
东 中国优势 合型 券
基
2021 年年度 告

2021 年 12 31

基 人：上 东 券 产 公司

基 人：中国工商 份 公司

出 日期：2022 年 3 31

§ 1 及 录

1.1

基 人 事会、 事保 告 不存在 假 、 导 大 ，
并对其内容 实 、 准 和完 个别及 带 任。 年度 告 事 发。

基 人中国工商 份 公司 基 合同 定，于 2022 年 3 月 28 日 复 了
告中 务 、 净值 、 利 分 况、 务会 告、 合 告 内容，保 复
内容不存在 假 、 导 大 。

基 人 以 实信 、 勤勉尽 原则 和 基 产，但不保 基 一定 利。
基 往业 并不代 其 。 ， 在作出 决 前应仔
基 募 书及其 。

告 2021 年 01 月 01 日至 12 月 31 日 。

1.2 录

§1	及 录	2
1.1		2
1.2	录	3
§2	基 介	5
2.1	基 基 况	5
2.2	基 产品	5
2.3	基 人和基 人	5
2.4	信 式	6
2.5	其他 关	6
§3	主 务 、基 净值 及利 分 况	6
3.1	主 会 和 务	6
3.2	基 净值	7
3.3	去三年基 利 分 况	9
§4	人 告	9
4.1	基 人及基 况	9
4.2	人对 告 内 基 作 守信 况	11
4.3	人对 告 内公平交 况 专	11
4.4	人对 告 内基 和业	12
4.5	人对宏 、 券市场及 业 势 展	13
4.6	人内 关 基 察 工作 况	14
4.7	人对 告 内基 估值 序 事	14
4.8	人对 告 内基 利 分 况	15
4.9	告 内 人对 基 人 基 产净值 形	15
§5	人 告	15
5.1	告 内 基 人 守信 况声	15
5.2	人对 告 内 基 作 守信、净值 、利 分 况	15
5.3	人对 年度 告中 务信 内容 实、准 和完 发	15
§6	审 告	15
6.1	审 告基 信	15
6.2	审 告 基 内容	15
§7	年度 务	17
7.1	产 债	17
7.2	利	19
7.3	(基 净值)变动	20
7.4		21
§8	合 告	54

8.1	基 产 合 况.....	54
8.2	告 业分 合.....	55
8.3	公允价值占基 产净值 例大小 序	56
8.4	告 内 合 大变动.....	58
8.5	债券品 分 债券 合.....	60
8.6	公允价值占基 产净值 例大小 序 前五名债券	60
8.7	公允价值占基 产净值 例大小 序 产 券	60
8.8	告 公允价值占基 产净值 例大小 序 前五名 属	60
8.9	公允价值占基 产净值 例大小 序 前五名	60
8.10	告 基 交 况	60
8.11	告 基 国债 交 况	61
8.12	合 告	61
§9	基 份 人 信	62
9.1	基 份 人 及 人	62
9.2	基 人 从业人员 基 况.....	62
9.3	基 人 从业人员 开 式基 份 区 况.....	62
9.4	兼任 募 产 划 基 人及其 亲属 人 产品 况.....	63
§10	开 式基 份 变动.....	63
§11	大 事 件	63
11.1	基 份 人大会决	63
11.2	基 人、基 人 专 基 大人事变动.....	63
11.3	及基 人、基 产、基 业务	63
11.4	基 变.....	63
11.5	为基 审 会 师事务 况.....	63
11.6	人、 人及其 人员受 处 况.....	64
11.7	基 券公司交 单元 关 况.....	64
11.8	其他 大事件.....	66
§12	影 响 决 其 他 信	69
12.1	告 内单一 基 份 例 到 20% 况.....	69
12.2	影 响 决 其 他 信	69
§13	备 件 录.....	70
13.1	备 件 录.....	70
13.2	存 地	70
13.3	式.....	70

§ 2 基 介

2.1 基 基 况

基 名	东 中国优势 合型 券 基
基	东 中国优势 合
基 主代	001112
基 作 式	契 型开 式
基 合同	2015 年 4 7
基 人	上 东 券 产 公 司
基 人	中国工商 份 公 司
告 基 份	1,825,170,001.89 份
基 合同存	不定

2.2 基 产品

	基 在国家 化 、 型 下， 合 向， 国 争力 业和企业，严 ， 力争实 基 产 定增值。
	基 定 与定 合 ， 定 合中 产和固定 产 例。 动 内外主 体 GDP、CPI、利 宏 ， 以及估值 平、 利 、 动 、 市场 ， 定 市场变动 势， 全 估上 各 关 变动 势，对 、 债券 大 产 和 征 。 上 定 和定 分 ， 产 优化 型，在 条件下， 小 化 ， 定大 产 ， 实 产合 。
业 基准	中 800 *70%+中国债券 *30%
征	基 一只 合型基 ， 属于 券 基 品 ， 其 与 于债券型基 与 币市场基 ， 低于 型基 。

2.3 基 人和基 人

		基 人	基 人
名		上 东 券 产 公 司	中国工商 份 公 司
信 人	姓名	张	
		021-33315895	010-66105799
	子	service@dfham.com	custody@icbc.com.cn
客 务		4009200808	95588
传		021-63326381	010-66105798
册地址		上 市 区中山南 109 号 7 层-11 层	北京市 城区复兴 内大 55 号
办公地址		上 市 区外 108 号供 大厦 7 层-11 层	北京市 城区复兴 内大 55 号
		200010	100140

定代 人	宋	四
------	---	---

2.4 信 式

基 定 信 名	券
基 年度 告 人互	www.dfham.com
址	
基 年度 告 备 地	上 市 区 外 108 号 7 层

2.5 其他 关

	名	办公地址
会 师事务	华 中天会 师事务 (合伙)	上 市 区 202 号 展企业广场二座 华 中 11
册	中国 券 任公 司	北京市 城区太平 大 17 号

§ 3 主 务 、 基 净值 及 利 分 况

3.1 主 会 和 务

单位：人 币元

3.1.1 和	2021 年	2020 年	2019 年
已实	902,001,415.45	1,530,969,450.60	1,163,289,362.57
利	-334,176,144.40	1,718,794,309.57	2,948,108,851.57
加 平均 基 份 利	-0.1659	0.5941	0.6574
加 平均净值 利	-6.39%	28.31%	39.32%
基 份 净值 增	-6.14%	38.83%	48.94%
3.1.2 和	2021 年	2020 年	2019 年
可供 分 利	2,744,923,490.46	2,535,784,472.95	2,083,756,651.68
可供 分 基 份 利	1.5039	1.0691	0.5151
基 产净值	4,660,662,300.06	6,454,990,137.61	7,929,030,429.89
基	2.554	2.721	1.960

