质甄选一年持有混合**A**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

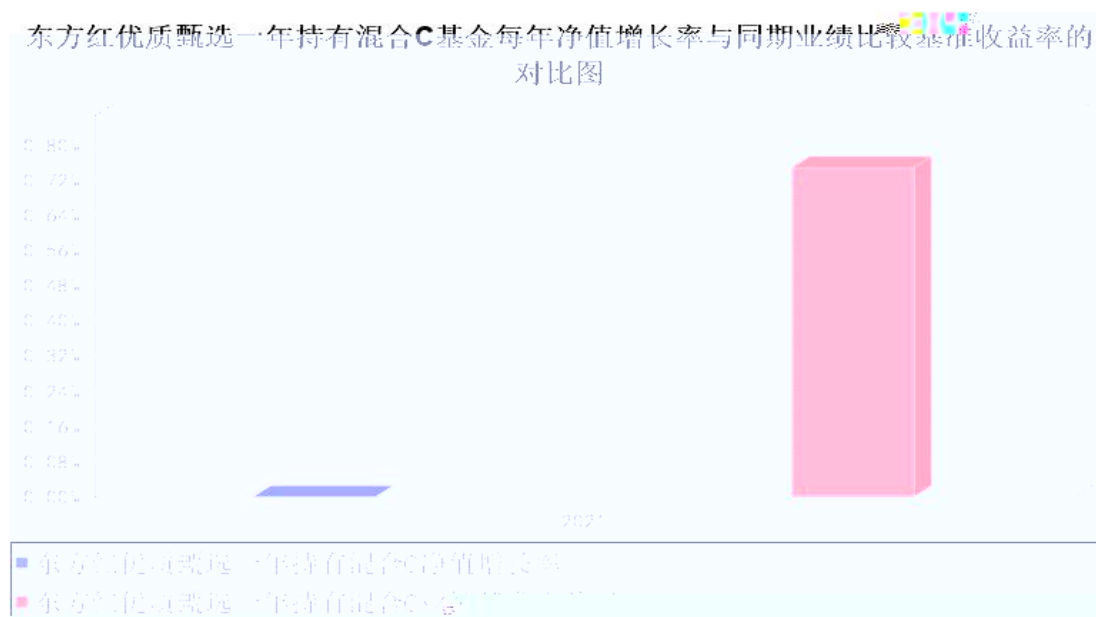
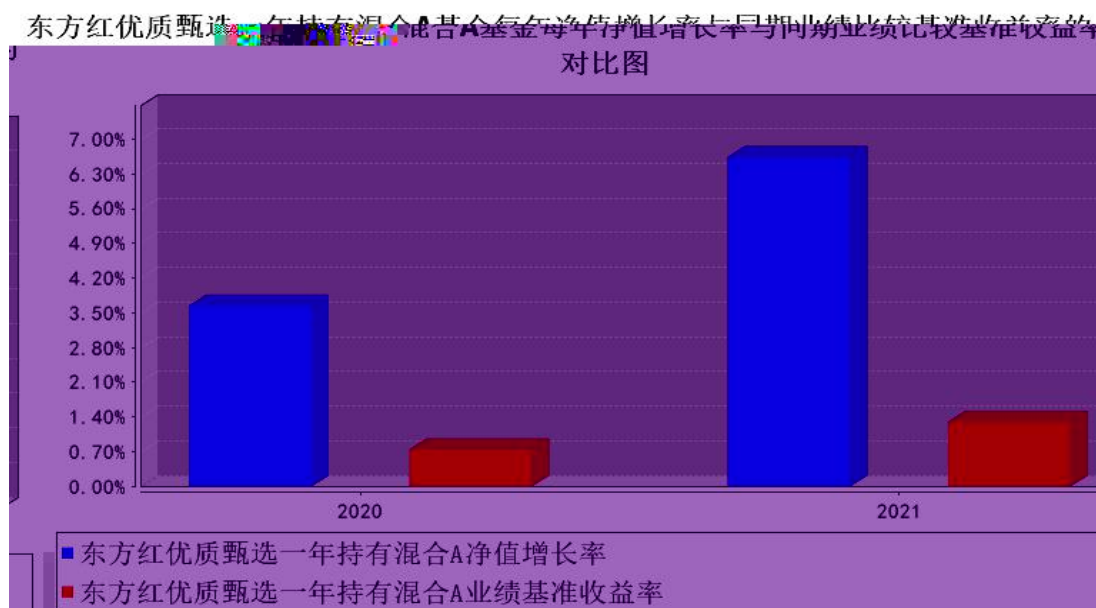


东方红优质甄选一年持有混合**C**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基 建仓期 6 个月，即从 2020 年 7 月 23 日 2021 年 1 月 22 日，建仓期 束 时 各 产 比 例 均 合 基 合 同 定。

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



注：本基金合同生效日期为2020年7月23日，C份“基金合同生效日”特指2021年10月28日，合同生效当年期间数据和指标按实存期，不按自然年度折算。

3.3 去三年基金利润分配情况

东方 优 一年持有混合 A

| 年度 | 每10份基金份额 | 现形式发放总 | 再投形式发放总 | 年度利润分合 | 备注 |
|-------|----------|---------------|------------|---------------|----|
| 2021年 | 0.7900 | 94,074,775.03 | 556,155.50 | 94,630,930.53 | - |
| 2020年 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---|--------|---------------|------------|---------------|---|
| 合 | 0.7900 | 94,074,775.03 | 556,155.50 | 94,630,930.53 | - |
|---|--------|---------------|------------|---------------|---|

§ 4 人报告

4.1 基 人及基 情况

4.1.1 基 人及其 基

本基 人上海东方 券 产 有 公司成 于 2010 年 7 月 28 日，是国内 家 中国 会批准 券商 产 公司。公司 中国 券 委员会《关于核准东方 券 份有 公司 券 产 子公司 批复》（ 可[2010]518 号）批准， 东方 券 份有 公司出 3 亿元在原东方 券 产 业务总 基 上成 。2013 年 8 月，公司成为 家 得“公开募 券投 基 业务 格” 券公司。公司主 业务为 券 产 业务和公 开募 券投 基 业务。

截 2021 年 12 月 31 日，本基 人共 东方 满沪港深灵活 混合型 券投 基 (LOF)、东方 沪港深灵活 混合型 券投 基 、东方 华沪港深灵活 混合型 券投 基 (LOF)、东方 战 沪港深混合型 券投 基 、东方 价值 混合型 券投 基 、东方 优享 利沪港深灵活 混合型 券投 基 、东方 债债券型 券投 基 、东方 智 沪港深定期开放混合型发 式 券投 基 、东方 产业升 灵活 混合型 券投 基 、东方 元三年定期开放灵活 混合型发 式 券投 基 、东方 信 债债券型 券投 基 、东方 添利 债债券型发 式 券投 基 、东方 汇 债券型 券投 基 、东方 汇利债券型 券投 基 、东方 新动力灵活 混合型 券投 基 、东方 丰 灵活 混合型 券投 基 (LOF)、东方 三年定期开放灵活 混合型 券投 基 、东方 中国优势灵活 混合型 券投 基 、东方 先 灵活 混合型 券投 基 、东方 健 混合型 券投 基 、东方 定期开放混合型发 式 券投 基 、东方 灵活 混合型发 式 券投 基 、东方 京东大数据灵活 混合型 券投 基 、东方 优势 灵活 混合型发 式 券投 基 、东方 6 个月定期开放 债债券型发 式 券投 基 、东方 收 增强债券型 券投 基 、东方 三年定期开放灵活 混合型 券投 基 、东方 币市场基 、东方 玺三年定期开放灵活 混合型 券投 基 、东方 标优 三年定期开放混合型 券投 基 、东方 泽三年定期开放灵活 混合型 券投 基 、东方 创新优 三年定期开放混合型 券投 基 、东方 混合型 券投 基 、东方 核心优 一年定期开放混合型 券投 基 、东方 恒元五年定期开放灵活 混合型 券投 基 、东方 中 争力指数发 式 券投 基 、东方 利债券型 券投

基、东方启元三年持有期混合型券投基、东方品优两年定期开放混合型券投基、东方安一年持有期混合型券投基、东方两年定期开放信债债券型券投基、东方恒五年定期开放混合型券投基、东方匠心一年持有期混合型券投基、东方均优两年定期开放混合型券投基、东方启东三年持有期混合型券投基、东方和极养标五年持有期混合型基中基（FOF）、东方和平养标三年持有期混合型基中基（FOF）、东方和健养标两年持有期混合型基中基（FOF）、东方智三年持有期混合型券投基、东方丰债债券型券投基、东方优一年持有期混合型券投基、东方泰66个月定期开放债券型券投基、东方招一年持有期混合型券投基、东方安39个月定期开放债券型券投基、东方明优两年定期开放混合型券投基、东方元3个月定期开放混合型发式券投基、东方启三年持有期混合型券投基、东方丰优两年定期开放混合型券投基、东方多元混合型券投基、东方欣和平两年持有期混合型基中基（FOF）、东方创新势混合型券投基、东方价值混合型券投基、东方启三年持有期混合型券投基、东方启三年持有期混合型券投基、东方启三年持有期混合型券投基、东方和18个月持有期混合型券投基、东方启恒三年持有期混合型券投基、东方启华三年持有期混合型券投基、东方内增混合型券投基、东方安一年持有期混合型券投基、东方新源三年持有期混合型券投基、东方新海混合型券投基、东方智华三年持有期混合型券投基、东方智三年持有期混合型券投基、东方和三年定期开放混合型券投基、东方启兴三年持有期混合型券投基、东方中东方利低波动指数券投基共78只公开募券投基。

4.1.2 基 (或基小) 及基助介

| 姓名 | 务 | 任本基基 (助) 期 | | 券从 业年 | 明 |
|----|-------------|------------|-----|----------|---|
| | | 任日期 | 任日期 | | |
| 王佳 | 上海东方券产有限公司基 | 2020年7月23日 | - | 6年 | 上海东方券产有限公司基 2019年08月 今任东方核心优 一年定期开放混合型券投基基 2020年01月 今任东方安 一年持有期混合型券投基基 2020年02月 今任东方匠心 一年持有期混合型券投基基 |

| | | | | | |
|---|----------------------|--------------------|---|-----|---|
| | | | | | <p>2020 年 03 月 今任东方 均 优 两年定期开放混合型 券投 基 基</p> <p>2020 年 07 月 今任 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 基</p> <p>2021 年 05 月 今任东方 和 18 个月持有期混合型 券投 基 基</p> <p>帝国工学 学 士。曾任国信 券 份有 公司助 分析师，上海东方 券 产 有 公司投 支持</p> <p>具备 券投 基 从业 格。</p> |
| 丁 | 上海东方 券 产 有 公司基 | 2020 年 8 月 27 日 | - | 9 年 | <p>上海东方 券 产 有 公司基</p> <p>2018 年 11 月 今任东方 币市场 基 基</p> <p>2020 年 07 月 今任东方 泰 66 个月定期开放债券型 券投 基 基</p> <p>2020 年 08 月 今任东方 优 一年持有期混合型 券投 基 基</p> <p>2020 年 09 月 今任东方 安 39 个月定期开放债券型 券投 基 基</p> <p>牛津大学 学 士。曾任交 份有 公司 产 业务中心投 交 施 德基 有 公司专 户投 投 助 上海东方 券 产 有 公司投 助 具备 券 投 基 从业 格。</p> |

注：1、上 格内基 任基 “任 日期”指基 合同 效日，“任日期”指根据公司 决定 定 日期；对此后 任基 “任 日期”和 “任日期”均指根据 根据公司决定 定 任日期和 日期。

2、券从业 涵义 从 业协会《券业从业人员 格 办法》 关 定。

4.1.3 期末兼任 募 产 划投 基 同时 产品情况

本基 基 本报告期末未兼任 募 产 划投

4.2 人对报告期内本基 作 守信情况 明

本报告期，上海东方 券 产 有 公司作为本基 人，严格 守《中华人民共和国 券投 基 法》、《中华人民共和国 券法》、基 合同以及其它有关法律法 定，本 实 信 、勤勉尽 原则 和 基 产，为基 份 持有人 求最大利 ，无损害基 持有人利 为，本基 投 合 合有关法 及基 合同 定。

4.3 对报告期内公平交易情况 专 明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国 券投 基 法》、《 券投 基 公司公平交易制度指导意 》关法律法 关于公平交易 定，公司建 了与公平交易 关 控制制度、流 以及信息披 序 ，保 公司在投 活动中公平对待各投 合， 不同投 合之 利 ，并定期对同向交易、反向交易和异常交易 为 控和分析。公司旗下投 合 交易执 和投 决 互分 ，公司 交易实 中交易制度，各投 合 所有 券交易活 动均 交易 中 一完成。公司建 公平 交易分 机制， 保各投 合享有公平 交易执 机会。 对公司各投 合及 合之 交易 为 事后分析，校 公平交易 执 情况。对于同向交易， 侧 于对公司 不同产品（包含了公募产品、 募产 品） 整体收 率差异、投 别（ 、债券） 收 率差异 分析，对 四个季度期 内交易所 价交易 所有交易 录，在不同时 下（日内、3 日内、5 日内） 同向交易价差按 两两 合 显 性检 ，并根据显 性检 果，对 合异常交易 条件并 定 值 交易 录， 检查或抽样分析 方法，分析 应交易 为 公平性。对于反向交易，原则 上 止 合 日内反向交易，完全按照有关指数构成比例 投 投 合 外。如有投 或流动性 特殊 ， 投 提供投 依据， 投 决 委员会审慎审批后 档备 查。本年度未发现公司 投 合 存在 反公平交易原则 交易 为。

4.3.2 公平交易制度 执 情况

本基 人一 公平对待旗下 所有基 和 合，制定并严格 守 应 制度和流 ， 和人工 方式在各环 严格控制交易公平执 。报告期内，本公司严格执 了《 券投 基 公司公平交易制度指导意 》和《上海东方 券 产 有 公司公平交易制度》 定。

4.3.3 异常交易 为 专 明

报告期内未发现本基 存在异常交易 为。

报告期内，未出现涉及本基 交易所公开 价同日反向交易成交 少 单 交易 券当日成交 5% 情况。

4.4 对报告期内基 投 和业 现 明

4.4.1 报告期内基 投 和 作分析

下半年受地产拖 ，加上传 基建投 持 放 ， 济下 压力 大，在宽信 宽 币 期下，10Y 利率债 下 ，信 债下 更为显 ，全年 10Y 利率债下 40BP。下半年增

了一分信债，当拉合久期，到年底市场收率整体处于历史低位，价值不，以守为主，信和利率上。

方，全年整体为宽松，四季度受年末因影响，价格中枢二三季度有所上，价格波动加大，但年价格平。合在币宽松条件下，杠杆增厚整体收。

到市场夜模处于位，合当借入期，熨平价格波动，免大幅影响成本。

权方，2021年A市场势呈现明显分化情，沪深300指数全年下5.2%，国2000指数上涨29.2%；港市场现不佳，恒指数全年下14.1%。报告期内，合仓位持标，和产品期波动率定位匹；构上，上半年构整不大，但下半年对一分估值上多个减仓，主在力、煤炭、光伏板块，另一方对一分估值整到对合水平公司了增，主中在TMT、医、化工域，同时合持对估值合业健增优头公司。

债方，2021年债市场现强劲，中债指数上涨18.5%，合内债仓位也在报告期内献了一定收，但于债市场估值处于位，合内债整体仓位不，构上以偏债型品和分低估值周期债为主。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

截本报告期末，本基金A份净值为1.0244元，份净值为1.1034元；C份净值为1.0238元，份净值为1.0238元。本报告期基金A份净值增率为6.64%，同期业比基准收率为1.31%；C份净值增率为0.00%，同期业比基准收率为0.75%。

4.5 人对宏观经济、证券市场及行业趋势展望

去年四季度地产债加剧，带来信债收率大幅分化，民企地产债收率暴，与此同时济实力好地区城投收率一步下探，信债投交易常拥挤。一季度济基本仍然弱，地产售数据不乐，基建发力效果尚未体现，币宽松央息叠加年初压力，收率快下，信利差一步压，信债收率处于历史低位。入2月份政托底效果初现，信改善持性，加上房地产市场底，地产债止回升，数据公布后，收率小幅反弹一波，PMI公布后，利率一步上。展望未来，市场待两个会地——3月5日全国两会和3月16日储息会。有期政或数据，债券收率可一步上，期利差处于位。了收率上外，仍惕信，地产基本仍未发实性改善，地方政收入下带来中低城投增加。

权方，2022年开年A市场了强“”，一方国内济临“供冲击、

求收、期弱”三压力，另一方面海外于抬升，欧央加息期升温，同时叠加地政治冲，一步加大了产波动。展望后市，从宏基本来，然新冠情仍有反复，济仍在底，但在“增”政基和宽松币政下，国内宏环境在步改善。但值得关注是，以原油为代大宗商品价格大幅上涨，中下游业临大成本压力，国内宏济复带来一定不稳定性。从市估值来，前期整，A整体估值水平已回历史中位数位，分此前估值成板块也整对合水水平，从中期来已具备一定性价比。在投上，我们仍将坚持价值投念，一方对合中现有持仓持，另一方市场一步整，下上估值合成

大、争优势强公司。

债方，同A一样，债市场在2022年年初也临了一定整，估值从历史极位处有所回。尽 在2021年合中债仓位低，但我们仍然为债从期来是一值得关注和产，我们保持了对个券基本和。未来如果债市场估值出现一步整，回到历史合区，我们也将下上具备性价比个券。

4.6 人内 有关本基 察 核工作情况

公司日常 察 核工作主 合 核和 根据 分工开展，2021年开展了如下主 工作：

在合 履 方：(1)切实履 日常合 ，包括合 审查、合 宣导、合 培、合 报告、合 咨、合 检查/核、沟 与 合；(2)持 加强员工执业 为 包括持 促和指导员工及时完成投 报工作，一步完善即时 工具 控，一步加强合 测工作，以及建 员工手机下单 为合 检查机制；(3)提升反洗 工作有效性，牵头修 反洗 内控制度及操作 ，按时完成各 反洗 工作报告及报 ，推动反洗 改 升；(4)步 各 法律事务；(5)深入开展合 专 。

在 履 方：(1)切实履 日常 ，做到事前、事中、事后 按 按时完成内外 各 定期 控报告及数据报；(2)深入梳 内 控 则及操作流 ，对各 业务 内 控制措施 极 梳 牵头 定具体方案并推 实；(3)流 方 ，为提 工作效率，对信息披 流、债券交易偏 度审批、参数变更 流 了优化。

4.7 人对报告期内基 估值 序 事 明

本报告期内，本基 人严格 守《企业会 准则》、《券投 基 会 核 业务指引》以及中国 会发布 《中国 会关于 券投 基 估值业务 指导意 》 关 定和基 合同 定，对基 所持有 投 品 估值，本基 托 人根据法律法 求履 估值及净

值 复核 任。基 份 净值 基 人完成估值后， 基 托 人复核无 后 基 人对外公布。

本基 人对投 品 估值时原则上应保持估值 序和技术 一 性，对旗下 不同产品持有 具有 同特征 同一投 品 估值 整原则、 序及技术应当一 （中国 会 定 特殊品 外）。为了保 基 实、准 地反映投 品 公允价值，本基 授权估值委员会 建 健全估值决 体 ，估值委员会成员 任命和 整 总 办公会审 决定。 是估值委员会 日常办事机构， 关注 关投 品 动态， 定估值日 估值测 或 整 投 品 ，并提交估值委员会审 。 估值人员均具有专业会 学 习 历，具有基 从业人员 格。

4.8 人对报告期内基 利润分 情况 明

根据本基 基 合同 定，在 合有关基 分 条件 前提下， 每季度末每 10 份基 份 可供分 利润 大于 于 0.01 元，则本基 收 分 ，收 分 比例不低于收 分 基 准日可供分 利润 60%。

本报告期内，本基 实施利润分 4 次，供分 利润 94,630,930.53 元，其中 A 为 94,630,930.53 元，C 未分 。

4.9 报告期内 人对本基 持有人数或基 产净值 情形 明

报告期内，本基 未出现 二十个工作日基 份 持有人数 不满二 人或 基 产净值低于五千万元 情形。

§ 5 托 人报告

5.1 报告期内本基 托 人 守信情况声明

本报告期内，中国光大 份有 公司在东方 优 一年持有期混合型 券投 基 （以下 “本基 ”）托 中，严格 守了《中华人民共和国 券投 基 法》、《公开募 券投 基 作 办法》、《公开募 券投 基 信息披 办法》及其他法律法 、基 合同、托 协 定，依法安全保 了基 全 产，对本基 投 作 了全 会 核 和应有 ，对发现 及时提出了意 和建 。同时，按 定如实、独 地向 机构提交了本基 作情况报告，没有发 任何损害基 份 持有人利 为， 实信 、 勤勉尽 地履 了作为基 托 人所应尽 义务。

5.2 托 人对报告期内本基 投 作 守信、净值 、利润分 情况 明

本报告期内，中国光大 份有 公司依据《中华人民共和国 券投 基 法》、《公开募

券投 基 作 《办法》、《公开募 券投 基 信息披 办法》及其他法律法 、 基 合同、托 协 定，对基 人 投 作、信息披 为 了复核、 ， 未发现基 人在投 作、基 产净值 、基 份 回价格 、基 开支 方 存在损害基 份 持有人利 为。 基 在 作中 守了有关法律法 求， 各 方 投 人依据基 合同及实 作情况 处

5.3 托 人对本年度报告中 务信息 内容 实、准 和完整发 意

中国光大 份有 公司依法对基 人 制 《东方 优 一年持有期混合型 券投 基 2021 年年度报告》 了复核， 为报告中 关 务指标、净值 现、 务会 报告 (注： 务会 报告中 “ 工具 及 ” 分未在托 人复核 围内)、投 合报告 内容 实、准 。

§ 6 审 报告

6.1 审 报告基本信息

| | |
|---------|------------------------|
| 务报 是否 审 | 是 |
| 审 意 型 | 标准无保 意 |
| 审 报告 号 | 普华永 中天审字(2022) 25021 号 |

6.2 审 报告 基本内容

| | |
|---------|---|
| 审 报告标 | 审 报告 |
| 审 报告收件人 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 全体基 份 持有人 |
| 审 意 | <p>(一)我们审 内容</p> <p>我们审 了东方 优 一年持有期混合型 券投 基 (以下 “东方 优 一年持有混合基 ”) 务报 ，包括 2021 年 12 月 31 日 产 债 ，2021 年度 利 润 和所有 权 (基 净值)变动 以及 务报 注。</p> <p>(二)我们 意</p> <p>我们 为，后 务报 在所有 大方 按照企业会 准则和在 务报 注中所列 中国 券 委员会 (以下 “中国 会”)、中国 券投 基 业协会(以下 “中国基 业协会”)发布 有关 定及允 基 业 实务操作 制，公允反映了东方 优 一年持有混合基 2021 年 12 月 31 日 务状况以及 2021 年度 成果 和基 净值变动情况。</p> |
| 形成审 意 基 | 我们按照中国注册会 师审 准则 定执 了审 工作。 审 报告 “注册会 师对 务报 审 任” 分 一步 了我们在 些准则下 任。我们 信，我们 取 审 据是充分、 当 ，为发 审 意 提供了基 。 |

| | |
|----------------------|--|
| | <p>按照中国注册会 师 业 德守则，我们独 于东方 优 一年持有混合基 ，并履 了 业 德方 其他 任。</p> |
| <p>强 事</p> | <p>-</p> |
| <p>其他事</p> | <p>-</p> |
| <p>其他信息</p> | <p>-</p> |
| <p>层和治层对 务报 任</p> | <p>东方 优 一年持有混合基 基 人上海东方 券 产 有 公司(以下 “基 人”) 层 按照企业会 准则和中国 会、中国基 业协会发布 有 关 定及允 基 业实务操作 制 务报 ，使其实现 公允反映，并 、执 和 护必 内 控制，以使 务 报 不存在 于 弊或 导 大 报。 在 制 务报 时，基 人 层 估东方 优 一年持有混合基 持 力，披 与持 关 事 (如)，并 持 假 ， 基 人 层 划清 东方 优 一年持有混合基 、 止 或别无其他现实 择。 基 人治层 东方 优 一年持有混合基 务报告 。</p> |
| <p>注册会 师对 务报 审 任</p> | <p>我们 标是对 务报 整体是否不存在 于 弊或 导 大 报 取合 保 ，并出具包含审 意 审 报 告。合 保 是 水平 保 ，但并不 保 按照审 准则 执 审 在某一 大 报存在时总 发现。 报可 于 弊或 导 ，如果合 期 报单独或汇总 来可 影 响 务报 使 依据 务报 作出 济决 ，则 常 为 报是 大 。 在按照审 准则执 审 工作 中，我们 业判断， 并保持 业怀 。同时，我们也执 以下工作： (一) 别和 估 于 弊或 导 务报 大 报 ； 和实施审 序以应对 些 ，并 取充分、 当 审 据，作为发 审 意 基 。 于 弊可 涉及串 、伪 、故意 漏、 假 或凌 于内 控制之 上，未 发现 于 弊导 大 报 于未 发现 于 导 大 报 。 (二) 了 与审 关 内 控制，以 恰当 审 序， 但 并 对内 控制 有效性发 意 。 (三) 价基 人 层 会 政 恰当性和作出 会 估 及 关披 合 性。 (四) 对基 人 层使 持 假 恰当性得出 。同时，根据 取 审 据，就可 导 对东方 优 一年持有混合基 持 力产 大 事 或情况是否存在 大不 定性得出 。如果我们得出 为存在 大不 定性，审 准则 求我们在审 报告中提 报 使 注意 务报 中 关披 ；如果披 不充分，</p> |

| | |
|-----------|--|
| | 我们应当发 无保 意 。我们 基于截 审 报告日可 得 信息。然 ，未来 事 或情况可 导 东方 优 一年持有混合基 不 持 。 |
| | (五) 价 务报 总体列报(包括披)、 构和内容，并 价 务报 是否公允反映 关交易和事 。 |
| | 我们与基 人治 层就 划 审 围、时 安排和大审 发现 事 沟 ，包括沟 我们在审 中 别出 值得关注 内 控制 。 |
| 会 师事务所 名 | 普华永 中天会 师事务所(特殊普 合伙) |
| 注册会 师 姓名 | 熹 叶尔 |
| 会 师事务所 地址 | 上海市 浦区湖滨 202 号 展企业广场二座普华永 中心 11 楼 |
| 审 报告日期 | 2022 年 3 月 28 日 |

§ 7 年度 务报

7.1 产 债

会 主体：东方 优 一年持有期混合型 券投 基

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 产 | 注号 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|---------------|-----------|-------------------------|--------------------------|
| 产： | | | |
| 存款 | 7.4.7.1 | 6,879,383.80 | 2,832,117.63 |
| 备付 | | 9,795,613.02 | 5,340,785.98 |
| 存出保 | | 87,331.36 | 86,917.81 |
| 交易性 产 | 7.4.7.2 | 1,553,598,209.47 | 1,349,561,471.61 |
| 其中： 投 | | 152,322,575.27 | 132,047,392.73 |
| 基 投 | | - | - |
| 债券投 | | 1,401,275,634.20 | 1,187,514,078.88 |
| 产支持 券投 | | - | 30,000,000.00 |
| 属投 | | - | - |
| 产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入 售 产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收 券清 款 | | 75,930,909.31 | 1,359,431.01 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 17,128,656.99 | 21,414,164.77 |
| 应收 利 | | - | - |
| 应收 款 | | - | - |
| 延所得 产 | | - | - |
| 其他 产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 产总 | | 1,663,420,103.95 | 1,380,594,888.81 |
| 债和所有 权 | 注号 | 本期末 | 上年度末 |

| | | 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
|--------------|----------|------------------|------------------|
| 债： | | | |
| 期借款 | | - | - |
| 交易性 债 | | - | - |
| 债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回 产款 | | 239,349,000.00 | 337,967,827.55 |
| 应付 券清 款 | | 75,094,898.06 | - |
| 应付 回款 | | - | - |
| 应付 人报 | | 803,943.45 | 612,190.37 |
| 应付托 | | 229,698.14 | 174,911.54 |
| 应付 售服务 | | 110.53 | - |
| 应付交易 | 7.4.7.7 | 25,370.08 | 22,723.50 |
| 应交 | | 111,674.34 | 98,346.33 |
| 应付利息 | | -61,299.45 | 394,501.90 |
| 应付利润 | | - | - |
| 延所得 债 | | - | - |
| 其他 债 | 7.4.7.8 | 220,000.00 | 150,000.00 |
| 债合 | | 315,773,395.15 | 339,420,501.19 |
| 所有 权： | | | |
| 实收基 | 7.4.7.9 | 1,315,587,265.26 | 1,004,555,510.85 |
| 未分 利润 | 7.4.7.10 | 32,059,443.54 | 36,618,876.77 |
| 所有 权 合 | | 1,347,646,708.80 | 1,041,174,387.62 |
| 债和所有 权 总 | | 1,663,420,103.95 | 1,380,594,888.81 |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基 份 总 1,315,587,265.26 份，其中东方 优

A 基 份 总 1,315,189,720.09 份，基 份 净值 1.0244 元；东方 优 C 基 份 总 397,545.17 份，基 份 净值 1.0238 元。

7.2 利润

会 主体：东方 优 一年持有期混合型 券投 基

本报告期：2021 年 1 月 1 日 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| | 注册号 | 本期 | | 上年度可比期 |
|-----------|----------|----------------|------------------|---|
| | | 2021 年 1 月 1 日 | 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 7 月 23 日（基 合同 效日） 2020 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | | | 83,342,943.81 | 43,992,897.74 |
| 1. 利息收入 | | | 45,016,131.48 | 15,895,932.23 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | | 286,466.08 | 210,875.72 |
| 债券利息收入 | | | 43,760,148.55 | 14,607,015.70 |
| 产支持 券利息 | | | 165,731.71 | 136,083.29 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 收入 | | | |
| 买入 售 产 收入 | | 803,785.14 | 941,957.52 |
| 券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投 收 (损失以“-” 填列) | | 41,209,356.61 | 10,953,800.02 |
| 其中: 投 收 | 7.4.7.12 | 38,193,614.29 | 10,176,152.13 |
| 基 投 收 | - | - | - |
| 债券投 收 | 7.4.7.13 | -241,491.85 | 613,464.49 |
| 产支持 券投 收 | 7.4.7.13.5 | - | - |
| 属投 收 | 7.4.7.14 | - | - |
| 工具收 | 7.4.7.15 | - | - |
| 利收 | 7.4.7.16 | 3,257,234.17 | 164,183.40 |
| 3. 公允价值变动收 (损失 以“-”号填列) | 7.4.7.17 | -2,882,812.29 | 17,143,165.49 |
| 4. 汇兑收 (损失以“-” 号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入 (损失以“-” 号填列) | 7.4.7.18 | 268.01 | - |
| 减: 二、 | | 15,724,887.73 | 7,374,020.97 |
| 1. 人报 | 7.4.10.2.1 | 8,222,138.35 | 3,127,894.77 |
| 2. 托 | 7.4.10.2.2 | 2,349,182.40 | 893,684.18 |
| 3. 售服务 | 7.4.10.2.3 | 110.53 | - |
| 4. 交易 | 7.4.7.19 | 463,032.26 | 255,707.53 |
| 5. 利息支出 | | 4,313,084.71 | 2,903,860.76 |
| 其中: 卖出回 产支 出 | | 4,313,084.71 | 2,903,860.76 |
| 6. 及 加 | | 121,939.48 | 39,373.73 |
| 7. 其他 | 7.4.7.20 | 255,400.00 | 153,500.00 |
| 三、利润总 (亏损总 以 “-”号填列) | | 67,618,056.08 | 36,618,876.77 |
| 减: 所得 | | - | - |
| 四、净利润 (净亏损以“-” 号填列) | | 67,618,056.08 | 36,618,876.77 |

7.3 所有 权 (基 净值) 变动

会 主体: 东方 优 一年持有期混合型 券投 基

本报告期: 2021 年 1 月 1 日 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

| | |
|--|---------------------------------------|
| | 本期 2021 年 1 月 1 日 2021 年 12 月 31 日 |
|--|---------------------------------------|

| | 实收基 | 未分 利润 | 所有 权 合 |
|--|---------------------|----------------|------------------|
| 一、期初所有 权（基 净值） | 1,004,555,510.85 | 36,618,876.77 | 1,041,174,387.62 |
| 二、本期 活 动产 基 净 值变动数（本期 利润） | - | 67,618,056.08 | 67,618,056.08 |
| 三、本期基 份 交易产 基 净值变动数 （净值减少以 “-”号填列） | 311,031,754.41 | 22,453,441.22 | 333,485,195.63 |
| 其中：1. 基 款 | 900,325,363.97 | 38,725,930.10 | 939,051,294.07 |
| 2. 基 回款 | -589,293,609.56 | -16,272,488.88 | -605,566,098.44 |
| 四、本期向基 份 持有人分 利润产 基 净值变动（净值 减少以“-”号填 列） | - | -94,630,930.53 | -94,630,930.53 |
| 五、期末所有 权（基 净值） | 1,315,587,265.26 | 32,059,443.54 | 1,347,646,708.80 |
| | 上年度可比期 | | |
| | 2020年7月23日（基 合同 效日） | | 2020年12月31日 |
| | 实收基 | 未分 利润 | 所有 权 合 |
| 一、期初所有 权（基 净值） | 1,004,555,510.85 | - | 1,004,555,510.85 |
| 二、本期 活 动产 基 净 值变动数（本期 利润） | - | 36,618,876.77 | 36,618,876.77 |
| 三、本期基 份 交易产 基 净值变动数 （净值减少以 “-”号填列） | - | - | - |
| 其中：1. 基 款 | - | - | - |
| 2. 基 回款 | - | - | - |
| 四、本期向基 | - | - | - |

| | | | |
|--|------------------|---------------|------------------|
| 份 持有人分 利润产 基 净值变动（净值 减少以“-”号填 列） | | | |
| 五、期末所有 权（基 净值） | 1,004,555,510.85 | 36,618,876.77 | 1,041,174,387.62 |

报 注为 务报 成 分。

本报告 7.1 7.4 务报 下列 人 ：

张 汤 培

基 人 人 主 会 工作 人 会 机构 人

7.4 报 注

7.4.1 基 基本情况

东方 优 一年持有期混合型 券投 基（以下 “本基 ”）中国 券 委员会（以下 “中国 会”） 可[2020]639号《关于准予东方 优 一年持有期混合型 券投 基 注册 批复》核准，上海东方 券 产 有 公司依照《中华人民共和国 券投 基 法》和《东方 优 一年持有期混合型 券投 基 基 合同》 公开募 。本基 为契 型开放式基 ，存 期 不定，次 募 不包括 利息共募 人民币 1,004,194,726.39元。业 普华永 中天会 师事务所(特殊普 合伙)普华永 中天 字(2020) 0584号 报告予以 。向中国 会备案，《东方 优 一年持有期混合型 券投 基 基 合同》于2020年7月23日正式 效，基 合同 效日 基 份 总 为 1,004,555,510.85份基 份 ，其中 利息折合 360,784.46份基 份 。本基 基 人为上海东方 券 产 有 公司，基 托 人为中国光大 份有 公司。