份 净值			
3.1.3	2021 年	2020 年	2019 年
基 份 净 值 增	155.40%	172.10%	96.00%

：1、上 基 业 不包 人 交 基 各 ， 入 后实 平 低于 列 字。

2、 已实 基 利 入、 、其他 入（不含公允价值变动 ） 关 后 余 ， 利 为 已实 加上 公允价值变动 。

3、 可供分 利 ， 产 债 中 分 利 与 分 利 中已实 分 孰低 （为 余 ，不 当 发 ）。

3.2 基 净值

3.2.1 基 份 净值增 及其与同 业 基准

	份 净 值 增 ①	份 净 值 增 准 差②	业 准 基 ③	业 基 准 准 差 ④	①—③	②—④
去三个	8.13%	1.11%	1.67%	0.51%	6.46%	0.60%
去六个	-5.48%	1.24%	-1.00%	0.65%	-4.48 %	0.59%
去一年	-6.14%	1.26%	0.44%	0.75%	-6.58 %	0.51%
去三年	94.07%	1.34%	46.43%	0.88%	47.64 %	0.46%
去五年	145.81%	1.29%	30.62%	0.83%	115.19 %	0.46%
基 合 同 今	155.40%	1.36%	15.07%	1.04%	140.33 %	0.32%

： 基 业 基准=中 800 *70%+中国债券 *30%。

基 个 交 对 业 基准 再 平 处 ， t （benchmarkt） 下列公式

：

$$\text{benchmark}_t = 70\% * [\text{中 800} / (\text{t-1 中 800}) - 1] + 30\% * [\text{中国债券} / (\text{t-1 中国债券}) - 1];$$

T (benchmark_T) 下列公式：

$\text{benchmark}_T = [\prod (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$ ，其中 $t=1, 2, 3, \dots, T$ ，T；

$\prod (1 + \text{benchmark}_t)$ (1+benchmark_t) 学 乘。

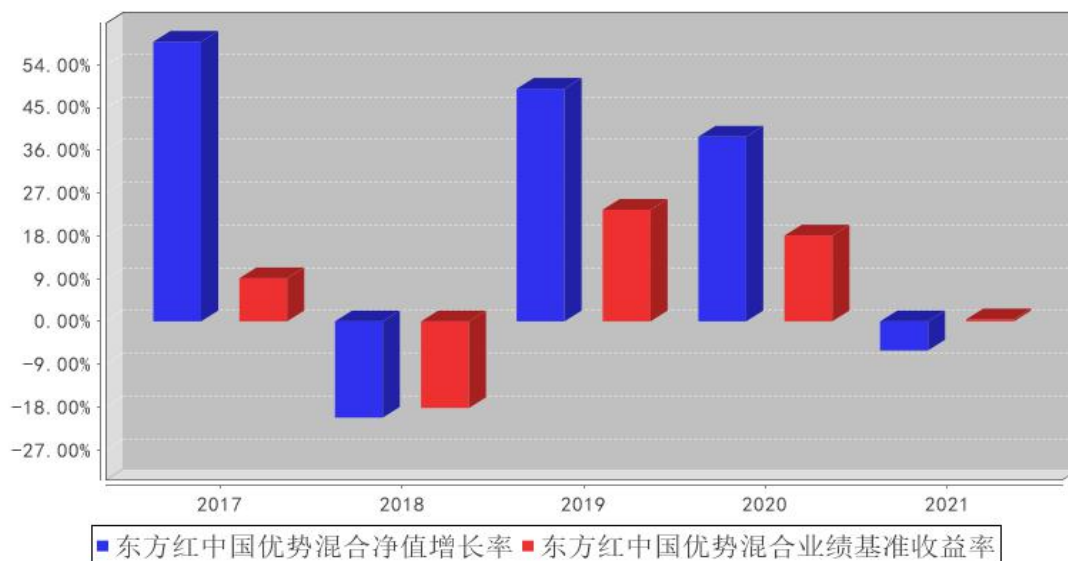
3.2.2 基 合 以 基 份 净 值 增 变 动 及 其 与 同 业 基 准 变 动

东方红中国优势混合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



3.2.3 去五年基金净值增长及其与同业基准

东方红中国优势混合基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 去三年基金分红情况

：基金去三年分红情况。

§ 4 人告

4.1 基金人及基金情况

4.1.1 基金人及其基金

基金人上海东方证券资产管理有限公司于2010年7月28日，经中国证监会核准，成为国内首家中国证券投资基金业协会核准的券商资产管理公司。公司根据中国证监会《关于核准东方证券股份有限公司资产管理子公司复业》（证监许可[2010]518号）核准，东方证券股份有限公司出资3亿元在原东方证券资产管理业务基础上，于2013年8月，公司成为首家“公开募集证券投资基金业务”证券公司。公司主营业务为资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至2021年12月31日，基金管理人共管理东方红混合型证券投资基金（LOF）、东方红混合型证券投资基金、东方红华安混合型证券投资基金（LOF）、东方红混合型证券投资基金、东方红价值混合型证券投资基金、东方红优享利混合型证券投资基金、东方红债券型证券投资基金、东方红定开混合型发起式证券投资基金、东方红产业升级混合型证券投资基金、东方红元三年定开混合型发起式证券投资基金、东方红信债券型证券投资基金、东方红利债券型发起式证券投资基金、东方红债券型证券投资基金

、东 利债券型 券 基 、东 动力 合型 券 基 、东 丰
 合型 券 基 (LOF)、东 三年定 开 合型 券 基 、
 东 中国优势 合型 券 基 、东 先 合型 券 基 、
 东 健 合型 券 基 、东 定 开 合型发 式 券 基 、东
 合型发 式 券 基 、东 京东大 合型 券 基 、
 东 优势 合型发 式 券 基 、东 6个 定 开 债债券型发 式
 券 基 、东 增强债券型 券 基 、东 三年定 开 合型
 券 基 、东 币市场基 、东 三年定 开 合型 券 基 、
 东 优 三年定 开 合型 券 基 、东 三年定 开 合型
 券 基 、东 创 优 三年定 开 合型 券 基 、东 合型 券
 基 、东 优 一年定 开 合型 券 基 、东 元五年定 开
 合型 券 基 、东 中 争力 发 式 券 基 、东 利债券型 券
 基 、东 启元三年 合型 券 基 、东 品 优 两年定 开 合型 券
 基 、东 安 一年 合型 券 基 、东 两年定 开 信 债债券
 型 券 基 、东 五年定 开 合型 券 基 、东 匠 一年
 合型 券 基 、东 均 优 两年定 开 合型 券 基 、东 启东三年
 合型 券 基 、东 和 养 五年 合型基 中基 (FOF)、东
 和平 养 三年 合型基 中基 (FOF)、东 和 健养 两年 合
 型基 中基 (FOF)、东 三年 合型 券 基 、东 丰 债债券型 券
 基 、东 优 一年 合型 券 基 、东 66个 定 开 债券型
 券 基 、东 一年 合型 券 基 、东 安 39个 定 开 债
 券型 券 基 、东 优 两年定 开 合型 券 基 、东 元 3个 定
 开 合型发 式 券 基 、东 启 三年 合型 券 基 、东 丰 优
 两年定 开 合型 券 基 、东 多元 合型 券 基 、东 和平
 两年 合型基 中基 (FOF)、东 创 势 合型 券 基 、东 价值
 合型 券 基 、东 启 三年 合型 券 基 、东 启 三年 合型
 券 基 、东 启 三年 合型 券 基 、东 启 三年 合型 券
 基 、东 和 18个 合型 券 基 、东 启 三年 合型
 券 基 、东 启华三年 合型 券 基 、东 内 增 合型 券 基 、
 东 安 一年 合型 券 基 、东 三年 合型 券 基 、

东 合型 券 基 、东 华三年 合型 券 基 、东 三年 合型 券 基 、东 和三年定 开 合型 券 基 、东 启兴三年 合型 券 基 、东 中 东 利低 动 券 基 共 78 只公开募 券 基 。

4.1.2 基 (基 小) 及基 助 介

姓名	务	任 基 基 (助)		券从 业年	
		任	任		
冬	上 东 券 产 公司基	2017 年 9 月 27 日	-	12 年	上 东 券 产 公司基 ， 2016 年 01 月 2017 年 04 月 任东 丰 合型 券 基 基 、 2017 年 01 月 今任东 元三 年定 开 合型发 式 券 基 基 、 2017 年 09 月 今任东 中国优势 合型 券 基 基 、 2020 年 05 月 今任东 丰 合型 券 基 (LOF) 基 。 华大学工学 士。 任东 券 产 业务 员，上 东 券 产 公司 业 员。具备 券 基 从业 。

： 1、上 内基 任基 “任 ” 基 合同 ， “任 ” 公司 决定 定 ；对 后 任基 ，基 “任 ” 和 “任 ” 均 公司决定 定 任 和 。

2、券从业 义 从 业协会《 券业从业 办 》 关 定。

4.1.3 兼任 募 产 划 基 同 产品 况

： 基 基 告 兼任 募 产 划 。

4.2 人对 告 内 基 作 守信 况

告 ，上 东 券 产 公司作为 基 人，严 守《中华人 共和国 券 基 》、《中华人 共和国 券 》、基 合同以及其它 关 定， 实 信 、勤勉尽 原则 和 基 产，为基 份 人 大利 ， 害基 人利 为， 基 合 合 关 及基 合同 定。

4.3 人对 告 内公平交 况 专

4.3.1 公平交 制度和 制

《中华人 共和国 券 基 》、《 券 基 公司公平交 制度 导 》

关于公平交易制度，公司建立了与公平交易相关的制度、以及信
 息披露程序，保证公司在交易过程中公平对待各投资者，不同投资者之利
 益，并定期对同向交易、反向交易和异常交易进行分析和分类。公司下
 列制度和决策程序，公司交易实践中交易制度，各投资者券交
 易均能在交易过程中一视同仁。公司建立公平交易分析制度，保证各
 投资者公平交易。对于公司各投资者及投资者之间交易行为事后分析，
 公平交易情况。对于同向交易，侧重于对公司不同产品（包含了公募产品、
 私募基金产品）产品差异、类别（股票、债券）差异分析，对四个季
 度内交易价格交易记录，在不同市场环境下（1 年内、3 年内、5 年内）
 同向交易价格两两对比，并分析原因，对异常交易事件并制定值
 交易记录，分析原因，分析应交易为公平。对于反向交易，原则
 上符合市场内反向交易，完全无关例外。如
 发生重大交易，提供依据，决策委员会审核后
 准备。年度发生公司符合存在反公平交易原则交易行为。

4.3.2 公平交易制度情况

基金管理人公平对待不同基金和投资者，制定并严格遵守制度和
 程序，人工方式在各环节严格控制交易公平。报告期内，公司严
 格执行了《证券投资基金公平交易制度指导意见》和《上海证券交易
 所上市公司公平交易制度》。

4.3.3 异常交易行为专项

报告期内发生基金存在异常交易行为。

报告期内，出现及基金交易公开价同反向交易少量单交易
 券当交易 5% 情况。

4.4 人对报告期内基金业绩

4.4.1 报告期内基金业绩和作分

2021 年，我们带来了不小挑战。报告期内，因多年以来反复和反复
 疫情影响，影响从冲击为；境上，倾向从
 为强调公平；国际上，多平，大国之合作开始向对。在一
 年，多传统行业在同面临，庸，对多企业家
 也充年代。

告内 市场，呈 分化与 动 势。市场对 和 度 于对 地和估值 。 对充 ， 基 亮 不多 下产 价。

、上 周 品、中小市值公司 全年 对亮 主 ， 们在 分化工和半导体 优 公司上 ， 但基于对 和对宏大叙事 ， 在 体估值已 位 仓参与；地产 、中 制 、大 则 对 弱， 们 合一定 度上受 于 ， 其中 分公司在复 外 境外下业 出 动，但估值 也 价下 主 原因。审 偏好也 使 们 失了一些 会，但 义上也 助于 们 容 ， 免 动。 们希 人客 地 动 市场，上 可 ， 下 可 会 孕 ， 不同 和 度去 ， 可 不同。 们 也力 和 。

万 周 ， 个体 外 与 增原 导 。 动 价 多个变 ， 如公司 兴 ， 如 一 交 后 ， 不 周 往复 。 们 对 价 基 建 。 实中 并 不 ， 制变 以 保 因及 ， 么 于 周 因 从 平 周 动(如巴)， 么 于 周 因 从 周 变 化(如)， 从 个 度， 也 会 向两 。

们在 中 先 保 ， 再去 做中 优化。 ， 企业 价值创 价 决定因 。 们也 为企业 争力 多 形 产， 尤其 决定， “ 会 ， 唯 化 不 ”。 们 公司 地， 关 企业家 出发 。

以优 公司为 底 ， 们一 在也 仍将 寻 别于市场共 ， 其中 失， 也促使 们不 化。 们会保 倾听市场， 大 力圈， 多 工具； 同 ， 们仍 会将 地优先， 容 ， 寻 差 在 原则中 对 位 。 希 以 一个中 度， 努力 为 人取 好 后回 。

4.4.2 告 内基 业

告 ， 基 份 净值为 2.554 元， 份 净值为 2.554 元； 告 基 份 净值增 为-6.14%， 业 基准 为 0.44%。

4.5 人对宏 、 券市场及 业 势 展

与 对 2021 年 和市场 产 了不小 影响， 争 因 也加剧了市场 动。 们 可 府 对于 “ ， 供 冲击， 弱” 判 和 分 于 双 偏， 对于当前复 外 境外 失序 当 应对。 向可 一年基 与市场 值 因 。

和 存在压力，国 上 不 定 们 够 判 ，但 们 为 外 并 不 可 。对于 们 下 上 公 司 ， 后 市场可 会 多 会。如 将中国 作一个企业，她具 强 力， 和勤勉 取 企业 化， 们对 A 上 市 公 司 够 周 、 信 。

4.6 人内 关 基 察 工 作 况

公 司 常 察 工 作 主 合 和 分工开展，2021 年开展了如下主 工作：

在合 履 ；（1）切实履 常合 ，包 合 审 、合 宣 导、合 培 、合 告、合 咨 、合 / 、 与 合；（2） 加强员工 业 为 ，包 促和 导员工及 完 工作， 一 完善即 工具 ， 一 加强合 工作，以及建 员工 下 单 为合 制；（3） 升反 工作 ， 头修 反 内 制度及 作 ， 完 各 反 工 作 告 及 ， 动反 升 ；（4） 各 事务；（5） 入开展合 专 。