根据《关于东方 优 一年持有期混合型 券投 基 增加C 基 份 及修改基 合同和托 协 公告》以及更新后《东方 优 一年持有期混合型 券投 基 基 合同》，本基 2021年10月28日(含) 增加C 基 份 。本基 根据 、 售服务 收取方式及 机构 不同，将基 份 分为不同 别。在投 人 基 时收取 ，在 回时根据持有期 收取 回 ，不 提 售服务 ，为A 基 份 。本基 A 基 份 机构为中国 券 有 任公司。在投 人 基 时不收取 ，是从本 别 基 产中 提 售服务 ，在 回时根据持有期 收取 回 ，为C 基 份 。本基 C 基 份 机构为上海东方 券 产 有 公司。本基 A 基 份 、C 基 份 分别 代 。于基 不同，本基 A 基 份 和C 基 份 将分别 基 份

净值。

根据《东方 优 一年持有期混合型 券投 基 基 合同》 关 定，本基 每份基 份 1 年 定持有期， 利再投 来 基 份 不受 定持有期 制。 定持有期指基 合同 效日(对 份 ，下同)、基 份 日(对 份 ，下同)或基 份 换 入 日(对 换 入份 ，下同) (即 定持有期 始日)， 基 合同 效日、基 份 日或基 份 换 入 日次 1 年 年度对日(即 定持有期到期日)止。每份基 份 定持有期 束后即 入开放持有期， 其开放持有期 日 才可以办 回及 换 出业务，每份基 份 开放持有期 日为 定持有期 始日次 1 年 年度对日， 年度对日为 工作日或不存 在对应日期 ，则 延 下一个工作日。

根据《中华人民共和国 券投 基 法》和《东方 优 一年持有期混合型 券投 基 基 合同》 有关 定，本基 投 围包括国内依法发 上市 及存托凭 (含中小板、创业板及其他 中国 会核准或注册上市 及存托凭)、港 标 、债券(包括国内依法发 国家债券、地方政府债、政府支持机构债、 债券、公开发 次 债券、中央 据、企业债券、公司债券、中期 据、 期 券、 期 券、可 换债券、可分 交易可 债 债 分、可交换债、 券公司 期公司债券)、债券回 、 存款(包括协 存款、 存款、定期存款)、同业存单、 币市场工具、 产支持 券、 指期 、国债期 以及 中国 会允 基 投 其他 工具(但 合中国 会 关 定)。如法律法 或 机构以后允 基 投 其他品 ，基 人在履 当 序后，可以将其 入投 围。本基 投 合中 产 (含存托凭) 投 比例为基 产 0%—30% (其中投 于港 标 比例占 产 0%-50%)；本基 投 同业存单 比例不得 基 产 20%；

本基 每个交易日日 在扣 指期 和国债期 合 交易保 后，保持现 或到期日在一年以内 政府债券投 比例合 不低于基 产净值 5%，但在本基 份 定持有期内，本基 不受前 5% 制。本基 份 定持有期内每个交易日日 在扣 指期 、国债期 合 交易保 后，应当保持不低于交易保 一倍 现 。前 现 不包括 备付 、存出保 、应收 款 。如果法律法 或中国 会变更投 品 投 比例 制，基 人在履 当 序后，可以 整上 投 品 投 比例。本基 业 比 基准为：沪深 300 指数收 率×8%+恒 指数收 率×2%+中债 合指数收 率×90%。

本 务报 基 人上海东方 券 产 有 公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计政策

本基金财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方优一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列中国会计准则、中国基金业协会发布的相关规定及允许基金行业实务操作制度。

本财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日财务状况以及 2021 年度经营成果和基金净值变动情况有关信息。

7.4.4 会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本报告实际编制期为 2020 年 7 月 23 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 本位币

本基金本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产分类

(1) 资产分类

资产于初始确认时分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有到期投资。资产分类取决于本基金对资产持有意图和持有能力。本基金现无资产分为可供出售金融资产及持有到期投资。

本基金前以交易性金融资产、债券投资、资产支持证券和工具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。工具所产生资产在资产负债表中以金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有其他资产分为应收款项，包括存款、买入卖出金融资产和其他各项应收款项。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的资产。

(2) 负债分类

负债于初始确认时分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的负债及其他负债。本基金前暂无以公允价值计量且其变动计入当期损益的负债。本

基 持有 其他 债包括卖出回 产款和其他各 应付款 。

7.4.4.4 产和 债 初始 、后 和 止

产或 债于本基 成为 工具合同 一方时,按公允价值在 产 债 内 。以公允价值 且其变动 入当期损 产,取得时发 关交易 入当期损 ;对于支付 价款中包含 债券或 产支持 券 息日或上次 息日 买日止 利息,单独为应收 。应收款 和其他 债 关交易 入初始 。

对于以公允价值 且其变动 入当期损 产,按照公允价值 后 ;对于应收款 和其他 债 实 利率法,以摊余成本 后 。

产满 下列条件之一 ,予以 止 : (1) 收取 产现 流 合同权利 止; (2) 产已 ,且本基 将 产所有权上几乎所有 和报 入方; 或 (3) 产已 ,然本基 既没有 也没有保 产所有权上几乎所有 和报 ,但是放弃了对 产控制。

产 止 时,其 价值与收到 对价 差 , 入当期损 。

当 债 现时义务全 或 分已 时, 止 债或义务已 分。 止 分 价值与支付 对价之 差 , 入当期损 。

7.4.4.5 产和 债 估值原则

本基 持有 投 、债券投 、 产支持 券投 和 工具按如下原则 定公允价值 并 估值:

(1) 存在活 市场 工具按其估值日 市场交易价格 定公允价值;估值日无交易且最 交易日后未发 影响公允价值 大事件 ,按最 交易日 市场交易价格 定公允价值。有充 据 明估值日或最 交易日 市场交易价格不 实反映公允价值 ,应对市场交易价格 整, 定公允价值。与上 投 品 同,但具有不同特征 ,应以 同 产或 债 公允价值为基 ,并在估值技术中 不同特征因 影响。特征是指对 产出售或使 制 ,如果 制是 对 产持有 ,么在估值技术中不应将 制作为特征 。此外,基 人不应 因大 持有 关 产或 债所产 溢价或折价。

(2) 当 工具不存在活 市场, 在当前情况下 并且有 够可利 数据和其他信息 支持 估值技术 定公允价值。 估值技术时,优先使 可 察 入值,只有在无法取得 关 产或 债可 察 入值或取得不切实可 情况下,才可以使 不可 察 入值。

(3) 如 济环境发 大变化或 券发 人发 影响 工具价格 大事件,应对估值

整并 定公允价值。

7.4.4.6 产和 债 抵

本基金持有 产和承担 债基本为 产和 债。当本基金 1) 具有抵 已 法定权利且 法定权利现在是可执 ；且 2) 交易双方准备按净 时， 产 与 债按抵 后 净 在 产 债 中列 。

7.4.4.7 实收基

实收基 为对外发 基 份 所募 总 在扣 损 平准 分摊 分后 余 。 于 和 回引 实收基 变动分别于基 日及基 回 日 列。上 和 回分 别包括基 换所引 入基 实收基 增加和 出基 实收基 减少。

7.4.4.8 损 平准

损 平准 包括已实现平准 和未实现平准 。已实现平准 指在 或 回基 份 时， 或 回款 中包含 按 未分 已实现损 占基 净值比例 。未实现平准 指在 或 回基 份 时， 或 回款 中包含 按 未实现损 占基 净值比例 。损 平准 于基 日或基 回 日 列，并于期末全 入未分 利润/(亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失) 和

投 在持有期 应取得 现 利扣 上市公司代扣代 个人所得 后 净 为投 收 。债券投 在持有期 应取得 按 利率或 发 价 利息扣 在 情况下 债券发 企业代扣代 个人所得 及 基 增值 后 净 为利息收入。 产支持 券在持有期 收到 款 ，根据 产支持 券 收 率或 利率区分属于 产 支持 券投 本 分和投 收 分，将本 分冲减 产支持 券投 成本，并将投 收 分扣 在 情况下 基 增值 后 净 为利息收入。

以公允价值 且其变动 入当期损 产在持有期 公允价值变动 为公允价 值变动损 ；于处 时，其处 价格与初始 之 差 为投 收 ，其中包括从公 允价值变动损 公允价值 变动 。

应收款 在持有期 利息收入按实 利率法 ，实 利率法与 法差异 小 则 按 法 。

7.4.4.10 和

本基 人报 、托 和 售服务 在 涵 期 按基 合同 定 率和 方 法 日 。

其他 债在持有期 利息支出按实 利率法 ，实 利率法与 法差异 小 则按 法

7.4.4.11 基 收 分 政

本基 同一 别 每一基 份 享有同 分 权。本基 收 以现 形式分 ，但基 份 持有人可 择现 利或将现 利按分 权日 基 份 净值 动 为基 份 再投 。 期末未分 利润中 未实现 分为正数，包括基 活动产 未实现损 以及基 份 交易产 未实现平准 ，则期末可供分 利润 为期末未分 利润中 已实现 分； 期末未分 利润 未实现 分为 数，则期末可供分 利润 为期末未分 利润，即已实 现 分 抵未实现 分后 余 。

宣告 拟分 基 收 于分 权日从所有 权 出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发 日 即期汇率将外币 折 为人民币入 。

以公允价值 外币 币性 ，于估值日 估值日 即期汇率折 为人民币，所产 折 差 接 入公允价值变动损 。

7.4.4.13 分 报告

本基 以内 构、 求、内 报告制度为依据 定 分 ，以 分 为基 定报告分 并披 分 信息。 分 是指本基 内同时满 下列条件 成 分：(1) 成 分 够在日常活动中产 收入、发 ；(2) 本基 基 够定期 价 成 分 成果，以决定向其 源、 价其业 ；(3) 本基 够取得 成 分 务状况、 成果和现 流 有关会 信息。如果两个或多个 分 具有 似 济特征，并且满 一定条件 ，则合并为一个 分 。

本基 前以一个单一 分 作，不 披 分 信息。

7.4.4.14 其他 会 政 和会 估

根据本基 估值原则和中国 会允 基 业估值实务操作，本基 定以下 别 投 和债券投 公允价值时 估值方法及其关 假 如下：

(1) 对于 券交易所上市 和债券， 出现 大事 停牌或交易不活 (包括涨 停时 交易不活) 情况，本基 根据中国 会公告[2017]13号《中国 会关于 券投 基

估值业务 指导意 》，根据具体情况 《关于发布中基协(AMAC)基 业 估值指数 》 提供 指数收 法、市 率法、现 流 折现法 估值技术 估值。

(2) 对于在 定期内 公开发 、 次公开发 时公司 东公开发售 份、 大宗交易取得 带 售期 流 受 ，根据中国基 业协会中基协发[2017]6号《关 于发布〈 券投 基 投 流 受 估值指引()〉 》之 件《 券投 基 投 流 受 估值指引()》(以下 “指引”)，按估值日在 券交易所上市交易 同一 公允价值扣 中 指数有 公司根据指引所独 提供 流 受 剩余 售期对应 流动 性折扣后 价值 估值。

(3) 对于在 券交易所上市或挂牌 固定收 品 (可 换债券 外)及在 同业 市场交易 固定收 品 ，根据中国 会公告[2017]13号《中国 会关于 券投 基 估值 业务 指导意 》及《中国 券投 基 业协会估值核 工作小 关于 2015 年 1 季度固定收 品 估值处 标准》 估值技术 定公允价值。本基 持有 券交易所上市或挂牌 固 定收 品 (可 换债券 外)，按照中 指数有 公司所独 提供 估值 果 定公允价值。本 基 持有 同业市场固定收 品 按照中债 估值中心有 公司所独 提供 估值 果 定公允价值。

7.4.5 会 政 和会 估 变更以及差 更正 明

7.4.5.1 会 政 变更 明

政 于 2017 年 布了修 后 《企业会 准则 14 号—收入》，本基 于 2021 年 1 月 1 日 执 。本基 在 制 2021 年度 务报 时已 准则， 准则 未对本基 务报 产 大影响。

7.4.5.2 会 估 变更 明

本基 本报告期未发 会 估 变更。

7.4.5.3 差 更正 明

本基 在本报告期 无 明 会 差 更正。

7.4.6

根据 政 、国家 务总局 [2002]128 号《关于开放式 券投 基 有关 收 》、 [2008]1 号《关于企业所得 干优惠政 》、 [2012]85 号《关于实施上市 公司 息 利差别化个人所得 政 有关 》、 [2014]81 号《 政 国家 务总局 会关于沪港 市场交易互 互 机制 点有关 收政 》、 [2015]101 号《关于

上市公司 息 利差别化个人所得 政 有关 》、 [2016]36 号《关于全 推开 业 改征增值 点 》、 [2016]46 号《关于 一步明 全 推开 改增 点 业有 关政 》、 [2016]70 号《关于 机构同业往来 增值 政 充 》、 [2016]127 号《 政 国家 务总局 会关于深港 市场交易互 互 机制 点有关 收政 》、 [2016]140 号《关于明 房地产开发 教 助服务 增值 政 》、 [2017]2 号《关于 产品增值 政 有关 充 》、 [2017]56 号《关于 产品增值 有关 》、 [2017]90 号《关于 入固定 产 抵扣 增值 政 》及其他 关 法 和实务操作，主 列 如下：

(1) 产品 中发 增值 应 为，以 产品 人为增值 人。 产品 产品 中发 增值 应 为，暂 易 方法，按照 3% 征收率 增值 。

对 券投 基 基 买卖 、债券 收入免征增值 ，对国债、地方政府 债以及 同业往来利息收入亦免征增值 。 产品 产品提供 款服务，以 产 利息及利息性 收入为 售 。

(2) 对基 从 券市场中取得 收入，包括买卖 、债券 差价收入， 息、 利 收入，债券 利息收入及其他收入，暂不征收企业所得 。

(3) 对基 取得 企业债券利息收入，应 发 债券 企业在向基 支付利息时代扣代 20% 个人所得 。对基 从上市公司取得 息 利所得，持 期 在 1 个月以内(含 1 个月) ，其 息 利所得全 入应 所得 ；持 期 在 1 个月以上 1 年(含 1 年) ，暂减按 50% 入应 所得 ；持 期 1 年 ，暂免征收个人所得 。对基 持有 上市公司 售 ， 后取得 息、 利收入，按照上 定 ，持 时 日 ； 前 取得 息、 利收入 暂减按 50% 入应 所得 。上 所得 一 20% 率 征个人 所得 。

对基 沪港 或深港 投 港 交所上市 H 取得 息 利，H 公司应向中国 券 有 任公司(以下 “中国 ”)提出 ， 中国 向 H 公司提供内地个人投 名册，H 公司按照 20% 率代扣个人所得 。基 沪港 或深港 投 港 交 所上市 H 取得 息 利， 中国 按照 20% 率代扣个人所得 。

(4) 基 卖出 按 0.1% 率 交易印 ，买入 不征收 交易印 。 基 沪港 或深港 买卖、 承、 与 交所上市 ，按照 港特别 政区现 法 定 印 。

(5) 本基金投资于沪、深、创业板股票、债券和货币市场工具的比例按照基金合同约定的比例执行。

7.4.7 业务报告

7.4.7.1 存款

单位：人民币元

| | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 6,879,383.80 | 2,832,117.63 |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期 1个月以内 | - | - |
| 存款期 1-3个月 | - | - |
| 存款期 3个月以上 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合 计 | 6,879,383.80 | 2,832,117.63 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| | | 本期末 2021年12月31日 | | |
|--------|-------|---------------------|------------------|---------------|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| | | 147,194,152.44 | 152,322,575.27 | 5,128,422.83 |
| 属投 - 交 | 所 合 | - | - | - |
| 债 券 | 交易所市场 | 890,817,703.98 | 899,952,634.20 | 9,134,930.22 |
| | 市场 | 501,325,999.85 | 501,323,000.00 | -2,999.85 |
| | 合 | 1,392,143,703.83 | 1,401,275,634.20 | 9,131,930.37 |
| 产支持 券 | | - | - | - |
| 基 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合 计 | | 1,539,337,856.27 | 1,553,598,209.47 | 14,260,353.20 |
| | | 上年度末 2020年12月31日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| | | 119,266,543.49 | 132,047,392.73 | 12,780,849.24 |
| 属投 - 交 | 所 合 | - | - | - |
| 债 券 | 交易所市场 | 722,043,750.99 | 722,608,078.88 | 564,327.89 |
| | 市场 | 461,108,011.64 | 464,906,000.00 | 3,797,988.36 |
| | 合 | 1,183,151,762.63 | 1,187,514,078.88 | 4,362,316.25 |
| 产支持 券 | | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | - |
| 基 | | - | - | - |

| | | | |
|----|------------------|------------------|---------------|
| 其他 | - | - | - |
| 合 | 1,332,418,306.12 | 1,349,561,471.61 | 17,143,165.49 |