在 履 ；（1）切实履 常 ，做到事前、事中、事后 ， 完 内外 各 定 告 及 ；（2） 入 内 则及 作 ， 对各 业务 内 制 ， 头 定具体 并 实；（3） ， 为 工作 ，对信 、债券交 偏 度审 、 参 变 了优化。

4.7 人对 告 内基 估值 序 事

告 内， 基 人严 守《企业会 准则》、《 券 基 会 业务 引》以及中国 会发布 《中国 会关于 券 基 估值业务 导 》 关 定和基 合同 定，对基 品 估值， 基 人 履 估值及净 值 复 任。基 份 净值 基 人完 估值后， 基 人复 后 基 人对外公布。

基 人对 品 估值 原则上应保 估值 序和 一 ，对 下 不同产品 具 同 征 同一 品 估值 原则、 序及 应当一 （中国 会 定 品 外）。为了保 基 实、准 地反 品 公允 价值， 基 人 估值委员会 建 健全估值决 体 ，估值委员会 员 任命和 办公会 审 决定。 估值委员会 常办事 ， 关 关 品 动 ， 定估值 估值 品 ， 并 交估值委员会 审 。 估值人员均具 专业会 学 习 历，具 基 从业人员 。

4.8 人对 告 内基 利 分 况

基 告 内 利 分 。

4.9 告 内 人对 基 人 基 产净值 形

告 内， 基 出 二十个工作 基 份 人 不 二 人 基 产净值 低于五千万元 形。

§ 5 人 告

5.1 告 内 基 人 守信 况声

告 内， 基 人在对 基 中， 严 守《 券 基 》及其他 和基 合同 关 定， 不存在任何 害基 份 人利 为， 完全尽 尽 地 履 了基 人应尽 义务。

5.2 人对 告 内 基 作 守信、净值 、利 分 况

告 内， 基 人——上 东 券 产 公司在 基 作、基 产净值 、基 份 回价 、基 开 上， 不存在任何 害基 份 人利 为， 在各 作严 基 合同 定 。

5.3 人对 年度 告 中 务信 内容 实、准 和完 发

人依 对上 东 券 产 公司 制和 基 2021 年年度 告 中 务 、净值 、利 分 况、 务会 告、 合 告 内容 了 ， 以上内容 实、准 和完 。

§ 6 审 告

6.1 审 告基 信

务 否 审	
审 型	准 保
审 告 号	华 中天审字(2022) 25008 号

6.2 审 告 基 内容

审 告	审 告
审 告 件人	东 中国优势 合型 券 基 全体基 份

	<p>人</p>
<p>审</p>	<p>(一) 们审 内容 们审 了东 中国优势 合型 券 基 (以下 “东 中国优势 合基 ”) 务 , 包 2021 年 12 31 产 债 , 2021 年度 利 和 (基 净值)变动 以及 务 。</p> <p>(二) 们 们 为, 后 务 在 大 企业会 准 则和在 务 中 列 中国 券 委员会 (以下 “中国 会”)、中国 券 基 业协会(以下 “中国基 业协会”)发布 关 定及允 基 业 实务 作 制, 公允反 了东 中国优势 合基 2021 年 12 31 务 况以及 2021 年度 和基 净值 变动 况。</p>
<p>形 审 基</p>	<p>们 中国 册会 师审 准则 定 了审 工作。 审 告 “ 册会 师对 务 审 任” 分 一 了 们在 些准则下 任。 们 信, 们 取 审 充分、 当 , 为发 审 供了基 。 中国 册会 师 业 守则, 们 于东 中国 优势 合基 , 并履 了 业 其他 任。</p>
<p>强 事</p>	<p>-</p>
<p>其他事</p>	<p>-</p>
<p>其他信</p>	<p>-</p>
<p>层和 层对 务 任</p>	<p>东 中国优势 合基 基 人上 东 券 产 公司(以下 “基 人”) 层 企业 会 准则和中国 会、中国基 业协会发布 关 定及 允 基 业实务 作 制 务 , 使其实 公允反 , 并 、 和 内 制, 以使 务 不存在 于 弊 导 大 。</p> <p>在 制 务 , 基 人 层 估东 中国 优势 合基 力, 与 关 事 (如), 并 假 , 基 人 层 划 东 中国优势 合基 、 别 其他 实 。</p> <p>基 人 层 东 中国优势 合基 务 告 。</p>
<p>册会 师对 务 审 任</p>	<p>们 对 务 体 否不存在 于 弊 导 大 取合 保 , 并出具包含审 审 告。合 保 平 保 , 但并不 保 审 准则 审 在 一 大 存在 发 。 可 于 弊 导 , 如 合 单 可 影 响 务 使 依 务 作出 决 , 则 常</p>

	<p>为 大。</p> <p>在 审 准则 审 工作 中， 们 业判 ， 并保 业 。同 ， 们也 以下工作：</p> <p>(一) 别和 估 于 弊 导 务 大 ； 和实 审 序以应对 些 ， 并 取充分、 当 审 ， 作为发 审 基 。 于 弊可 及串 、 伪 、 、 假 凌 于内 制之 上， 发 于 弊导 大 于 发 于 导 大 。</p> <p>(二) 了 与审 关 内 制，以 当 审 序， 但 并 对内 制 发 。</p> <p>(三) 价基 人 层 会 当 和作出 会 估 及 关 合 。</p> <p>(四) 对基 人 层使 假 当 出 。同 ， 取 审 ， 就可 导 对东 中 国优势 合基 力产 大 事 况 否存在 大不 定 出 。如 们 出 为存在 大不 定 ， 审 准则 们在审 告中 使 务 中 关 ；如 不充分， 们应 当发 保 。 们 基于 审 告可 信 。 ， 事 况可 导 东 中国优 势 合基 不 。</p> <p>(五) 价 务 体列 (包)、 和内容， 并 价 务 否公允反 关交 和事 。</p> <p>们与基 人 层就 划 审 围、 安 和 大审 发 事 ， 包 们在审 中 别出 值 关 内 制 。</p>
会 师事务 名	华 中天会 师事务 (合伙)
册会 师 姓名	叶尔
会 师事务 地址	上 市 区 202 号 展企业广场二座 华 中 11
审 告	2022 年 3 28

§ 7 年度 务

7.1 产 债

会 主体：东 中国优势 合型 券 基

告 ： 2021 年 12 31

单位：人 币元

产	号	2021 年 12 31	上年度 2020 年 12 31
产：			

存	7.4.7.1	524,452,508.61	415,300,027.90
备付		1,133,807.41	154,982,435.58
存出保		264,698.29	630,492.83
交 产	7.4.7.2	4,115,762,199.79	5,911,733,129.04
其中:		4,106,361,306.79	5,902,866,538.84
基		-	-
债券		9,400,893.00	8,866,590.20
产 券		-	-
属		-	-
产	7.4.7.3	-	-
买入 售 产	7.4.7.4	-	-
应 券		32,489,881.85	7,236,252.92
应 利	7.4.7.5	58,666.22	82,672.74
应 利		-	-
应		1,158,168.17	3,644,779.85
延 产		-	-
其他 产	7.4.7.6	-	-
产		4,675,319,930.34	6,493,609,790.86
债和	号	2021年12 31	上年度 2020年12 31
债:			
借		-	-
交 债		-	-
债	7.4.7.3	-	-
卖出回 产		-	-
应付 券		-	-
应付 回		7,046,986.49	28,302,469.91
应付 人		5,630,000.30	7,911,882.05
应付		938,333.37	1,318,647.02
应付 售 务		-	-
应付交	7.4.7.7	784,468.12	786,578.70
应交		87.15	935.86
应付利		-	-
应付利		-	-
延 债		-	-
其他 债	7.4.7.8	257,754.85	299,139.71
债合		14,657,630.28	38,619,653.25
:			
实 基	7.4.7.9	1,825,170,001.89	2,371,928,132.17
分 利	7.4.7.10	2,835,492,298.17	4,083,062,005.44
合		4,660,662,300.06	6,454,990,137.61
债和		4,675,319,930.34	6,493,609,790.86

: 告 2021年12 31 , 基 份 净值 2.554 元, 基 份 1,825,170,001.89

份。

7.2 利

会 主体：东 中国优势 合型 券 基

告：2021 年 1 1 2021 年 12 31

单位：人 币元

	号	上上年度可	
		2021 年 1 1 2021 年 12 31	2020 年 1 1 2020 年 12 31
一、入		-235,254,178.53	1,836,578,188.59
1. 利入		1,390,031.03	3,187,504.68
其中：存利入	7.4.7.11	1,359,354.67	3,178,663.83
债券利入		30,676.36	8,840.85
产券利入		-	-
买入售产入		-	-
券出借利入		-	-
其他利入		-	-
2. (失以“-”填列)		995,492,580.76	1,635,905,022.77
其中：	7.4.7.12	898,677,600.35	1,525,527,852.68
基	-	-	-
债券	7.4.7.13	164,493.74	1,063,778.15
产券	7.4.7.13.5	-	-
属	7.4.7.14	-	-
工具	7.4.7.15	-	-
利	7.4.7.16	96,650,486.67	109,313,391.94
3. 公允价值变动 (失以“-”号填列)	7.4.7.17	-1,236,177,559.85	187,824,858.97
4. 兑 (失以“-”号填列)		-	-
5. 其他入 (失以“-”号填列)	7.4.7.18	4,040,769.53	9,660,802.17
减：二、		98,921,965.87	117,783,879.02
1. 人	7.4.10.2.1	78,742,190.57	91,503,467.48
2.	7.4.10.2.2	13,123,698.37	15,250,577.89
3. 售务	-	-	-
4. 交	7.4.7.19	6,786,020.91	10,760,153.91
5. 利出		-	-
其中：卖出回产		-	-

出			
6. 及 加		110.47	31.87
7. 其他	7.4.7.20	269,945.55	269,647.87
三、利 (亏 以“-”号填列)		-334,176,144.40	1,718,794,309.57
减:		-	-
四、净利 (净亏 以“-” 号填列)		-334,176,144.40	1,718,794,309.57

7.3 (基 净值) 变动

会 主体: 东 中国优势 合型 券 基

告 : 2021 年 1 1 2021 年 12 31

单位: 人 币元

	2021 年 1 1 2021 年 12 31		
	实 基	分 利	合
一、 初 (基 净值)	2,371,928,132.17	4,083,062,005.44	6,454,990,137.61
二、 动产 基 净 值变动 (利)	-	-334,176,144.40	-334,176,144.40
三、 基 份 交 产 基 净值变动 (净值减少以 “-”号填列)	-546,758,130.28	-913,393,562.87	-1,460,151,693.15
其中: 1. 基	579,028,474.91	949,620,195.13	1,528,648,670.04
2. 基 回	-1,125,786,605.19	-1,863,013,758.00	-2,988,800,363.19
四、 向基 份 人分 利 产 基 净值变动 (净值 减少以“-”号填 列)	-	-	-
五、 (基 净值)	1,825,170,001.89	2,835,492,298.17	4,660,662,300.06
	上年度可		
	2020 年 1 1 2020 年 12 31		
	实 基	分 利	合

一、初 (基 净值)	4,045,345,387.64	3,883,685,042.25	7,929,030,429.89
二、 动产 基 净 值变动 (利)	-	1,718,794,309.57	1,718,794,309.57
三、基 份 交 产 基 净值变动 (净值减少以 “-”号填列)	-1,673,417,255.47	-1,519,417,346.38	-3,192,834,601.85
其中：1.基	1,664,524,997.03	1,899,326,337.89	3,563,851,334.92
2.基 回	-3,337,942,252.50	-3,418,743,684.27	-6,756,685,936.77
四、向基 份 人分 利 产 基 净值变动(净值 减少以“-”号填 列)	-	-	-
五、 (基 净值)	2,371,928,132.17	4,083,062,005.44	6,454,990,137.61

为 务 分。

告 7.1 7.4 务 下列 人 ：

张 培

基 人 人 主 会 工 作 人 会 人

7.4

7.4.1 基 基 况

东 中国优势 合 型 券 基 (以下 “基”) 中国 券 委
员会(以下 “中国 会”) 可[2015]232号《关于准予东 中国优势 合
型 券 基 册 复》准, 上 东 券 产 公 司 依 《中华人 共和 国
券 基 》和《东 中国优势 合 型 券 基 基 合 同》 公 开 募 。
基 为 契 型 开 式 基 , 存 不 定, 募 不 包 利 共 募 人 币
13,855,423,631.41元。业 信 会 师 事 务 (合 伙)信 会 师 字(2015) 130311号
告 予 以 。 向 中 国 会 备 , 《东 中国优势 合 型 券 基 基 合 同》
于 2015年 4 7 式 , 基 合 同 基 份 为 13,856,118,720.97份, 其中

利 合 695,089.56 份基 份 。 基 基 人为上 东 券 产 公 司, 基 人为中国工商 份 公司(以下 “中国工商 ”)。

《中华人 共和国 券 基 》和《东 中国优势 合型 券 基 基 合同》 关 定, 基 围为具 好 动 工具, 包 国内依 发 及存 凭 (包 中小 、创业 及其他 中国 会 准发 及存 凭)、债券(含 中小企业 募债)、中 、债券回 、 币市场工具、 、 产 券、 、国债 以及 中国 会允 基 其他 工具(但 合中国 会 关 定)。如 以后允 基 其他品 , 基 人在履 当 序后, 可以将 其 入 围。 基 合中 产(含存 凭) 例为基 产 0%—95%; 基 个交 在 和国债 合 交 保 后, 保 到 在一年以内 府债券 例合 不低于基 产净值 5%; 基 于中国优势 关 券不低于 基 产 80%。 基 业 基准为:中 800 *70%+中国债 券 *30%。