7.4.7.3 产/ 债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有 产/ 债。

7.4.7.4 买入 售 产

7.4.7.4.1 各 买入 售 产期末余

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入 售 产。

7.4.7.4.2 期末买断式 回 交易中取得 债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式 回 交易中取得 债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 2,119.54 | 1,861.27 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收 备付 利息 | 4,407.80 | 2,403.30 |
| 应收债券利息 | 17,122,090.21 | 21,273,777.81 |
| 应收 产支持 券利息 | - | 136,083.29 |
| 应收买入 售 券利息 | - | - |
| 应收 款利息 | 0.14 | - |
| 应收 合 拆借孳息 | - | - |
| 应收出借 券利息 | - | - |
| 其他 | 39.30 | 39.10 |
| 合 | 17,128,656.99 | 21,414,164.77 |

7.4.7.6 其他 产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他 产。

7.4.7.7 应付交易

单位：人民币元

| | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|-----------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易 | 23,710.08 | 20,182.30 |
| 市场应付交易 | 1,660.00 | 2,541.20 |
| 合 | 25,370.08 | 22,723.50 |

7.4.7.8 其他 债

单位：人民币元

| | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保 | - | - |
| 应付 回 | - | - |
| 应付 券出借 | - | - |
| 提 | 220,000.00 | 150,000.00 |
| 合 | 220,000.00 | 150,000.00 |

7.4.7.9 实收基

单位：人民币元

东方 优 一年持有混合 A

| | 本期 | |
|----------------|------------------|------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日 | 2021 年 12 月 31 日 |
| | 基 份 (份) | |
| 上年度末 | 1,004,555,510.85 | 1,004,555,510.85 |
| 本期 | 899,927,818.80 | 899,927,818.80 |
| 本期 回 (以“-”号填列) | -589,293,609.56 | -589,293,609.56 |
| -基 拆分/份 折 前 | - | - |
| 基 拆分/份 折 整 | - | - |
| 本期 | - | - |
| 本期 回 (以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 1,315,189,720.09 | 1,315,189,720.09 |

东方 优 一年持有混合 C

| | 本期 | |
|----------------|----------------------------|------------------|
| | 2021 年 10 月 28 日 (基 合同 效日) | 2021 年 12 月 31 日 |
| | 基 份 (份) | |
| 上年度末 | - | - |
| 本期 | 397,545.17 | 397,545.17 |
| 本期 回 (以“-”号填列) | - | - |
| -基 拆分/份 折 前 | - | - |
| 基 拆分/份 折 整 | - | - |
| 本期 | - | - |
| 本期 回 (以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 397,545.17 | 397,545.17 |

注： 含 利再投、 换入份 ； 回含 换出份 。

7.4.7.10 未分 利润

单位：人民币元

东方 优 一年持有混合 A

| | 已实现 分 | 未实现 分 | 未分 利润合 |
|------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 19,475,711.28 | 17,143,165.49 | 36,618,876.77 |
| 本期利润 | 70,504,664.86 | -2,887,500.17 | 67,617,164.69 |

| | | | |
|-------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期基金份额交易变动数 | 15,136,648.72 | 7,308,212.30 | 22,444,861.02 |
| 其中：基金款 | 26,834,072.46 | 11,883,277.44 | 38,717,349.90 |
| 回款 | -11,697,423.74 | -4,575,065.14 | -16,272,488.88 |
| 本期已分利润 | -94,630,930.53 | - | -94,630,930.53 |
| 本期末 | 10,486,094.33 | 21,563,877.62 | 32,049,971.95 |

东方 优 一年持有混合 C

| | 已实现 分 | 未实现 分 | 未分 利润合 |
|-------------|-----------|----------|----------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | -3,796.49 | 4,687.88 | 891.39 |
| 本期基金份额交易变动数 | 6,761.08 | 1,819.12 | 8,580.20 |
| 其中：基金款 | 6,761.08 | 1,819.12 | 8,580.20 |
| 回款 | - | - | - |
| 本期已分利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,964.59 | 6,507.00 | 9,471.59 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| | 本期 | | 上年度可比期 |
|----------|-----------|-------------|------------------------------------|
| | 2021年1月1日 | 2021年12月31日 | 2020年7月23日（基金合同生效日） 2020年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | | 186,845.71 | 143,035.46 |
| 定期存款利息收入 | | - | - |
| 其他存款利息收入 | | - | - |
| 备付利息收入 | | 98,225.79 | 67,425.76 |
| 其他 | | 1,394.58 | 414.50 |
| 合 | | 286,466.08 | 210,875.72 |

7.4.7.12 投 收

7.4.7.12.1 投 收 构成

单位：人民币元

| | 本期 | | 上年度可比期 |
|--|-----------|-------------|-----------------|
| | 2021年1月1日 | 2021年12月31日 | 2020年7月23日（基金合同 |

| | 日 | 效日) | 2020年12月31日 |
|--------------------|---------------|-----|---------------|
| 投 收 —— 买卖 差价收入 | 38,193,614.29 | | 10,176,152.13 |
| 投 收 —— 回 差价收入 | - | | - |
| 投 收 —— 差价收入 | - | | - |
| 投 收 —— 券 出借差价收入 | - | | - |
| 合 | 38,193,614.29 | | 10,176,152.13 |

| | | |
|---|-------------|------------|
| 合 | -241,491.85 | 613,464.49 |
|---|-------------|------------|

7.4.7.13.2 债券投 收 —— 买卖债券差价收入

单位：人民币元

| | 本期 | | 上年度可比期 |
|----------------------|------------------|-------------|---------------------------------|
| | 2021年1月1日 | 2021年12月31日 | 2020年7月23日（基 合同 效日） 2020年12月31日 |
| 卖出债券（、债 及债券到期兑付）成交总 | 1,297,716,617.90 | | 158,197,115.19 |
| 减：卖出债券（、债及债券到期兑付）成本总 | 1,246,540,370.99 | | 152,997,396.00 |
| 减：应收利息总 | 51,417,738.76 | | 4,586,254.70 |
| 买卖债券差价收入 | -241,491.85 | | 613,464.49 |

7.4.7.13.3 债券投 收 —— 回差价收入

注：本基金 本报告期内及上年度可比期 无债券投 收 - 回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投 收 —— 差价收入

注：本基金 本报告期内及上年度可比期 无债券投 收 - 差价收入。

7.4.7.13.5 产支持 券投 收

单位：人民币元

| | 本期 | | 上年度可比期 |
|---------------|---------------|-------------|---------------------------------|
| | 2021年1月1日 | 2021年12月31日 | 2020年7月23日（基 合同 效日） 2020年12月31日 |
| 卖出 产支持 券成交总 | 30,301,815.00 | | - |
| 减：卖出 产支持 券成本总 | 30,000,000.00 | | - |
| 减：应收利息总 | 301,815.00 | | - |
| 产支持 券投 收 | - | | - |

7.4.7.14 属投 收

7.4.7.14.1 属投 收 构成

注：本基金 本报告期内及上年度可比期 无 属投 收 。

7.4.7.14.2 属投 收 ——买卖 属差价收入

注：本基金 本报告期内及上年度可比期 无 属投 收 -买卖 属差价收入。

7.4.7.14.3 属投 收 —— 回差价收入

注：本基金 本报告期内及上年度可比期 无 属投 收 - 回差价收入。

7.4.7.14.4 属投 收 —— 差价收入

注：本基金 本报告期内及上年度可比期 无 属投 收 - 差价收入。

7.4.7.15 工具收

7.4.7.15.1 工具收 ——买卖权 差价收入

注：本基金 本报告期内及上年度可比期 无 工具收 -买卖权 差价收入。

7.4.7.15.2 工具收 ——其他投 收

注：本基金 本报告期内及上年度可比期 无 工具收 -其他投 收 。

7.4.7.16 利收

单位：人民币元

| | 本期 | | 上年度可比期 |
|--------------|-----------|--------------|---------------------------------|
| | 2021年1月1日 | 2021年12月31日 | 2020年7月23日(基 合同 效日) 2020年12月31日 |
| 投 产 利收 | | 3,257,234.17 | 164,183.40 |
| 其中： 券出借权 偿收入 | | - | - |
| 基 投 产 利收 | | - | - |
| 合 | | 3,257,234.17 | 164,183.40 |

7.4.7.17 公允价值变动收

单位：人民币元

| 名 | 本期 | | 上年度可比期 |
|----------|-----------|---------------|---------------------------------|
| | 2021年1月1日 | 2021年12月31日 | 2020年7月23日(基 合同 效日) 2020年12月31日 |
| 1. 交易性 产 | | -2,882,812.29 | 17,143,165.49 |
| 投 | | -7,652,426.41 | 12,780,849.24 |
| 债券投 | | 4,769,614.12 | 4,362,316.25 |
| 产支持 券投 | | - | - |

| | | |
|-----------------------|---------------|---------------|
| 基 投 | - | - |
| 属投 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 2. 工具 | - | - |
| 权 投 | - | - |
| 3. 其他 | - | - |
| 减：应 商品公允价值 变动产 估增值 | - | - |
| 合 | -2,882,812.29 | 17,143,165.49 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| | 本期 | | 上年度可比期 |
|--------|------------------|-----------------|---|
| | 2021年1月1日 31日 | 2021年12月 31日 | 2020年7月23日（基 合 同 效日） 2020年12月31 日 |
| 基 回 收入 | | 268.01 | - |
| 合 | | 268.01 | - |

7.4.7.19 交易

单位：人民币元

| | 本期 | | 上年度可比期 |
|---------|------------------|-----------------|---|
| | 2021年1月1日 31日 | 2021年12月 31日 | 2020年7月23日（基 合 同 效日） 2020年12月31 日 |
| 交易所市场交易 | | 457,162.26 | 251,382.53 |
| 市场交易 | | 5,870.00 | 4,325.00 |
| 合 | | 463,032.26 | 255,707.53 |

7.4.7.20 其他

单位：人民币元



本基金注册人中国证券有限公司在册全体持有人,按每10份A基金份额派发利0.048元,每10份C基金份额派发利0.045元。

7.4.9 关联方

| 关联方名 | 与本基金关 |
|----------------------|-------------------|
| 上海东方证券资产管理有限公司(“东方”) | 基金管理人、基金销售机构、注册机构 |
| 中国光大股份有限公司(“光大”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 东方证券股份有限公司(“东方证券”) | 基金管理人股东、基金销售机构 |
| 上海东期有限公司(“东期”) | 受东方证券控制公司、基金销售机构 |
| 东方证券承保有限公司(“东方投”) | 受东方证券控制公司 |

注:下关交易均在正常业务范围内按一商业条款。

7.4.10 本报告期及上年度可比期关联方交易

7.4.10.1 关联方交易单元交易

7.4.10.1.1 交易

单位:人民币元

| 关联方名 | 本期 2021年1月1日 2021年12月31日 | | 上年度可比期 2020年7月23日(基合同效日) 2020年12月31日 | |
|------|-----------------------------|---------------------|--|---------------------|
| | 成交 | 占当期 成交总比例 (%) | 成交 | 占当期 成交总比例 (%) |
| 东方证券 | 270,230,537.26 | 100.00 | 210,036,762.55 | 100.00 |

7.4.10.1.2 债券交易

单位:人民币元

| 关联方名 | 本期 2021年1月1日 2021年12月31日 | | 上年度可比期 2020年7月23日(基合同效日) 2020年12月31日 | |
|------|-----------------------------|-----------------------|--|-----------------------|
| | 成交 | 占当期债券 成交总比例 (%) | 成交 | 占当期债券 成交总比例 (%) |
| 东方证券 | 1,007,171,171.02 | 100.00 | 731,680,197.66 | 100.00 |

7.4.10.1.3 债券回交易

单位:人民币元

| 关 方名 | 本期 2021年1月1日 2021年12月31日 | | 上年度可比期 2020年7月23日(基 合同 效日) 2020年12月31日 | |
|------|-----------------------------|-------------------------|--|-------------------------|
| | 成交 | 占当期债券回 成交总 比例 (%) | 成交 | 占当期债券回 成交总 比例 (%) |
| 东方 券 | 14,798,971,000.00 | 100.00 | 10,508,700,000.00 | 100.00 |

7.4.10.1.4 权 交易

注：本基 本报告期内及上年度可比期 未 关 方交易单元 权 交易。

7.4.10.1.5 应支付关 方 佣

单位：人民币元

| 关 方名 | 本期 2021年1月1日 2021年12月31日 | | | |
|------|---|------------------|-----------|--------------------|
| | 当期 佣 | 占当期佣 总 比例 (%) | 期末应付佣 余 | 占期末应付佣 总 比例 (%) |
| 东方 券 | 192,566.94 | 100.00 | 23,710.08 | 100.00 |
| 关 方名 | 上年度可比期 2020年7月23日(基 合同 效日) 2020年12月31日 | | | |
| | 当期 佣 | 占当期佣 总 比例 (%) | 期末应付佣 余 | 占期末应付佣 总 比例 (%) |
| 东方 券 | 148,069.94 | 100.00 | 19,982.30 | 100.00 |

注：1. 上 佣 按照市场佣 率 ，以扣 中国 券 有 任公司收取
和 手 净 列 。

2. 佣 协 服务 围 包括佣 收取方为本基 提供 券投 成果和市场信
息服务 。

7.4.10.2 关 方报

7.4.10.2.1 基

单位：人民币元

| | 本期 2021年1月1日 2021年12月31日 | | 上年度可比期 2020年7月23日(基 合同 效日) 2020年12月31日 | |
|----------------|---|--------------|---|--------------|
| | 当期发 基 应支付  | 8,222,138.35 | | 3,127,894.77 |
| 其中：支付 售机构 客户 护 | 3,258,431.92 | | 1,242,425.84 | |

注：1. 本基金按前一日基金资产净值 0.7% 年率计提。

方法如下：

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

H 为每日应提基金

E 为前一日基金资产净值

基金每日，日每月月末，按月支付，基金管理人向基金托管人发送基金划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金资产中一次性支付基金管理人。法定假日、公休日或不可抗力，支付日期顺延。

2. 实支付售机构客户均以本基金管理人和售机构对账为准。

7.4.10.2.2 基 托

单位：人民币元

| | 本期 2021 年 1 月 1 日 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期 2020 年 7 月 23 日（基 合 同 效日） 2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|--|--|
| 当期发 基 应支付 托 | 2,349,182.40 | 893,684.18 |

注：本基金按前一日基金资产净值 0.2% 年率计提。托 方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应提基 托

E 为前一日基 产净值

基 托 每日，日 每月月末，按月支付，基 管理人向基 托 人发 基 托 划款指令，基 托 人复核后于次月前 3 个工作日内从基 产中一次性支取。法 定 假日、公休日或不可抗力，支付日期 延。

7.4.10.2.3 售服务

单位：人民币元

| 得 售服务 各关 方名 | 本期 2021 年 1 月 1 日 2021 年 12 月 31 日 | | |
|----------------|---------------------------------------|-------------------|---|
| | 当期发 基 应支付 售服务 | | |
| | 东方 优 一年持 有混合 A | 东方 优 一年持 有混合 C | 合 |
| | | | |

| | | | |
|----------------|--|-------------------|---|
| 东 | - | 4.19 | - |
| 合 | - | 4.19 | - |
| 得 售服务 各关 方名 | 上年度可比期 | | |
| | 2020 年 7 月 23 日 (基 合同 效日) 2020 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发 基 应支付 售服务 | | |
| | 东方 优 一年持 有混合 A | 东方 优 一年持 有混合 C | 合 |
| 合 | - | - | - |

注：(1) 根据《关于东方 优 一年持有期混合型 券投 基 增加 C 基 份 及修改基 合同和托 协 公告》，本基 2021 年 10 月 28 日(含) 增加 C 基 份 。

(2) 本基 C 份 售服务 率按前一日 C 基 产净值 0.30% 年 率 提。C 基 份 售服务 提 公式如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 基 份 应 提 基 售服务

E 为前一日 C 基 份 基 产净值

基 售服务 每日 提， 日 每月月末，按月支付。 法定 假日、公休日 ， 支付日期 延。

7.4.10.3 与关 方 同业市场 债券(含回)交易

注：本基 本报告期内及上年度可比期 未与关 方 同业市场 债券(含回)交易。

7.4.10.4 报告期内 券出借业务发 大关 交易事 明

7.4.10.4.1 与关 方 定 报方式 固定期 率 券出借业务 情况

注：本基 本报告期内及上年度可比期 未有与关 方 定 报方式 固定期 率 券出借业务 情况。

7.4.10.4.2 与关 方 定 报方式 市场化期 率 券出借业务 情况

注：本基 本报告期内及上年度可比期 及未与关 方 定 报方式 市场化期 率 券出借业务 情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人固有投资本基金情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期基金管理人未固有投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末基金管理人之外其他关联方投资本基金情况

注：本基金本报告期末及上年度末基金管理人之外其他关联方未持有本基金。

7.4.10.6 关联方保存款余及当期产生利息收入

单位：人民币元

| 关联方名 | 本期 | | 上年度可比期 | |
|------|--------------|-------------|---------------------|-------------|
| | 2021年1月1日 | 2021年12月31日 | 2020年7月23日(基金合同生效日) | 2020年12月31日 |
| | 期末余 | 当期利息收入 | 期末余 | 当期利息收入 |
| 光大 | 6,879,383.80 | 186,845.71 | 2,832,117.63 | 143,035.46 |

注：本基金存款基金托管人光大保，按同业利率息。

7.4.10.7 本基金在承期内参与关联方承券情况

单位：人民币元

| 本期 | | | | | |
|---------------------------------|--------|----|-----|----------|------------|
| 2021年1月1日 2021年12月31日 | | | | | |
| 关联方名 | 券代 | 券名 | 发方式 | 基金在承期内买入 | |
| | | | | 数(单位:张) | 总 |
| 东方投 | 002142 | 宁波 | | 13,520 | 269,994.40 |
| 上年度可比期 | | | | | |
| 2020年7月23日(基金合同生效日) 2020年12月31日 | | | | | |
| 关联方名 | 券代 | 券名 | 发方式 | 基金在承期内买入 | |
| | | | | 数(单位:张) | 总 |
| | - | - | - | - | - |