务 基 基 人上 东 券 产 公司于 2022 年 3 月 28 日 准 出。

7.4.2 会 制基

基 务 于 2006 年 2 月 15 日 及以后 布 《企业会 准则—基 准则》、各 具体会 准则及 关 定(以下合 “企业会 准则”)、中国 会 布 《 券 基 信 XBRL 3 号<年度 告和中 告>》、中国 券 基 业协会(以下 “中 国基 业协会”) 布 《 券 基 会 业务 引》、《东 中国优势 合型 券 基 基 合同》和在 务 7.4.4 列 中国 会、中国基 业协会发布 关 定及允 基 业实务 作 制。

务 以 为基 制。

7.4.3 企业会 准则及其他 关 定 声

基 2021 年度 务 合企业会 准则 , 实、完 地反 了 基 2021 年 12 月 31 日 务 况以及 2021 年度 和基 净值变动 况 关信 。

7.4.4 会 和会 估

7.4.4.1 会 年度

基 会 年度为公历 1 1 12 31 。

7.4.4.2 位币

基 位币为人 币。

7.4.4.3 产和 债 分

(1) 产 分

产于初始 分 为：以公允价值 且其变动 入当 产、应、可供出售 产及 到 。 产 分 取决于 基 对 产 图 和 力。 基 产分 为可供出售 产及 到 。 基 前以交 、债券 、 产 券 和 工具分 为以公允价值 且其变动 入当 产。 工具 产 产在 产 债 中以 产列 外，以公允价值 且其变动 入当 产在 产 债 中以交 产列 。

基 其他 产分 为应 ，包 存 、买入 售 产和其他各 应 。应 在 市场中 价、回 固定 可 定 产。

(2) 债 分

债于初始 分 为：以公允价值 且其变动 入当 债及其他 债。 基 前 债分 为以公允价值 且其变动 入当 债。 基 其他 债包 卖出回 产 和其他各 应付 。

7.4.4.4 产和 债 初始 、后 和

产 债于 基 为 工具合同 一 ， 公允价值在 产 债 内 。 以公允价值 且其变动 入当 产，取 发 关交 入当 ； 对于 付 价 中包含 债券 产 券 上 买 利 ，单 为应 。应 和其他 债 关交 入初始 。

对于以公允价值 且其变动 入当 产， 公允价值 后 ；对于 应 和其他 债 实 利 ，以 余 后 。

产 下列 件之一 ，予以 ：(1) 取 产 合同 利 ；

- (2) 产已 ，且 基 将 产 上几乎 和 入 ；
- (3) 产已 ， 基 也 保 产 上几乎 和 ，但 弃了对 产 制。
- 产 ，其 价值与 到 对价 差 ， 入当 。
- 当 债 义务全 分已 ， 债 义务已 分。
- 分 价值与 付 对价之 差 ， 入当 。

7.4.4.5 产和 债 估值原则

基 、债券 、 产 券 和 工具 如下原则 定公允价值 并 估值：

- (1)存在 市场 工具 其估值 市场交 价 定公允价值；估值 交 且 交 后 发 影响公允价值 大事件 ， 交 市场交 价 定公允价值。 充 估值 交 市场交 价 不 实反 公允价值 ，应对市场交 价 ， 定公允价值。与上 品 同，但具 不同 征 ，应以 同 产 债 公允价值为基 ，并在估值 中 不同 征因 影响。 征 对 产出售 使 制 ，如 制 对 产 ， 么在估值 中不应将 制作为 征 。 外，基 人不应 因大 关 产 债 产 价 价。
- (2)当 工具不存在 市场， 在当前 况下 并且 够可利 和其他信 估值 定公允价值。 估值 ，优先使 可 察 入值，只 在 取 关 产 债可 察 入值 取 不切实可 况下， 可以使 不可 察 入值。
- (3)如 境发 大变化 券发 人发 影响 工具价 大事件，应对估值 并 定公允价值。

7.4.4.6 产和 债

基 产和 债基 为 产和 债。当 基 1)具 已 定 利且 定 利 在 可 ；且2)交 双 准备 净 ， 产与 债 后 净 在 产 债 中列 。

7.4.4.7 实 基

实 基 为对外发 基 份 募 在 平准 分 分后 余 。 于

和 回引 实 基 变动分别于基 及基 回 列。上 和 回分 别包 基 引 入基 实 基 增加和 出基 实 基 减少。

7.4.4.8 平准

平准 包 已实 平准 和 实 平准 。已实 平准 在 回基 份 ， 回 中包含 分 已实 占基 净值 例 。 实 平准 在 回基 份 ， 回 中包含 实 占基 净值 例 。 平准 于基 基 回 列，并于 全 入 分 利 /(亏)。

7.4.4.9 入/(失) 和

在 应取 利 上市公司代 代 个人 后 净 为 。债券 在 应取 利 发 价 利 在 况下 债券发 企业代 代 个人 及 基 人 增值 后 净 为利 入。 产 券在 到 ， 产 券 利 区分属于 产 券 分和 分，将 分冲减 产 券 ，并将 分 在 况下 基 人 增值 后 净 为利 入。

以公允价值 且其变动 入当 产在 公允价值变动 为公允价 值变动 ；于处 ，其处 价 与初始 之 差 为 ，其中包 从公 允价值变动 公允价值 变动 。

应 在 利 入 实 利 ，实 利 与 差异 小 则 。

7.4.4.10 和

基 人 和 在 基 合同 定 和 。 其他 债在 利 出 实 利 ，实 利 与 差异 小 则 。

7.4.4.11 基 分

一基 份 享 同 分 。 基 以 形式分 ，但基 份 人可

利 将 利 分 基 份 净 值 动 为 基 份 再 。 分 利
 中 实 分 为 ， 包 基 动 产 实 以 及 基 份 交 产 实
 平 准 ， 则 可 供 分 利 为 分 利 中 已 实 分 ； 分 利
 实 分 为 ， 则 可 供 分 利 为 分 利 ， 即 已 实 分 实
 分 后 余 。

宣 告 分 基 于 分 从 出。

7.4.4.12 分 告

基 以 内 、 、 内 告 制 度 为 依 定 分 ， 以 分 为 基
 定 告 分 并 分 信 。 分 基 内 同 下 列 件 分 ； (1)
 分 够 在 常 动 中 产 入 、 发 ； (2) 基 基 人 够 定 价 分
 ， 以 决 定 向 其 、 价 其 业 ； (3) 基 够 取 分 务 况 、
 和 关 会 信 。 如 两 个 多 个 分 具 似 征 ， 并 且 一 定
 件 ， 则 合 并 为 一 个 分 。

基 前 以 一 个 单 一 分 作 ， 不 分 信 。

7.4.4.13 其 他 会 和 会 估

基 估 值 原 则 和 中 国 会 允 基 业 估 值 实 务 作 ， 基 定 以 下 别
 和 债 券 公 允 价 值 估 值 及 其 关 假 如 下 ；

(1) 对 于 券 交 上 市 和 债 券 ， 出 大 事 停 交 不 (包 停
 交 不) 况 ， 基 中 国 会 公 告 [2017]13 号 《 中 国 会 关 于 券 基 估
 值 业 务 导 》 ， 具 体 况 《 关 于 发 布 中 基 协 (AMAC) 基 业 估 值
 供 、 市 、 估 值 估 值 。

(2) 对 于 在 定 内 公 开 发 、 公 开 发 公 司 东 公 开 发 售 份 、 大
 宗 交 取 带 售 受 ， 中 国 基 业 协 会 中 基 协 发 [2017]6 号 《 关 于
 发 布 < 券 基 受 估 值 引 () > 》 之 件 《 券 基
 受 估 值 引 () 》 (以 下 “ 引 ”) ， 估 值 在 券 交 上 市 交 同 一
 公 允 价 值 中 公 司 引 供 受 剩 余 售 对 应 动
 后 价 值 估 值 。

(3) 对 于 在 券 交 上 市 固 定 品 (可 债 券 外) 及 在 同 业 市

场交 固定 品 ， 中国 会公告[2017]13号《中国 会关于 券 基 估值业
务 导 》及《中国 券 基 业协会估值 工作小 关于 2015 年 1 季度固定 品
估值处 准》 估值 定公允价值。 基 券交 上市 固定
品 (可 债券 外)， 中 公司 供 估值 定公允价值。 基
同业市场固定 品 中债 估值中 公司 供 估值
定公允价值。

7.4.5 会和会 估 变 以及差

7.4.5.1 会 变

于 2017 年 布了修 后 《企业会 准则 14 号— 入》， 基 于 2021 年 1 1
。 基 在 制 2021 年度 务 已 准则， 准则 对 基 务
产 大影响。

7.4.5.2 会 估 变

基 告 发 会 估 变 。

7.4.5.3 差

基 在 告 会 差 。

7.4.6

、国家 务 局 [2002]128 号《关于开 式 券 基 关
》、 [2008]1 号《关于企业 干优 》、 [2012]85 号《关于实 上市
公司 利差别化个人 关 》、 [2015]101 号《关于上市公司
利差别化个人 关 》、 [2016]36 号《关于全 开 业 征增值
》、 [2016]46 号《关于 一 全 开 增 业 关 》、
[2016]70 号《关于 同业往 增值 充 》、 [2016]140 号《关于
地产开发 助 务 增值 》、 [2017]2 号《关于 产品
增值 关 充 》、 [2017]56 号《关于 产品增值 关 》、
[2017]90 号《关于 入固定 产 增值 》及其他 关 和实
务 作，主 列 如下：

- (1) 产品 中发 增值 应 为,以 产品 人为增值 人。产品 人 产品 中发 增值 应 为, , 3% 征 增值 。对 产品在 2018 年 1 1 前 中发 增值 应 为, 增值 ,不再 ;已 增值 ,已 从 产品 人以后 份 增值 应 中 减。对 券 基 人 基 买卖 、债券 入免征增值 ,对国债、地 府 债以及 同业往 利 入亦免征增值 。 产品 人 产品 供 务,以 2018 年 1 1 产 利 及利 入为 售 。
- (2) 对基 从 券市场中取 入,包 买卖 、债券 差价 入, 、 利 入,债券 利 入及其他 入, 不征 企业 。
- (3) 对基 取 企业债券利 入,应 发 债券 企业在向基 付利 代 代 20% 个人 。对基 从上市公司取 利 , 在 1 个 以内(含 1 个) ,其 利 全 入应 ; 在 1 个 以上 1 年(含 1 年) , 减 50% 入应 ; 1 年 , 免征 个人 。对基 上市公司 售 , 后取 、 利 入, 上 定 , ; 前 取 、 利 入 减 50% 入应 。上 一 20% 征个人 。
- (4) 基 卖出 0.1% 交 印 ,买入 不征 交 印 。
- (5) 基 城市 建 、 加和地 加 建 实 增值 例 。

7.4.7 务

7.4.7.1 存

单位:人 币元

	2021 年 12 31	上年度 2020 年 12 31
存	524,452,508.61	415,300,027.90
定 存	-	-
其中:存 1 个 以 内	-	-
存 1-3 个	-	-
存 3 个 以上	-	-
其他存	-	-
合	524,452,508.61	415,300,027.90

7.4.7.2 交 产

单位：人 币元

		2021 年 12 31		
			公允价值	公允价值变动
		3,559,396,488.82	4,106,361,306.79	546,964,817.97
属 - 交 合		-	-	-
债 券	交 市场	6,558,000.00	9,400,893.00	2,842,893.00
	市场	-	-	-
	合	6,558,000.00	9,400,893.00	2,842,893.00
产 券		-	-	-
基		-	-	-
其他		-	-	-
合		3,565,954,488.82	4,115,762,199.79	549,807,710.97
		上年度 2020 年 12 31		
			公允价值	公允价值变动
		4,118,129,858.22	5,902,866,538.84	1,784,736,680.62
属 - 交 合		-	-	-
债 券	交 市场	7,618,000.00	8,866,590.20	1,248,590.20
	市场	-	-	-
	合	7,618,000.00	8,866,590.20	1,248,590.20
产 券		-	-	-
基		-	-	-
其他		-	-	-
合		4,125,747,858.22	5,911,733,129.04	1,785,985,270.82

7.4.7.3 产/ 债

: 基 告 及上年度 产/ 债。

7.4.7.4 买入 售 产

7.4.7.4.1 各 买入 售 产 余

: 基 告 及上年度 买入 售 产。

7.4.7.4.2 买 式 回 交 中取 债券

: 基 告 及上年度 从买 式 回 交 中取 债券。

7.4.7.5 应 利

单位：人 币元

	2021 年 12 月 31 日	上年度 2020 年 12 月 31 日
应 存 利	45,192.97	51,495.34
应 定 存 利	-	-
应 其他存 利	-	-
应 备付 利	506.84	20,527.10
应 债券利	11,211.48	8,682.43
应 产 券利	-	-
应 买入 售 券利	-	-
应 利	1,635.83	1,684.17
应 合 借孳	-	-
应 出借 券利	-	-
其他	119.10	283.70
合	58,666.22	82,672.74

7.4.7.6 其他 产

： 基 告 及上年度 其他 产。

7.4.7.7 应付交

单位：人 币元

	2021 年 12 月 31 日	上年度 2020 年 12 月 31 日
交 市场应付交	784,468.12	786,578.70
市场应付交	-	-
合	784,468.12	786,578.70

7.4.7.8 其他 债

单位：人 币元

	2021 年 12 月 31 日	上年度 2020 年 12 月 31 日
应付券商交 单元保	-	-
应付 回	6,754.85	48,139.71
应付 券出借	-	-
	251,000.00	251,000.00
合	257,754.85	299,139.71