7.4.10.8 其他关联交易事项

本基金于期交易分别存放于东期户和保户中，备付按同业利率息，存出保不。息。于2021年12月31日，本基金存放于东期备付余为1001.92元，无存出保余(2020年12月31日：无)。于2021年度，本基金当期备付利息收入1.12元(2020年度：无)。

7.4.11 利润分情况

| 东方 优 一年持有混合 A | | | | | | | |
|---------------|---|----|-------|-----|------|------|----|
| 序号 | 权 | 息日 | 每10份基 | 现形式 | 再投形式 | 本期利润 | 备注 |
| | | | | | | | |

| | 日 | 场内 | 场外 | 份 分 数 | 发放总 | 发放总 | 分 合 | |
|---|-------------|----|-------------|----------|---------------|------------|---------------|---|
| 1 | 2021年1月8日 | - | 2021年1月8日 | 0.1400 | 14,063,777.97 | - | 14,063,777.97 | - |
| 2 | 2021年4月15日 | - | 2021年4月15日 | 0.2400 | 24,109,332.60 | - | 24,109,332.60 | - |
| 3 | 2021年7月15日 | - | 2021年7月15日 | 0.2100 | 30,805,606.81 | - | 30,805,606.81 | - |
| 4 | 2021年10月19日 | - | 2021年10月19日 | 0.2000 | 25,096,057.65 | 556,155.50 | 25,652,213.15 | - |
| 合 | - | - | - | 0.7900 | 94,074,775.03 | 556,155.50 | 94,630,930.53 | - |

注：本基金于产债日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告或实施利润分配情况
参与产债日后事。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有流受券

7.4.12.1 因新发/增发券于期末持有流受券

单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受券别： | | | | | | | | | | |
|-----------------|------|-------------|------------|------|-------|--------|------------|----------|-----------|----|
| 券代 | 券名 | 成功日 | 可流日 | 流受型 | 价格 | 期末估值单价 | 数 (单位：) | 期末成本总 | 期末估值总 | 备注 |
| 001234 | 泰慕士 | 2021年12月31日 | 2022年1月11日 | 新未上市 | 16.53 | 16.53 | 333 | 5,504.49 | 5,504.49 | - |
| 300814 | 中富 | 2021年8月4日 | 2022年2月14日 | 新定 | 8.40 | 23.88 | 328 | 2,755.20 | 7,832.64 | - |
| 300854 | 中兰环保 | 2021年9月8日 | 2022年3月16日 | 新定 | 9.96 | 27.29 | 203 | 2,021.88 | 5,539.87 | - |
| 300994 | 久份 | 2021年8月2日 | 2022年2月14日 | 新定 | 11.90 | 45.45 | 420 | 4,998.00 | 19,089.00 | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年6月23日 | 2022年1月5日 | 新定 | 8.86 | 23.80 | 555 | 4,917.30 | 13,209.00 | - |
| 301020 | 密封技 | 2021年6月28日 | 2022年1月6日 | 新定 | 10.64 | 30.44 | 421 | 4,479.44 | 12,815.24 | - |
| 301021 | 激光 | 2021年6月 | 2022年1月 | 新定 | 9.46 | 41.43 | 290 | 2,743.40 | 12,014.70 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|-----------------|----|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 28 日 | 6 日 | | | | | | | |
| 301025 | 客文化 | 2021 年 7 月 6 日 | 2022 年 1 月 24 日 | 新定 | 1.55 | 20.88 | 403 | 624.65 | 8,414.64 | - |
| 301026 | 浩技 | 2021 年 7 月 8 日 | 2022 年 1 月 17 日 | 新定 | 18.03 | 62.73 | 203 | 3,660.09 | 12,734.19 | - |
| 301027 | 华团 | 2021 年 7 月 8 日 | 2022 年 1 月 19 日 | 新定 | 11.45 | 16.65 | 286 | 3,274.70 | 4,761.90 | - |
| 301028 | 东亚机械 | 2021 年 7 月 12 日 | 2022 年 1 月 20 日 | 新定 | 5.31 | 13.50 | 733 | 3,892.23 | 9,895.50 | - |
| 301029 | 怡合 | 2021 年 7 月 14 日 | 2022 年 1 月 24 日 | 新定 | 14.14 | 89.87 | 462 | 6,532.68 | 41,519.94 | - |
| 301032 | 新柴份 | 2021 年 7 月 15 日 | 2022 年 1 月 24 日 | 新定 | 4.97 | 12.51 | 513 | 2,549.61 | 6,417.63 | - |
| 301033 | 普医学 | 2021 年 7 月 15 日 | 2022 年 1 月 26 日 | 新定 | 15.14 | 59.97 | 108 | 1,635.12 | 6,476.76 | - |
| 301035 | 润丰份 | 2021 年 7 月 21 日 | 2022 年 1 月 28 日 | 新定 | 22.04 | 56.28 | 644 | 14,193.76 | 36,244.32 | - |
| 301036 | 双乐份 | 2021 年 7 月 21 日 | 2022 年 2 月 16 日 | 新定 | 23.38 | 29.93 | 205 | 4,792.90 | 6,135.65 | - |
| 301037 | 保佳 | 2021 年 7 月 21 日 | 2022 年 2 月 7 日 | 新定 | 14.82 | 24.26 | 193 | 2,860.26 | 4,682.18 | - |
| 301039 | 中 | 2021 年 7 月 1 日 | 2022 年 1 月 10 日 | 新定 | 6.96 | 12.51 | 2,064 | 14,365.44 | 25,820.64 | - |
| 301040 | 中环海 | 2021 年 7 月 26 日 | 2022 年 2 月 7 日 | 新定 | 13.57 | 38.51 | 241 | 3,270.37 | 9,280.91 | - |
| 301046 | 技 | 2021 年 8 月 10 日 | 2022 年 2 月 17 日 | 新定 | 8.34 | 48.99 | 290 | 2,418.60 | 14,207.10 | - |
| 301048 | 工 | 2021 年 8 月 11 日 | 2022 年 2 月 28 日 | 新定 | 4.13 | 12.96 | 843 | 3,481.59 | 10,925.28 | - |
| 301049 | | 2021 | 2022 | 新 | 19.34 | 32.92 | 196 | 3,790.64 | 6,452.32 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|---------|---------------------------|-----------------------|--------|-------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| | 技 | 年 8 月 17 日 | 年 2 月 24 日 | 定 | | | | | | |
| 301050 | 微力 | 2021 年 8 月 17 日 | 2022 年 2 月 24 日 | 新 定 | 60.64 | 234.74 | 233 | 14,129.12 | 54,694.42 | - |
| 301053 | 信 工业 | 2021 年 8 月 25 日 | 2022 年 3 月 1 日 | 新 定 | 11.87 | 28.78 | 155 | 1,839.85 | 4,460.90 | - |
| 301055 | 张小 泉 | 2021 年 8 月 26 日 | 2022 年 3 月 7 日 | 新 定 | 6.90 | 21.78 | 355 | 2,449.50 | 7,731.90 | - |
| 301056 | 森 份 | 2021 年 8 月 27 日 | 2022 年 3 月 7 日 | 新 定 | 3.93 | 11.09 | 572 | 2,247.96 | 6,343.48 | - |
| 301057 | 汇 新材 | 2021 年 8 月 31 日 | 2022 年 3 月 9 日 | 新 定 | 8.03 | 19.02 | 218 | 1,750.54 | 4,146.36 | - |
| 301063 | 海 份 | 2021 年 9 月 9 日 | 2022 年 3 月 24 日 | 新 定 | 17.40 | 36.11 | 153 | 2,662.20 | 5,524.83 | - |
| 301066 | 万事 利 | 2021 年 9 月 13 日 | 2022 年 3 月 22 日 | 新 定 | 5.24 | 22.84 | 344 | 1,802.56 | 7,856.96 | - |
| 301072 | 中捷 工 | 2021 年 9 月 22 日 | 2022 年 3 月 29 日 | 新 定 | 7.46 | 33.41 | 181 | 1,350.26 | 6,047.21 | - |
| 301073 | 君亭 店 | 2021 年 9 月 22 日 | 2022 年 3 月 30 日 | 新 定 | 12.24 | 32.00 | 144 | 1,762.56 | 4,608.00 | - |
| 301078 | 孩子 王 | 2021 年 9 月 30 日 | 2022 年 4 月 14 日 | 新 定 | 5.77 | 12.14 | 756 | 4,362.12 | 9,177.84 | - |
| 301079 | 液压 | 2021 年 10 月 11 日 | 2022 年 4 月 19 日 | 新 定 | 11.92 | 24.82 | 140 | 1,668.80 | 3,474.80 | - |
| 301082 | 久 气 | 2021 年 10 月 14 日 | 2022 年 4 月 27 日 | 新 定 | 15.48 | 21.53 | 915 | 14,164.20 | 19,699.95 | - |
| 301096 | 医 | 2021 年 12 月 13 日 | 2022 年 6 月 20 日 | 新 定 | 79.60 | 78.53 | 272 | 21,651.20 | 21,360.16 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|-----|-------------|------------|----|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 301100 | 光份 | 2021年12月10日 | 2022年6月17日 | 新定 | 27.81 | 31.14 | 599 | 16,658.19 | 18,652.86 | - |
| 301108 | 洁份 | 2021年11月25日 | 2022年6月6日 | 新定 | 57.27 | 53.71 | 280 | 16,035.60 | 15,038.80 | - |
| 301111 | 万年 | 2021年11月30日 | 2022年6月7日 | 新定 | 10.48 | 36.68 | 379 | 3,971.92 | 13,901.72 | - |
| 301126 | 嘉康 | 2021年11月30日 | 2022年6月7日 | 新定 | 12.37 | 19.23 | 662 | 8,188.94 | 12,730.26 | - |
| 301133 | 份 | 2021年11月19日 | 2022年5月26日 | 新定 | 14.33 | 26.95 | 286 | 4,098.38 | 7,707.70 | - |
| 301136 | 招标份 | 2021年12月31日 | 2022年7月11日 | 新定 | 10.52 | 10.52 | 7,172 | 75,449.44 | 75,449.44 | - |
| 301138 | 华机 | 2021年12月8日 | 2022年6月15日 | 新定 | 26.17 | 44.86 | 285 | 7,458.45 | 12,785.10 | - |
| 301166 | 优宁 | 2021年12月21日 | 2022年6月28日 | 新定 | 86.06 | 94.50 | 253 | 21,773.18 | 23,908.50 | - |
| 301168 | 灵份 | 2021年12月2日 | 2022年6月10日 | 新定 | 39.08 | 52.13 | 329 | 12,857.32 | 17,150.77 | - |
| 301177 | 份 | 2021年12月8日 | 2022年6月15日 | 新定 | 116.88 | 116.08 | 792 | 92,568.96 | 91,935.36 | - |
| 301179 | 泽宇智 | 2021年12月1日 | 2022年6月8日 | 新定 | 43.99 | 50.77 | 295 | 12,977.05 | 14,977.15 | - |
| 301182 | 凯旺技 | 2021年12月16日 | 2022年6月23日 | 新定 | 27.12 | 30.58 | 294 | 7,973.28 | 8,990.52 | - |

| 301189 | 奥尼子 | 2021年12月21日 | 2022年6月28日 | 新定 | 66.18 | 56.62 | 435 | 28,788.30 | 24,629.70 | - |
|---------------------|-----|-------------|------------|------|--------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 301190 | 善水技 | 2021年12月17日 | 2022年6月24日 | 新定 | 27.85 | 27.46 | 575 | 16,013.75 | 15,789.50 | - |
| 301193 | 家技 | 2021年12月2日 | 2022年6月9日 | 新定 | 30.73 | 29.14 | 297 | 9,126.81 | 8,654.58 | - |
| 301198 | 喜悦智 | 2021年11月25日 | 2022年6月2日 | 新定 | 21.76 | 29.20 | 262 | 5,701.12 | 7,650.40 | - |
| 601728 | 中国信 | 2021年8月11日 | 2022年2月21日 | 新定 | 4.53 | 4.27 | 394,011 | 1,784,869.83 | 1,682,426.97 | - |
| 688091 | 上海众 | 2021年9月1日 | 2022年3月9日 | 新定 | 38.10 | 42.81 | 3,294 | 125,501.40 | 141,016.14 | - |
| 688176 | 亚医 | 2021年12月29日 | 2022年7月7日 | 新定 | 22.98 | 22.98 | 37,990 | 873,010.20 | 873,010.20 | - |
| 688262 | 国技 | 2021年12月28日 | 2022年1月6日 | 新未上市 | 41.98 | 41.98 | 7,129 | 299,275.42 | 299,275.42 | - |
| 688499 | 利元亨 | 2021年6月23日 | 2022年1月4日 | 新定 | 38.85 | 293.00 | 2,149 | 83,488.65 | 629,657.00 | - |
| 688501 | 环保 | 2021年7月9日 | 2022年1月17日 | 新定 | 10.57 | 21.11 | 1,759 | 18,592.63 | 37,132.49 | - |
| 688737 | 中技 | 2021年10月14日 | 2022年4月22日 | 新定 | 70.90 | 55.06 | 2,186 | 154,987.40 | 120,361.16 | - |
| 7.4.12.1.2 受 券 别：债券 | | | | | | | | | | |
| 券代 | 券名 | 成功日 | 可流日 | 流受型 | 价格 | 期末估值单价 | 数(单位：张) | 期末成本总 | 期末估值总 | 备注 |
| 113052 | 兴业 | 2021 | 2022 | 新债未 | 100.00 | 100.00 | 12,620 | 1,262,000.00 | 1,262,000.00 | - |

| | | | | | | | | | |
|--|---|-------------|------------|----|--|--|--|--|--|
| | 债 | 年 12 月 29 日 | 年 1 月 14 日 | 上市 | | | | | |
|--|---|-------------|------------|----|--|--|--|--|--|

注：1、根据《上海证券交易所科创板公开发行自律委员会促进科创板初期企业平发展业倡导建》，本基金科创板如抽方式定，定期为发行人上市之日 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司东以向特定机构投价和售方式减持份实施则》，基价受份，在受后 6 个月内不得。

2、根据《深圳证券交易所创业板次公开发券发与承业务实施则》，发人和主承商可以摇号售方式或比例售方式，安排基下发分创业板不低于 6 个月售期。

3、基可使以基名义开，择上或下一方式新。其中基参与下得新或作为战投参与售得新，在新上市后定期内不；基参与上新，从新日新上市日之不。

7.4.12.2 期末持有 暂时停牌 流 受

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌流受。

7.4.12.3 期末债券正回 交易中作为抵押 债券

7.4.12.3.1 市场债券正回

本基金本报告期末无从事债券正回交易形成卖出回券款余。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事交易所市场债券正回交易形成卖出回券款余 239,349,000.00 元，截至 2022 年 2 月 16 日先后到期。交易求本基金入押库债券，按交易所定比例折为标准券后，不低于债券回交易余。

7.4.12.4 期末参与 券出借业务 券

注：本基金本报告期末无参与券出借业务券。

7.4.13 工具 及

7.4.13.1 政 和 架构

本基金工具主包括：信、流动性、市场。本基金人制定了应政和序来别及分析些，并定当及内控制流，可

及信息 持 控上 各 。本基 人奉 全 体 建 ，在 事会下 合 与 委员会， 对合 和 总体 标、基本政 审 并提出 意 ；对合 和 机构 及其 审 并提出意 ；对 事会审 大 决 和 大 决方案 估并提出意 ；对 事会审 合 报告和 估 报告 审 并提出意 。在 层层 控制委员会， 指导、协 和 各 和各业务单元开展 工作；根据 事会制定 原则制 关 控制政 ， 使公司整体业务发展战 与 承受 力保持 当； 促各 在日常工作中 别各 业务 所涉及 各 大 ， 对 大事件、 大决 和 业务流 估，就 关 决方案 审； 促各 别和 估新产品、新业务 ，就 关控制措施 审； 促各 点关注内控机制 弱环 和可 公司带来 大损失 事件，审 并决定 应 控制措施和 决方案；根据公司 总体 和各 与业务单元 分工，指导实 施 应对方案；审 公司投 授权有关 控制方案 。

7.4.13.2 信

信 是指基 在交易 中因交易对手未履 合 任，或 基 所投 券之发 人 出现 、拒 支付到期本息 情况，导 基 产损失和收 变化 。

本基 基 人在交易前对交易对手 信状况 了充分 估。本基 存款 存放在本基 托 人中国光大 ，因 与 存款 关 信 不 大。本基 在交易所 交易均以中国 券 有 任公司为交易对手完成 券交收和款 清 ， 可 性很小；在 同业市场 交易前均对交易对手 信 估并对 券交割方式 制以控制 应 信 。

本基 基 人建 了信 流 ， 对投 品 信 估来控制 券发 人 信 ，且 分散化投 以分散信 。

本基 债券投 信 情况按《中国人民 信 指导意 》定 标准 及汇总。

7.4.13.2.1 按 期信 列 债券投

单位：人民币元

| 期信 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | 59,977,000.00 | 89,805,000.00 |
| A-1 以下 | - | - |

| | | |
|---|----------------|----------------|
| 未 | 331,016,000.00 | 190,340,000.00 |
| 合 | 390,993,000.00 | 280,145,000.00 |

注：1、债券 取 三方 机构 债 。

2、未 分为期 在一年以内 期 券。

7.4.13.2.2 按 期信 列 产支持 券投

单位：人民币元

| 期信 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | 30,000,000.00 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未 | - | - |
| 合 | - | 30,000,000.00 |

注：债券 取 三方 机构 债 。

7.4.13.2.3 按 期信 列 同业存单投

单位：人民币元

| 期信 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未 | - | 116,719,000.00 |
| 合 | - | 116,719,000.00 |

7.4.13.2.4 按 期信 列 债券投

单位：人民币元

| 期信 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | 792,212,834.20 | 508,344,250.12 |
| AAA 以下 | 127,720,800.00 | 252,251,828.76 |
| 未 | 90,349,000.00 | 30,054,000.00 |
| 合 | 1,010,282,634.20 | 790,650,078.88 |

注：债券 取 三方 机构 债 。

7.4.13.2.5 按 期信 列 产支持 券投

单位：人民币元

| 期信 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----|-------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |

| | | |
|--------|---|----------------|
| AAA 以下 | - | - |
| 未 | - | 116,719,000.00 |
| 合 | - | 116,719,000.00 |

7.4.13.2.6 按 期信 列 同业存单投

注：本基金本报告期末及上年度末无按期信 列 同业存单投 。

7.4.13.3 流动性

流动性 是指基 在履 与 债有关 义务时 到 。本基金 流动性 一方 来 于基 份 持有人可于 定开放日 求 回其持有 基 份 ，另一方 来 于 投 品 所处 交易市场不活 带来 变现困 或因投 中 无法在市场出现剧烈波动 情 况下以合 价格变现。

对兑付 回 流动性 ，本基金 基 人每日对本基 回情况 严 密 控并 测流动性 求，保持基 投 合中 可 现 头寸与之 匹 。本基金 基 人在基 合同中 了巨 回条款， 定在 常情况下 回 处 方式，控制因开放 回模式带来 流动性 ，有效保 基 持有人利 。

2021 年 12 月 31 日， 卖出回 产款余 中有 239,349,000.00 元将在两个月以内到期且 息(利息 不 大)外，本基金 所承担 其他 债 合 定到期日均为一个月以 内且不 息，可 回基 份 净值(所有 权)无固定到期日且不 息，因此 余 为未折 现 合 到期现 流 。

7.4.13.3.1 报告期内本基金 合 产 流动性 分析

本基金 基 人在基 作 中严格按照《公开募 券投 基 作 办法》及 《公开募 开放式 券投 基 流动性 定》 法 求对本基 合 产 流动性 对本基 合持仓 中度指标、流 受 制 投 品 比例以及 合在 时 内变现 力 合指标 流动性指标 持 测和分析。

本基金 投 于一家公司发 券市值不 基 产净值 10%，且本基金 与 本基 基 其他基 共同持有一家发 券不得 券 10%。本基金 与 本基 基 其他开放式基 共同持有一家上市公司发 可流 不得 上 市公司可流 15%，本基金 与 本基 基 全 投 合持有一家上市公 司发 可流 ，不得 上市公司可流 30%(完全按照有关指数构成比例 券投 开放式基 及中国 会 定 特殊投 合不受上 比例 制)。

本基金所持分券在券交易所上市，其余亦可在同业市场交易，分基产流暂时受制不情况参注 7.4.12。此外，本基金可卖出回产方式借入期应对流动性求，其上不一基持有债券投公允价值。本基金主动投于流动性受产市值合不得基产净值 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金投于流动性受产市值合未基产净值 15%。

本基金基人每日对基合产中 7 个工作日可变现产可变现价值审慎估与测，保每日净回不得 7 个工作日可变现产可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金合产中 7 个工作日可变现产价值当日净回。

同时，本基金基人分散回交易到期日与交易对手中度；按照原则对交易对手务状况、偿付力及杠杆水平必尽查与严格准入以及对不同交易对手实施交易度并动态整措施严格本基金从事回交易流动性及交易对手。此外，本基金基人建了回交易押品制度：根据押品定押率水平；持测押品状况与价值变动以保押品按公允价值；并在与募券产品及中国会定其他主体为交易对手开展回交易时，可接受押品求与基合同定投围保持一。

7.4.13.4 市场

市场是指基所持工具公允价值或未来现金流因所处市场各价格因变动发波动，包括利率、外汇和其他价格。

7.4.13.4.1 利率

利率是指工具公允价值或未来现金流受市场利率变动发波动。利率敏感性工具均临于市场利率上升导公允价值下，其中浮动利率工具临每个付息期末根据市场利率新定价时对于未来现金流影响。

本基金基人定期对本基临利率敏感性口控，并整投合久期方法对上利率。

本基金投于交易所及市场交易固定收品比大，此外持有存款、备付和存出保利率敏感性产，因此存在应利率。

7.4.13.4.1.1 利率 敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不 息 | 合 |
|-----------------------------|-----------------|---------------|----------------|----------------|--------------|----------------|------------------|
| 产 | | | | | | | |
| 存款 | 6,879,383.80 | - | - | - | - | - | 6,879,383.80 |
| 备付 | 9,795,613.02 | - | - | - | - | - | 9,795,613.02 |
| 存出保 | 87,331.36 | - | - | - | - | - | 87,331.36 |
| 交易性 产 | 30,004,000.00 | 86,567,000.00 | 625,037,134.20 | 658,405,500.00 | 1,262,000.00 | 152,322,575.27 | 1,553,598,209.47 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 17,128,656.99 | 17,128,656.99 |
| 应收 券清 款 | - | - | - | - | - | 75,930,909.31 | 75,930,909.31 |
| 产总 | 46,766,328.18 | 86,567,000.00 | 625,037,134.20 | 658,405,500.00 | 1,262,000.00 | 245,382,141.57 | 1,663,420,103.95 |
| 债 | | | | | | | |
| 应付 人报 | - | - | - | - | - | 803,943.45 | 803,943.45 |
| 应付托 | - | - | - | - | - | 229,698.14 | 229,698.14 |
| 应付 券清 款 | - | - | - | - | - | 75,094,898.06 | 75,094,898.06 |
| 卖出回 产款 | 230,000,000.00 | 9,349,000.00 | - | - | - | - | 239,349,000.00 |
| 应付 售服务 | - | - | - | - | - | 110.53 | 110.53 |
| 应付交易 | - | - | - | - | - | 25,370.08 | 25,370.08 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | -61,299.45 | -61,299.45 |
| 应交 | - | - | - | - | - | 111,674.34 | 111,674.34 |
| 其他 债 | - | - | - | - | - | 220,000.00 | 220,000.00 |
| 债总 | 230,000,000.00 | 9,349,000.00 | - | - | - | 76,424,395.15 | 315,773,395.15 |
| 利率敏感度 口 | -183,233,671.82 | 77,218,000.00 | 625,037,134.20 | 658,405,500.00 | 1,262,000.00 | 168,957,746.42 | 1,347,646,708.80 |
| 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不 息 | 合 |

| | | | | | | | |
|---------|-----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 产 | | | | | | | |
| 存款 | 2,832,117.63 | - | - | - | - | - | 2,832,117.63 |
| 备付 | 5,340,785.98 | - | - | - | - | - | 5,340,785.98 |
| 存出保 | 86,917.81 | - | - | - | - | - | 86,917.81 |
| 交易性产 | 51,852,565.00 | 156,063,100.00 | 560,268,400.00 | 430,998,114.60 | 18,331,899.28 | 132,047,392.73 | 1,349,561,471.61 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 21,414,164.77 | 21,414,164.77 |
| 应收 券清款 | - | - | - | - | - | 1,359,431.01 | 1,359,431.01 |
| 产总 | 60,112,386.42 | 156,063,100.00 | 560,268,400.00 | 430,998,114.60 | 18,331,899.28 | 154,820,988.51 | 1,380,594,888.81 |
| 债 | | | | | | | |
| 应付 人报 | - | - | - | - | - | 612,190.37 | 612,190.37 |
| 应付托 | - | - | - | - | - | 174,911.54 | 174,911.54 |
| 卖出回 产款 | 337,967,827.55 | - | - | - | - | - | 337,967,827.55 |
| 应付交易 | - | - | - | - | - | 22,723.50 | 22,723.50 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 394,501.90 | 394,501.90 |
| 应交 | - | - | - | - | - | 98,346.33 | 98,346.33 |
| 其他 债 | - | - | - | - | - | 150,000.00 | 150,000.00 |
| 债总 | 337,967,827.55 | - | - | - | - | 1,452,673.64 | 339,420,501.19 |
| 利率敏感度 口 | -277,855,441.13 | 156,063,100.00 | 560,268,400.00 | 430,998,114.60 | 18,331,899.28 | 153,368,314.87 | 1,041,174,387.62 |

注： 中所 为本基 产及 债 价值，并按照合 定 利率 新定价日或到期日孰早 予以分 。

7.4.13.4.1.2 利率 敏感性分析

| 假 | 市场利率以外 其他市场变 保持不变 | 对 产 债 日基 产净值 影响 (单位：人民币元) | |
|----|-------------------|---------------------------|--------------------|
| | 关 变 变 动 | 本期末 (2021年12月31日) | 上年度末 (2020年12月31日) |
| 分析 | 1. 市场利率下 25 | 5,261,726.10 | 4,290,982.27 |

| | | | |
|--|------------------|------------------|------------------|
| | 个基点 | | |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -5, 218, 679. 94 | -4, 255, 535. 06 |

7.4.13.4.2 外汇

外汇是指工具公允价值或未来现金流因外汇汇率变动发生波动。本基金持有不以本位币计价的资产，因此存在应对外汇。

7.4.13.4.2.1 外汇敞口

单位：人民币元

| | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | | | |
|-------------|--------------------------|-----------------|---------------|-----------------|
| | 元 折合人民币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币 折合人民币元 | 合 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性资产 | - | 5, 799, 163. 49 | - | 5, 799, 163. 49 |
| 资产合 | - | 5, 799, 163. 49 | - | 5, 799, 163. 49 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合 | - | - | - | - |
| 资产 负债 外汇敞口净 | - | 5, 799, 163. 49 | - | 5, 799, 163. 49 |
| | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | | | |
| | 元 折合人民币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币 折合人民币元 | 合 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 资产合 | - | - | - | - |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合 | - | - | - | - |
| 资产 负债 外汇敞口净 | - | - | - | - |

7.4.13.4.2.2 外汇 敏感性分析

| 假 | 汇率外其他市场变 保持不变 | | |
|----|--------------------|-------------------------------|-------------------------|
| | 关 变 变 动 | 对 产 债 日基 产净值 影响 (单位: 人民币元) | |
| | | 本期末 (2021 年 12 月 31 日) | 上年度末 (2020 年 12 月 31 日) |
| 分析 | 1、港币 对人民币 升值 5% | 289,958.17 | - |
| | 2、港币 对人民币 值 5% | -289,958.17 | - |

7.4.13.4.3 其他价格

本基 承受 其他价格 , 主 是基 所持 工具 公允价值或未来现 流 因 市场利率和外汇汇率以外 市场价格因 变动 发 波动 。本基 其他价格 , 主 受到 券交易所上市或 同业市场交易 券涨 势 影响, 所持有 工具 公允价值 决定。本基 投 合 分散化 低其他价格 , 并且本基 人每日对本基 所持有 券价格实施 控, 合估值、 业 分析 其他价格

7.4.13.4.3.1 其他价格 敞口

单位: 人民币元

| | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
|----------------|-------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
| | 公允价值 | 占基 产净值比 例 (%) | 公允价值 | 占基 产净值 比例 (%) |
| 交易性 产 — 投 | 152,322,575.27 | 11.30 | 132,047,392.73 | 12.68 |
| 交易性 产 — 基 投 | - | - | - | - |
| 交易性 产 — 属投 | - | - | - | - |
| 权 投 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合 | 152,322,575.27 | 11.30 | 132,047,392.73 | 12.68 |

7.4.13.4.3.2 其他价格 敏感性分析

| 假 | 沪深 300 指数以外 其他市场变 保持不变 | | 对 产 债 日基 产净值 影响 (单位: 人民币元) | |
|----|------------------------|------------------------|-------------------------------|--|
| | 关 变 变 动 | 本期末 (2021 年 12 月 31 日) | 上年度末 (2020 年 12 月 31 日) | |
| 分析 | 1. 沪深 300 指数上 升 5% | 6,394,442.23 | 6,016,380.94 | |
| | 2. 沪深 300 指数下 5% | -6,394,442.23 | -6,016,380.94 | |

注: 本基金 人 产- 本定价模型 (CAPM) 对本基 其他价格 分析。上 为其 其他价格 敏感性分析, 反映了在其他变 不变 假 下, 市场指数 (沪深 300) 价格发 合 可 变动时, 将对基 净值产 影响。

7.4.14 有助于 和分析会 报 明 其他事

(1) 公允价值

(a) 工具公允价值 方法

公允价值 果所属 层次, 对公允价值 整体 具有 意义 入值所属 最低层次决定:

一层次: 同 产或 债在活 市场上未 整 报价。

二层次: 一层次 入值外 关 产或 债 接或 接可 察 入值。

三层次: 关 产或 债 不可 察 入值。

(b) 持 以公允价值 工具

(i) 各层次 工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日, 本基 持有 以公允价值 且其变动 入当期损 产中属 于一层次 余 为 158,668,142.82 元, 属于 二层次 余 为 1,391,595,373.75 元, 属于 三层次 余 为 3,334,692.90 元 (2020 年 12 月 31 日: 一层次 159,758,340.99 元, 二层次 1,159,803,130.62 元, 三层次 30,000,000.00 元)。

(ii) 公允价值所属层次 大变动

本基 以导 各层次之 换 事 发 日为 各层次之 换 时点。

对于 券交易所上市 和债券, 出现 大事 停牌、交易不活 (包括涨 停时 交易不活)、或属于 公开发 情况, 本基 不会于停牌日 交易恢复活 日期、交易不活 期

及 售期 将 关 和债券 公允价值列入 一层次；并根据估值 整中 不可 察 入值对于公允价值 影响 度， 定 关 和债券公允价值应属 二层次 是 三层次。

(iii) 三层次公允价值余 和本期变动

于本期末，本基 持有公允价值归属于 三层次 工具为 3,334,692.90 元(2020 年 12 月 31 日: 30,000,000.00 元)。本基 本期净 入/(出) 三层次 为-27,403,270.11 元(2020 年度: 30,000,000.00 元)， 入损 三层次 工具公允价值变动为 737,963.01 元(2020 年度: 无)。

于 2021 年 12 月 31 日本基 持有 三层次 交易性 产(均为交易所市场上市交易但尚在 售期内 投)公允价值为 3,334,692.90 元， 平均价格亚式期权模型作为估值技术 估值，不可 察 入值为 流 受 在剩余 售期内 价 期平均波动率，与公允价值之 呈 关关 (2020 年 12 月 31 日: 本基 持有 三层次 交易性 产(均为交易所 产支持 券投)公允价值为 30,000,000.00 元， 市场法最 交易价格估值技术，不可 察 入值为 100.00 元/张，与公允价值之 呈正 关关)

(c) 持 以公允价值 工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基 未持有 持 以公允价值 产(2020 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值 工具

不以公允价值 产和 债主 包括应收款 和其他 债，其 价值与公允价值 差很小。

(2)根据 政 发布 《企业会 准则 22 号— 工具 和 》、《企业会 准则 23 号— 产 》、《企业会 准则 24 号—套期会 》和《企业会 准则 37 号— 工具列报》(以下合 “新 工具准则”) 关 接 定，以及 政 、中国 保 委员会于 2020 年 12 月 30 日发布 《关于 一步 彻 实新 工具 关会 准则 》，公募 券投 基 应当 2022 年 1 月 1 日 执 新 工具准则。截 2021 年 12 月 31 日，本基 已完成了执 新 工具准则对 务报 潜在影响 估。 于本基 业务 性 ，新 工具准则 期不会对本基 务状况和 成果产 大影响。

本基 将 2022 年 1 月 1 日 溯执 关新 定，并 准则允 实务 便方法， 整 期初所有 权 ， 2021 年 比 数据将不作 。

(3) 公允价值和执 新 工具准则外，截 产 债 日本基 无 明 其他 事 。

§ 8 投 合报告

8.1 期末基 产 合情况

单位：人民币元

| 序号 | | | 占基 总 产 比例 (%) |
|----|----------------|------------------|---------------|
| 1 | 权 投 | 152,322,575.27 | 9.16 |
| | 其中： | 152,322,575.27 | 9.16 |
| 2 | 基 投 | - | - |
| 3 | 固定收 投 | 1,401,275,634.20 | 84.24 |
| | 其中：债券 | 1,401,275,634.20 | 84.24 |
| | 产支持 券 | - | - |
| 4 | 属投 | - | - |
| 5 | 品投 | - | - |
| 6 | 买入 售 产 | - | - |
| | 其中：买断式回 买入 售 产 | - | - |
| 7 | 存款和 备付 合 | 16,674,996.82 | 1.00 |
| 8 | 其他各 产 | 93,146,897.66 | 5.60 |
| 9 | 合 | 1,663,420,103.95 | 100.00 |

注：1、本基 本报告期末 港 交易机制投 港 公允价值为 5,799,163.49 元人民币，占期末基 产净值比例 0.43%。

2、本基 本报告期末无参与 券出借业务 券。

8.2 报告期末按 业分 投 合

8.2.1 报告期末按 业分 境内 投 合

单位：人民币元

| 代 | 业 别 | 公允价值（元） | 占基 产净值比例 (%) |
|---|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 业 | 6,843,828.00 | 0.51 |
| C | 制 业 | 85,001,595.45 | 6.31 |
| D | 力、热力、燃气及水 产和 供应业 | 6,016,000.00 | 0.45 |
| E | 建 业 | 6,839,853.80 | 0.51 |
| F | 批发和 零售业 | 150,960.96 | 0.01 |
| G | 交 、仓储和 政业 | 3,450,627.00 | 0.26 |
| H | 住宿和 业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传 、 件和信息技术服 务业 | 3,824,543.54 | 0.28 |
| J | 业 | 22,449,625.60 | 1.67 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业 | 6,467,448.00 | 0.48 |
| L | 和商务服务业 | - | - |
| M | 学 和技术服务业 | 115,778.60 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共 施 业 | 2,470,848.19 | 0.18 |
| O | 居民服务、修 和其他服务业 | - | - |
| P | 教 | - | - |
| Q | 卫 和 会工作 | - | - |
| R | 文化、体 和娱乐业 | 2,887,694.64 | 0.21 |
| S | 合 | - | - |
| | 合 | 146,523,411.78 | 10.87 |

8.2.2 报告期末按 业分 港 投 投 合

| 业 别 | 公允价值（人民币） | 占基 产净值比例（%） |
|---------|--------------|-------------|
| 10 源 | - | - |
| 15 原材料 | - | - |
| 20 工业 | - | - |
| 25 可 消 | - | - |
| 30 主 消 | 682,491.60 | 0.05 |
| 35 医 卫 | - | - |
| 40 | - | - |
| 45 信息技术 | - | - |
| 50 信服务 | 5,116,671.89 | 0.38 |
| 55 公 事业 | - | - |
| 60 房地产 | - | - |
| 合 | 5,799,163.49 | 0.43 |

注：以上分 中 业分 标准。

8.3 期末按公允价值占基 产净值比例大小排序 所有 投 明

单位：人民币元

| 序号 | 代 | 名 | 数（ ） | 公允价值（元） | 占基 产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|-------------|
| 1 | 002475 | 密 | 171,400 | 8,432,880.00 | 0.63 |
| 2 | 600887 | 伊利 份 | 187,300 | 7,765,458.00 | 0.58 |
| 3 | 002415 | 海康威 | 141,200 | 7,387,584.00 | 0.55 |
| 4 | 601088 | 中国 华 | 303,900 | 6,843,828.00 | 0.51 |
| 5 | 601186 | 中国 建 | 876,300 | 6,835,140.00 | 0.51 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 131,800 | 6,644,038.00 | 0.49 |
| 7 | 000333 | 团 | 88,000 | 6,495,280.00 | 0.48 |
| 8 | 000002 | 万 A | 327,300 | 6,467,448.00 | 0.48 |
| 9 | 002142 | 宁波 | 148,720 | 5,693,001.60 | 0.42 |
| 10 | 601658 | 储 | 1,105,900 | 5,640,090.00 | 0.42 |
| 11 | 002008 | 大族激光 | 100,000 | 5,400,000.00 | 0.40 |
| 12 | 002493 | 化 | 293,450 | 5,329,052.00 | 0.40 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 13 | 00700 | 控 | 13,700 | 5,116,671.89 | 0.38 |
| 14 | 600741 | 华域汽 | 177,080 | 5,011,364.00 | 0.37 |
| 15 | 601166 | 兴业 | 234,900 | 4,472,496.00 | 0.33 |
| 16 | 002832 | 比 勒 | 168,700 | 4,293,415.00 | 0.32 |
| 17 | 300482 | 万孚 物 | 106,180 | 4,181,368.40 | 0.31 |
| 18 | 600011 | 华 国 | 400,000 | 3,876,000.00 | 0.29 |
| 19 | 600029 | 南方 | 506,700 | 3,450,627.00 | 0.26 |
| 20 | 600426 | 华 恒升 | 107,608 | 3,368,130.40 | 0.25 |
| 21 | 300122 | 智 物 | 26,400 | 3,289,440.00 | 0.24 |
| 22 | 600031 | 三一 工 | 142,600 | 3,251,280.00 | 0.24 |
| 23 | 600183 | 技 | 134,900 | 3,176,895.00 | 0.24 |
| 24 | 002739 | 万 影 | 186,000 | 2,879,280.00 | 0.21 |
| 25 | 002925 | 技 | 81,770 | 2,782,633.10 | 0.21 |
| 26 | 600323 | 瀚 环境 | 117,200 | 2,458,856.00 | 0.18 |
| 27 | 600745 | 泰 技 | 17,500 | 2,262,750.00 | 0.17 |
| 28 | 002311 | 海大 团 | 30,600 | 2,242,980.00 | 0.17 |
| 29 | 600027 | 华 国 | 400,000 | 2,140,000.00 | 0.16 |
| 30 | 002078 | 太 业 | 185,300 | 2,129,097.00 | 0.16 |
| 31 | 002223 | 医 | 55,800 | 2,109,240.00 | 0.16 |
| 32 | 002153 | 基信息 | 63,600 | 1,827,864.00 | 0.14 |
| 33 | 601728 | 中国 信 | 394,011 | 1,682,426.97 | 0.12 |
| 34 | 601233 | 桐昆 份 | 68,300 | 1,446,594.00 | 0.11 |
| 35 | 300760 | 医 | 3,600 | 1,370,880.00 | 0.10 |
| 36 | 688176 | 亚 医 | 37,990 | 873,010.20 | 0.06 |
| 37 | 688798 | 为 子 | 3,592 | 775,872.00 | 0.06 |
| 38 | 06969 | 思摩尔国 | 21,000 | 682,491.60 | 0.05 |
| 39 | 688499 | 利元亨 | 2,149 | 629,657.00 | 0.05 |
| 40 | 688262 | 括国 技 | 7,129 | 299,275.42 | 0.02 |
| 41 | 300957 | 泰妮 | 806 | 154,977.68 | 0.01 |
| 42 | 688091 | 上海 众 | 3,294 | 141,016.14 | 0.01 |
| 43 | 688737 | 中 技 | 2,186 | 120,361.16 | 0.01 |
| 44 | 301177 | 份 | 792 | 91,935.36 | 0.01 |
| 45 | 301136 | 招标 份 | 7,172 | 75,449.44 | 0.01 |
| 46 | 301050 | 微力 | 233 | 54,694.42 | 0.00 |
| 47 | 301029 | 怡合 | 462 | 41,519.94 | 0.00 |
| 48 | 688501 | 环保 | 1,759 | 37,132.49 | 0.00 |
| 49 | 301035 | 润丰 份 | 644 | 36,244.32 | 0.00 |
| 50 | 301039 | 中 | 2,064 | 25,820.64 | 0.00 |
| 51 | 301189 | 奥尼 子 | 435 | 24,629.70 | 0.00 |
| 52 | 301166 | 优宁 | 253 | 23,908.50 | 0.00 |
| 53 | 301096 | 医 | 272 | 21,360.16 | 0.00 |
| 54 | 301082 | 久 气 | 915 | 19,699.95 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 55 | 300994 | 久 份 | 420 | 19,089.00 | 0.00 |
| 56 | 301100 | 光 份 | 599 | 18,652.86 | 0.00 |
| 57 | 001296 | 江材料 | 310 | 18,376.80 | 0.00 |
| 58 | 301168 | 灵 份 | 329 | 17,150.77 | 0.00 |
| 59 | 301190 | 善水 技 | 575 | 15,789.50 | 0.00 |
| 60 | 301108 | 洁 份 | 280 | 15,038.80 | 0.00 |
| 61 | 301179 | 泽宇智 | 295 | 14,977.15 | 0.00 |
| 62 | 301009 | 可 份 | 801 | 14,778.45 | 0.00 |
| 63 | 301046 | 技 | 290 | 14,207.10 | 0.00 |
| 64 | 301111 | 万年 | 379 | 13,901.72 | 0.00 |
| 65 | 301017 | 漱玉平民 | 555 | 13,209.00 | 0.00 |
| 66 | 301020 | 密封 技 | 421 | 12,815.24 | 0.00 |
| 67 | 301138 | 华 机 | 285 | 12,785.10 | 0.00 |
| 68 | 301026 | 浩 技 | 203 | 12,734.19 | 0.00 |
| 69 | 301126 | 嘉 康 | 662 | 12,730.26 | 0.00 |
| 70 | 301021 | 激光 | 290 | 12,014.70 | 0.00 |
| 71 | 300993 | 玉 | 410 | 11,771.10 | 0.00 |
| 72 | 301048 | 工 | 843 | 10,925.28 | 0.00 |
| 73 | 301028 | 东亚机械 | 733 | 9,895.50 | 0.00 |
| 74 | 301040 | 中环海 | 241 | 9,280.91 | 0.00 |
| 75 | 301078 | 孩子王 | 756 | 9,177.84 | 0.00 |
| 76 | 301182 | 凯旺 技 | 294 | 8,990.52 | 0.00 |
| 77 | 301193 | 家 技 | 297 | 8,654.58 | 0.00 |
| 78 | 301025 | 客文化 | 403 | 8,414.64 | 0.00 |
| 79 | 301066 | 万事利 | 344 | 7,856.96 | 0.00 |
| 80 | 300814 | 中富 | 328 | 7,832.64 | 0.00 |
| 81 | 301055 | 张小泉 | 355 | 7,731.90 | 0.00 |
| 82 | 301133 | 份 | 286 | 7,707.70 | 0.00 |
| 83 | 301198 | 喜悦智 | 262 | 7,650.40 | 0.00 |
| 84 | 301033 | 普医学 | 108 | 6,476.76 | 0.00 |
| 85 | 301049 | 技 | 196 | 6,452.32 | 0.00 |
| 86 | 301032 | 新柴 份 | 513 | 6,417.63 | 0.00 |
| 87 | 301056 | 森 份 | 572 | 6,343.48 | 0.00 |
| 88 | 301036 | 双乐 份 | 205 | 6,135.65 | 0.00 |
| 89 | 301072 | 中捷 工 | 181 | 6,047.21 | 0.00 |
| 90 | 300854 | 中兰环保 | 203 | 5,539.87 | 0.00 |
| 91 | 301063 | 海 份 | 153 | 5,524.83 | 0.00 |
| 92 | 001234 | 泰慕士 | 333 | 5,504.49 | 0.00 |
| 93 | 301027 | 华 团 | 286 | 4,761.90 | 0.00 |
| 94 | 603176 | 汇 团 | 1,924 | 4,713.80 | 0.00 |
| 95 | 301037 | 保 佳 | 193 | 4,682.18 | 0.00 |
| 96 | 301073 | 君亭 店 | 144 | 4,608.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 97 | 301053 | 信工业 | 155 | 4,460.90 | 0.00 |
| 98 | 301057 | 汇 新材 | 218 | 4,146.36 | 0.00 |
| 99 | 301079 | 液压 | 140 | 3,474.80 | 0.00 |

注：对于同时在 A+H 上市，合并 公允价值参与排序，并按照不同 分别披 。

8.4 报告期内 投 合 大变动

8.4.1 买入 出期初基 产净值 2%或前 20 名 明

单位：人民币元

| 序号 | 代 | 名 | 本期 买入 | 占期初基 产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|
| 1 | 300122 | 智 物 | 8,089,230.98 | 0.78 |
| 2 | 601398 | 工商 | 7,787,720.00 | 0.75 |
| 3 | 002475 | 密 | 7,445,207.00 | 0.72 |
| 4 | 601658 | 储 | 5,999,845.00 | 0.58 |
| 5 | 002304 | 洋河 份 | 5,634,353.00 | 0.54 |
| 6 | 00700 | 控 | 5,348,779.37 | 0.51 |
| 7 | 600036 | 招商 | 5,302,655.00 | 0.51 |
| 8 | 600377 | 宁沪 | 4,549,696.00 | 0.44 |
| 9 | 601166 | 兴业 | 4,498,623.00 | 0.43 |
| 10 | 002415 | 海康威 | 4,408,928.06 | 0.42 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 4,049,334.82 | 0.39 |
| 12 | 601012 | 基 份 | 3,996,280.20 | 0.38 |
| 13 | 300482 | 万孚 物 | 3,907,504.70 | 0.38 |
| 14 | 002493 | 化 | 3,199,698.00 | 0.31 |
| 15 | 600887 | 伊利 份 | 2,970,277.00 | 0.29 |
| 16 | 603882 | 域医学 | 2,891,516.00 | 0.28 |
| 17 | 688235 | 济 州 | 2,868,391.80 | 0.28 |
| 18 | 600741 | 华域汽 | 2,770,888.00 | 0.27 |
| 19 | 000333 | 团 | 2,596,333.00 | 0.25 |
| 20 | 600031 | 三一 工 | 2,566,179.71 | 0.25 |

注：“本期 买入 ”按买入成交 （成交价乘以成交数 ）填列，不 关交易 。

8.4.2 卖出 出期初基 产净值 2%或前 20 名 明

单位：人民币元

| 序号 | 代 | 名 | 本期 卖出 | 占期初基 产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|---------------|
| 1 | 600036 | 招商 | 11,772,813.00 | 1.13 |
| 2 | 601398 | 工商 | 7,222,240.00 | 0.69 |
| 3 | 000001 | 平安 | 6,253,556.80 | 0.60 |
| 4 | 002304 | 洋河 份 | 4,858,974.00 | 0.47 |
| 5 | 601012 | 基 份 | 4,544,167.26 | 0.44 |
| 6 | 600377 | 宁沪 | 4,187,606.00 | 0.40 |
| 7 | 600741 | 华域汽 | 3,745,802.00 | 0.36 |
| 8 | 002415 | 海康威 | 3,606,700.00 | 0.35 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9 | 002493 | 化 | 3,129,333.00 | 0.30 |
| 10 | 002736 | 国信 券 | 2,942,567.83 | 0.28 |
| 11 | 600011 | 华 国 | 2,926,208.00 | 0.28 |
| 12 | 601088 | 中国 华 | 2,770,699.00 | 0.27 |
| 13 | 002142 | 宁波 | 2,679,934.00 | 0.26 |
| 14 | 300122 | 智 物 | 2,634,504.00 | 0.25 |
| 15 | 688235 | 济 州 | 2,530,690.96 | 0.24 |
| 16 | 601238 | 广汽 团 | 2,479,770.00 | 0.24 |
| 17 | 000858 | 五 液 | 2,450,976.00 | 0.24 |
| 18 | 601966 | 玲珑 | 2,252,394.04 | 0.22 |
| 19 | 601233 | 桐昆 份 | 2,236,687.80 | 0.21 |
| 20 | 601628 | 中国人寿 | 2,079,664.80 | 0.20 |

注：“本期 卖出 ”按卖出成交 （成交价乘以成交数 ）填列，不 关交易 。

8.4.3 买入 成本总 及卖出 收入总

单位：人民币元

| | |
|------------|----------------|
| 买入 成本（成交）总 | 142,886,423.04 |
| 卖出 收入（成交）总 | 153,152,428.38 |

注：“买入 成本（成交）总 ”和“卖出 收入（成交）总 ”按买卖成交 （成交价乘以成交数 ）填列，不 关交易 。

8.5 期末按债券品 分 债券投 合

单位：人民币元

| 序号 | 债券品 | 公允价值 | 占基 产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 10,002,000.00 | 0.74 |
| 2 | 央 据 | - | - |
| 3 | 债券 | 433,295,000.00 | 32.15 |
| | 其中：政 性 债 | 70,245,000.00 | 5.21 |
| 4 | 企业债券 | 412,105,413.00 | 30.58 |
| 5 | 企业 期 券 | 321,014,000.00 | 23.82 |
| 6 | 中期 据 | 110,064,000.00 | 8.17 |
| 7 | 可 债（可交换债） | 114,795,221.20 | 8.52 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合 | 1,401,275,634.20 | 103.98 |

8.6 期末按公允价值占基 产净值比例大小排序 前五名债券投 明

单位：人民币元

| 序号 | 债券代 | 债券名 | 数 （张） | 公允价值 | 占基 产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 200312 | 20 出 12 | 700,000 | 70,245,000.00 | 5.21 |
| 2 | 163420 | 20 光明 01 | 700,000 | 69,916,000.00 | 5.19 |
| 3 | 163910 | 20 中 16 | 600,000 | 60,744,000.00 | 4.51 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 4 | 175099 | 20 国君 G5 | 500,000 | 50,810,000.00 | 3.77 |
| 5 | 149189 | 20 大悦 01 | 500,000 | 50,620,000.00 | 3.76 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序 所有 产支持 券投 明

注：本基金本报告期末未持有 产支持 券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序 前五名 属投 明

注：本基金本报告期末未持有 属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序 前五名权 投 明

注：本基金本报告期末未持有 权。

8.10 报告期末本基金 投 指期 交易情况 明

8.10.1 报告期末本基金 投 指期 持仓和损 明

注：本基金本报告期末未持有 指期。

8.10.2 本基金 投 指期 投 政

本基金 投 指期 将根据 原则，以套期保值为 ，以回 市场 。故 指期 头 合 价值主 与 合 多头价值 对应。基 动态 指期 合 数 ，以期 取 应 合 收 。

8.11 报告期末本基金 投 国债期 交易情况 明

8.11.1 本期国债期 投 政

本基金 投 国债期 将根据 原则，以套期保值为主 ，以回 市场 。故 国债期 头 合 价值主 与 债券 合 多头价值 对应。基 动态 国债期 合 数 ，以 取 应 债券 合 收 。

8.11.2 报告期末本基金 投 国债期 持仓和损 明

注：本基金本报告期末 国债期 投 。

8.11.3 本期国债期 投 价

本基金本报告期末 国债期 投 。

8.12 投 合报告 注

8.12.1 基 投 前十名 券 发 主体本期是否出现 案 查，或在 报告 制日前一年内受到公开 、处 情形

本基金持有 20 中 16（代 号：163910 SH）发 主体中信 券 份有 公司因 QDII 度汇出 七 为，于 2021 年 11 月 22 日 国家外汇 局深圳市分局 予 告，没收 法 所得 81 万元，处 款 101 万元。

本基金持有 20 出 12（代 号：200312 IB）发 主体中国 出口 因 投 企业

权二十四 于 2021 年 7 月 13 日 中国 保 委员会 没 7345.6 万元。

本基 持有 宁波 （代 号：002142） 发 主体宁波 份有 公司因代 售保 不 于 2021 年 6 月 10 日 宁波 保 局处以 款人民币 25 万元，并 令 对 关 接 任 人员 予 律处分；因 反 定办 常 外汇业务、 反 定办 本 收付，于 2021 年 7 月 13 日 国家外汇 局宁波市分局 令改正， 款 100 万元，没收 法所得 1048476.65 元；因 为存款人多头开 户 六 为，于 2021 年 7 月 13 日 中国人民 宁波市中心支 予 告，并处 款 286.2 万元；因 款 挪 于 土地款或土地收储 六 为，于 2021 年 7 月 30 日 宁波 保 局处以 款 275 万元，并 令 对 关 接 任人员 予 律处分；因信 卡业务 不到位，于 2021 年 12 月 29 日 宁波 保 局处以 款 30 万元，并 令 对 关 接 任人员 予 律处分。

本基 对上 券 投 决 序 合基 合同及公司制度 关 定，本基 人会 对上 券 保持 。

本基 持有 前十名 券中其余 券 发 主体本期未出现 案 查，或在报告 制日前一年内受到公开 、处 情形。

8.12.2 基 投 前十名 是否 出基 合同 定 备 库

本基 投 前十名 未 出基 合同 定 备 库。

8.12.3 期末其他各 产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名 | |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保 | 87,331.36 |
| 2 | 应收 券清 款 | 75,930,909.31 |
| 3 | 应收 利 | - |
| 4 | 应收利息 | 17,128,656.99 |
| 5 | 应收 款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合 | 93,146,897.66 |

8.12.4 期末持有 处于 期 可 换债券明

单位：人民币元

| 序号 | 债券代 | 债券名 | 公允价值 | 占基 产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1 | 132015 | 18 中油 EB | 41,572,000.00 | 3.08 |
| 2 | 132009 | 17 中油 EB | 40,218,531.20 | 2.98 |

| | | | | |
|---|--------|----------|---------------|------|
| 3 | 132008 | 17 山 EB | 10,568,000.00 | 0.78 |
| 4 | 132011 | 17 浙报 EB | 10,241,190.00 | 0.76 |
| 5 | 110045 | 海澜 债 | 7,018,800.00 | 0.52 |
| 6 | 113024 | 核建 债 | 3,914,700.00 | 0.29 |

8.12.5 期末前十名 中存在流 受 情况 明

注：本基 本报告期末前十名 中未存在流 受 情况。

8.12.6 投 合报告 注 其他文字描 分

于四 五入 原因，投 合报告中市值占净值比例 分 之和与合 之 可 存在尾 差。

§ 9 基 份 持有人信息

9.1 期末基 份 持有人户数及持有人 构

份 单位：份

| 份 别 | 持有人 户数 (户) | 户均持有 基 份 | 持有人 构 | | | |
|---------------|------------|-----------|------------|------------|------------------|------------|
| | | | 机构投 | | 个人投 | |
| | | | 持有份 | 占总份 比例 (%) | 持有份 | 占总份 比例 (%) |
| 东方 优 一年持有混合 A | 14,319 | 91,849.27 | 757,372.64 | 0.06 | 1,314,432,347.45 | 99.94 |
| 东方 优 一年持有混合 C | 256 | 1,552.91 | - | - | 397,545.17 | 100.00 |
| 合 | 14,575 | 90,263.28 | 757,372.64 | 0.06 | 1,314,829,892.62 | 99.94 |

注：分 基 机构/个人投 持有份 占总份 比例 中，对下属分 基 ，比例 分母 各 别 份 ，对合 数，比例 分母 下属分 基 份 合 数（即期末基 份 总 ）。

9.2 期末基 份 从业人员持有本基 情况

| | 份 别 | 持有份 总数 (份) | 占基 总份 比例 (%) |
|-------------------|---------------|------------|--------------|
| 基 份 所 有从业 人员持 有本基 | 东方 优 一年持有混合 A | 105.54 | 0.00 |
| | 东方 优 一年持有混合 C | 244.26 | 0.06 |

| | | | |
|--|---|--------|------|
| | 合 | 349.80 | 0.00 |
|--|---|--------|------|

注：分基 人 从业人员持有基 占基 总份 比例 中，对下属分 基 ，比例 分母 各 别 份 ，对合 数，比例 分母 下属分 基 份 合 数（即期末基 份 总 ）。

9.3 期末基 人 从业人员持有本开放式基 份 总 区 情况

| | 份 别 | 持有基 份 总 数 区 （万份） |
|---------------------------------|-------------------|------------------|
| 本公司 人、 基 投 和 人持有本开放式 基 | 东方 优 一年持有混 合 A | 0 |
| | 东方 优 一年持有混 合 C | 0 |
| | 合 | 0 |
| 本基 基 持有 本开放式基 | 东方 优 一年持有混 合 A | 0 |
| | 东方 优 一年持有混 合 C | 0 |
| | 合 | 0 |

9.4 期末兼任 募 产 划投 基 本人及其 亲属持有本人 产品情况

注：本基 基 本报告期末未兼任 募 产 划投

§ 10 开放式基 份 变动

单位：份

| | 东方 优 一年持有混合 A | 东方 优 一年持有混合 C |
|---------------------------------------|------------------|---------------|
| 基 合同 效日 (2020 年 7 月 23 日) 基 份 总 | 1,004,555,510.85 | - |
| 本报告期期初基 份 总 | 1,004,555,510.85 | |
| 本报告期基 总 份 | 899,927,818.80 | 397,545.17 |
| 减：本报告期基 总 回份 | 589,293,609.56 | - |
| 本报告期基 拆分变 动份 （份 减少以 “-” 填列） | - | - |
| 本报告期期末基 份 总 | 1,315,189,720.09 | 397,545.17 |

§ 11 大事件揭

11.1 基 份 持有人大会决

本基 本报告期内没有召开基 份 持有人大会。

11.2 基 人、基 托 人 专 基 托 大人事变动

刚同志于 2021 年 3 月 12 日 不再担任本基 人 副总 务；张 同志 2021 年 8 月 20 日 担任本基 人 总 务，同时任 同志不再担任总 务； 丽 同志于 2021 年 9 月 24 日 担任本基 人 席总 务。
本报告期内，本基 托 人 专 基 托 无 大人事变动。

11.3 涉及基 人、基 产、基 托 业务

报告期内未发 基 人、基 产、基 托 业务 。

11.4 基 投 改变

本基 本报告期内投 无改变。

11.5 为基 审 会 师事务所情况

为本基 审 会 师事务所是普华永 中天会 师事务所（特殊普 合伙）。会 师事务所 本基 基 合同 效日 为本基 提供审 服务 今。本基 本报告期应支付 事务所审 报 为 10 万元人民币。

11.6 人、托 人及其 人员受 查或处 情况

报告期内基 人、托 人及其 人员无受 查或处 情况。

11.7 基 券公司交易单元 有关情况

11.7.1 基 券公司交易单元 投 及佣 支付情况

单位：人民币元

| 券商名 | 交易单元数 | 交易 | | 应支付 券商 佣 | | 备注 |
|-------|-------|----------------|-----------|------------|-----------|----|
| | | 成交 | 占当期 成交 比例 | 佣 | 占当期佣 总 比例 | |
| 东方 券 | 4 | 270,230,537.26 | 100.00% | 192,566.94 | 100.00% | - |
| 光大 券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海 券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万宏源 券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、此处 佣 指 单一券商 交易单元 、权 交易（如有） 合 支付 券商

佣 合 ，不单指 交易佣 。

2、交易单元 择标准和 序

(1) 择标准

券商 务状况 好、 为 ，最 一年无 大 为；具有 强 服务 力；
交易佣 收 合

(2) 择 序

基 人根据以上标准对不同券商 合 价，然后根据 价 择券商，与其 协
交易单元。

3、本基 本报告期内 券商交易单元变更情况：新增东方 券交易单元 1 个。

11.7.2 基 券公司交易单元 其他 券投 情况

单位：人民币元

| 券商名 | 债券交易 | | 债券回 交易 | | 权 交易 | |
|------|------------------|------------|-------------------|-------------|------|-----------|
| | 成交 | 占当期债券成交总比例 | 成交 | 占当期债券回成交总比例 | 成交 | 占当期权成交总比例 |
| 东方 券 | 1,007,171,171.02 | 100.00% | 14,798,971,000.00 | 100.00% | - | - |
| 光大 券 | - | - | - | - | - | - |
| 海 券 | - | - | - | - | - | - |
| 万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 券 | - | - | - | - | - | - |

11.8 其他 大事件

| 序号 | 公告事 | 法定披 方式 | 法定披 日期 |
|----|--|--------------------------------------|-----------------|
| 1 | 东方 优 一年持有期混合型券投 基 分 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 1 月 6 日 |
| 2 | 上海东方 券 产 有 公司关于住所变更 公告 | 上海 券报、中国 券报、 券时报、 券日报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 1 月 8 日 |
| 3 | 上海东方 券 产 有 公司关于旗下基 在 平台开展 率优惠活动 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 1 月 11 日 |
| 4 | 上海东方 券 产 有 公司关于旗下 分基 2021 年 港 交易 日暂停 、 回 业务 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 1 月 15 日 |
| 5 | 东方 优 一年持有期混合型 | 上海 券报、中国 | 2021 年 1 月 22 日 |

| | | | |
|----|---|--|-----------------|
| | 券投基 2020 年 4 季度报告/提 性公告 | 会基子披 公司官 | |
| 6 | 上海东方券产有公司关于 旗下分基增加中国人寿保 份有公司为代售机构并开 定投业务公告 | 上海券报、中国 会基子披 公司官 | 2021 年 2 月 22 日 |
| 7 | 上海东方券产有公司关于 人员变更公告 | 上海券报、中国券 报、券时报、券日 报、中国会基 子披、公司官 | 2021 年 3 月 13 日 |
| 8 | 东方优 一年持有期混合型 券投基 2020 年年度报告/提 性公告 | 上海券报、中国 会基子披 公司官 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 9 | 东方优 一年持有期混合型 券投基分公告 | 上海券报、中国 会基子披 公司官 | 2021 年 4 月 13 日 |
| 10 | 东方优 一年持有期混合型 券投基 2021 年 1 季度报告/提 性公告 | 上海券报、中国 会基子披 公司官 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 11 | 东方优 一年持有期混合型 券投基开放及换入业务 公告 | 上海券报、中国 会基子披 公司官 | 2021 年 4 月 29 日 |
| 12 | 上海东方券产有公司关于 基休假期他人代为履 公告 | 上海券报、中国 会基子披 公司官 | 2021 年 5 月 6 日 |
| 13 | 关于东方优 一年持有期混合 型券投基在平台开换 业务并开展率优惠活动公告 | 上海券报、中国 会基子披 公司官 | 2021 年 6 月 10 日 |
| 14 | 关于东方优 一年持有期混合 型券投基在上平台开 定期定投业务并开展率优惠活 动公告 | 上海券报、中国 会基子披 公司官 | 2021 年 6 月 10 日 |
| 15 | 关于上海东方券产有公司 中心变更汇款户公告 | 上海券报、中国券 报、券时报、券日 报、中国会基 子披、公司官 | 2021 年 6 月 22 日 |
| 16 | 东方优 一年持有期混合型 券投基招募 明书(更新)(2021 年 1 号) | 中国会基子披 、公司官 | 2021 年 6 月 29 日 |
| 17 | 东方优 一年持有期混合型 券投基基产品料概更新 | 中国会基子披 、公司官 | 2021 年 6 月 29 日 |
| 18 | 上海东方券产有公司关于 旗下分基在上海所基售 有公司开定期定投业务公 | 上海券报、中国 会基子披 公司官 | 2021 年 7 月 6 日 |

| | | | |
|----|---|--|-----------------|
| | 告 | | |
| 19 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 暂停大 (含定期定 投、 换 入业务) 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 12 日 |
| 20 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 暂停大 (含定期定 投、 换 入业务) 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 13 日 |
| 21 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 在 上 平台开展 率优惠活动 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 13 日 |
| 22 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 分 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 13 日 |
| 23 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 在珠海 基 售有 公司开 定期定 投 业务 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 14 日 |
| 24 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 在京东 特 基 售 有 公司开 定期定 投 业务 公 告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 14 日 |
| 25 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 在国信 券 份有 公 司开 定投业务 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 16 日 |
| 26 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 增加 安基 售(深 圳)有 公司为代 售机构并开 定投业务 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 19 日 |
| 27 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 开放 回及 换 出业务 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 20 日 |
| 28 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 2021 年 2 季度报告/提 性公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 7 月 21 日 |
| 29 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 在上海天天基 售有 公司开 定期定 投 业务 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 8 月 5 日 |
| 30 | 上海东方 券 产 有 公司关于 人员变更 公告 | 上海 券报、中国 券 报、 券时报、 券日 报、中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 8 月 21 日 |
| 31 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 增加上海农村商业 份有 公司为代 售机构并开 定投业务 公告.pdf | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 8 月 23 日 |

| | | | |
|----|--|--|------------------|
| 32 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 2021 年中期报告/提 性 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 8 月 31 日 |
| 33 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 增加北京度小满基 售有 公司为代 售机构并开 定 投业务 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 9 月 1 日 |
| 34 | 上海东方 券 产 有 公司关于 人员变更 公告 | 上海 券报、中国 券 报、 券时报、 券日 报、中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 9 月 25 日 |
| 35 | 上海东方 券 产 有 公司关于 基 恢复履 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 9 月 27 日 |
| 36 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 因港 暂停交易 暂 停开放 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 10 月 13 日 |
| 37 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 暂停大 (含定期定 投、 换 入业务) 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 10 月 13 日 |
| 38 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 增加上海基煜基 售 有 公司为代 售机构 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 10 月 14 日 |
| 39 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 分 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 10 月 15 日 |
| 40 | 关于东方 优 一年持有期混合 型 券投 基 增加 分渠 为代 售机构 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 41 | 关于东方 优 一年持有期混合 型 券投 基 增加 C 基 份 及 修改基 合同和托 协 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 42 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 2021 年 3 季度报告/提 性公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 43 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 托 协 | 中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 44 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 基 合同 | 中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 10 月 27 日 |
| 45 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 招募 明书(更新)(2021 年 2 号) | 中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 10 月 28 日 |
| 46 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 (A 份)基 产品 料 | 中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 10 月 28 日 |

| | | | |
|----|--|--|------------------|
| | 概 更新 | | |
| 47 | 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 (C 份)基 产品 料 概 更新 | 中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 10 月 28 日 |
| 48 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 增加国泰君安 券 份 有 公司为代 售机构 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 10 月 29 日 |
| 49 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下基 在 平台开展机构客户 率优惠活动 公告 | 上海 券报、中国 券 报、 券时报、 券日 报、中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 11 月 3 日 |
| 50 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 可投 北京 券交易所 公告 | 上海 券报、中国 券 报、 券时报、 券日 报、中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 11 月 19 日 |
| 51 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 在上海天天基 售有 公司办 定投业务 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 11 月 26 日 |
| 52 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 在 上 平台开展 率优惠活动 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 11 月 29 日 |
| 53 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 大关 交易事 公 告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 12 月 2 日 |
| 54 | 上海东方 券 产 有 公司关于 北京分公司 公告 | 上海 券报、中国 券 报、 券时报、 券日 报、中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 12 月 2 日 |
| 55 | 上海东方 券 产 有 公司关于 提 平台投 及时完善、更新 份 料信息 公告 | 上海 券报、中国 券 报、 券时报、 券日 报、中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 12 月 10 日 |
| 56 | 上海东方 券 产 有 公司关于 公司 上 平台暂停服务 公告 | 上海 券报、中国 券 报、 券时报、 券日 报、中国 会基 子披 、公司官 | 2021 年 12 月 22 日 |
| 57 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 港 交易日安排 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 12 月 24 日 |
| 58 | 上海东方 券 产 有 公司关于 旗下 分基 2021 年底及 2022 年 港 交易日暂停 、 回 业务 公告 | 上海 券报、中国 会基 子披 、 公司官 | 2021 年 12 月 28 日 |

§ 12 影响投 决 其他 信息

12.1 报告期内单一投 持有基 份 比例 到或 20% 情况

注：本基 本报告期内未发 单一投 持有基 份 比例 到或 20% 情况。

12.2 影响投 决 其他 信息

无。

§ 13 备查文件 录

13.1 备查文件 录

- 1、中国 会批准 东方 优 一年持有期混合型 券投 基 文件；
- 2、《东方 优 一年持有期混合型 券投 基 基 合同》；
- 3、《东方 优 一年持有期混合型 券投 基 托 协 》；
- 4、东方 优 一年持有期混合型 券投 基 务报 及报 注；
- 5、报告期内在 定媒介上披 各 公告；
- 6、基 人业务 格批件、 业执照；
- 7、中国 会 求 其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基 人办公场所：上海市 浦区外 108 号 7 层。

13.3 查 方式

投 可到基 人办公场所免 查 备查文件，亦可 公司 查 ，公司 址为：
www.dfham.com。

上海东方 券 产 人 有 公司

2022 年 3 月 31 日