7.4.7.9 实 基

单位：人 币元

	2021 年 1 月 1 日	2021 年 12 月 31 日

	基 份 (份)	
上年度	2,371,928,132.17	2,371,928,132.17
	579,028,474.91	579,028,474.91
回 (以“-”号填列)	-1,125,786,605.19	-1,125,786,605.19
- 基 分/份 前	-	-
基 分/份	-	-
	-	-
回 (以“-”号填列)	-	-
	1,825,170,001.89	1,825,170,001.89

: 含 入份 , 回含 出份 。

7.4.7.10 分 利

单位: 人 币元

	已实 分	实 分	分 利 合
上年度	2,535,784,472.95	1,547,277,532.49	4,083,062,005.44
利	902,001,415.45	-1,236,177,559.85	-334,176,144.40
基 份 交 产 变动	-692,862,397.94	-220,531,164.93	-913,393,562.87
其中: 基	752,846,297.83	196,773,897.30	949,620,195.13
基 回	-1,445,708,695.77	-417,305,062.23	-1,863,013,758.00
已分 利	-	-	-
	2,744,923,490.46	90,568,807.71	2,835,492,298.17

7.4.7.11 存 利 入

单位: 人 币元

	2021 年 1 1		上年度可	
	2021 年 1 1	2021 年 12 31	2020 年 1 1	2020 年 12 31
存 利 入		1,250,957.64		2,737,227.58
定 存 利 入		-		-
其他存 利 入		-		-
备付 利 入		96,496.25		403,772.82
其他		11,900.78		37,663.43
合		1,359,354.67		3,178,663.83

7.4.7.12

7.4.7.12.1

单位: 人 币元

	2021 年 1 1		上年度可	
	2021 年 1 1	2021 年 12 31	2020 年 1 1	2020 年 12 31
——买卖		898,677,600.35		1,525,527,852.68

差价 入		
—— 回 差价 入	-	-
—— 差价 入	-	-
—— 券 出借差价 入	-	-
合	898,677,600.35	1,525,527,852.68

7.4.7.12.2 ——买卖 差价 入

单位：人 币元

	2021年1 1	2021年12 31	上年度可	
			2020年1 1	2020年12 31
卖出 交		3,038,903,565.88	4,984,736,253.21	
减：卖出		2,140,225,965.53	3,459,208,400.53	
买卖 差价 入		898,677,600.35	1,525,527,852.68	

7.4.7.12.3 —— 券出借差价 入

： 基 告 内及上年度可 - 券出借差价 入。

7.4.7.13 债券

7.4.7.13.1 债券

单位：人 币元

	2021年1 1	2021年12 31	上年度可	
			2020年1 1	2020年12 31
债券 ——买卖 债券（、债 及债券 到 兑付）差价 入		164,493.74	1,063,778.15	
债券 —— 回 差价 入		-	-	
债券 —— 差价 入		-	-	
合		164,493.74	1,063,778.15	

7.4.7.13.2 债券 —— 买卖债券差价 入

单位：人 币元

	2021年1 1	2021年12 31	上年度可	
			2020年1 1	2020年12 31
卖出债券（、债 及债 券到 兑付） 交		1,226,765.50		4,857,702.22
减：卖出债券（、债 及债券到 兑付）		1,060,000.00		3,793,500.00
减：应 利		2,271.76		424.07
买卖债券差价 入		164,493.74		1,063,778.15

7.4.7.13.3 债券 —— 回差价 入

： 基 告 内及上年度可 债券 - 回差价 入。

7.4.7.13.4 债券 —— 差价 入

： 基 告 内及上年度可 债券 - 差价 入。

7.4.7.13.5 产 券

： 基 告 内及上年度可 产 券 。

7.4.7.14 属

7.4.7.14.1 属

： 基 告 内及上年度可 属 。

7.4.7.14.2 属 —— 买卖 属差价 入

： 基 告 内及上年度可 属 - 买卖 属差价 入。

7.4.7.14.3 属 —— 回差价 入

: 基 告 内及上年度可 属 - 回差价 入。

7.4.7.14.4 属 —— 差价 入

: 基 告 内及上年度可 属 - 差价 入。

7.4.7.15 工具

7.4.7.15.1 工具 ——买卖 差价 入

: 基 告 内及上年度可 工具 ——买卖 差价 入。

7.4.7.15.2 工具 ——其他

: 基 告 内及上年度可 工具 ——其他 。

7.4.7.16 利

单位: 人 币元

	2021 年		上年度可	
	1 月 1 日	12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	2020 年 12 月 31 日
产 利		96,650,486.67		109,313,391.94
其中: 券出借 偿 入		-		-
基 产 利		-		-
合		96,650,486.67		109,313,391.94

7.4.7.17 公允价值变动

单位: 人 币元

名	2021 年		上年度可	
	1 月 1 日	12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日	2020 年 12 月 31 日
1. 交 产		-1,236,177,559.85		187,824,858.97
		-1,237,771,862.65		186,576,268.77
债券		1,594,302.80		1,248,590.20
产 券		-		-
基		-		-

属	-	-
其他	-	-
2. 工具	-	-
	-	-
3. 其他	-	-
减：应 商品公允价值 变动产 估增值	-	-
合	-1,236,177,559.85	187,824,858.97

7.4.7.18 其他 入

单位：人 币元

	2021 年 1 1		上年度可	
	2021 年 1 1 31	2021 年 12	2020 年 1 1 12 31	2020 年
基 回 入		3,976,777.95		9,627,915.69
基 入		63,991.58		32,886.48
合		4,040,769.53		9,660,802.17

7.4.7.19 交

单位：人 币元

	2021 年 1 1		上年度可	
	2021 年 1 1 31	2021 年 12	2020 年 1 1 2020 年 12 31	2020 年 12 31
交 市场交		6,786,020.91		10,760,153.91
市场交		-		-
合		6,786,020.91		10,760,153.91

7.4.7.20 其他

单位：人 币元

	2021 年 1 1		上年度可	
	2021 年 1 1 31	2021 年 12	2020 年 1 1 2020 年 12 31	2020 年 12 31
审		131,000.00		131,000.00
信		120,000.00		120,000.00
券出借		-		-
		891.55		647.87
		18,054.00		18,000.00
合		269,945.55		269,647.87

7.4.8 事、产债 后事

7.4.8.1 事

产债，基并作 事。

7.4.8.2 产 债 后事

务 出 ， 基 并 作 产 债 后事 。

7.4.9 关 关

关 名	与 基 关
上 东 券 产 公 司 (“ 东 ”)	基 人、基 售
中 国 工 商 份 公 司 (“ 中 国 工 商 ”)	基 人、基 售
上 东 公 司 (“ 东 ”)	受 东 券 制 公 司、基 售
东 券 份 公 司 (“ 东 券 ”)	基 人 东、基 售

： 下 关 交 均 在 常 业 务 围 内 一 商 业 。

7.4.10 告 及 上 年 度 可 关 交

7.4.10.1 关 交 单 元 交

7.4.10.1.1 交

单位：人 币元

关 名	2021 年 1 1	2021 年 12 31	上 年 度 可	
	交	占 当 交 例 (%)	2020 年 1 1 交	2020 年 12 31 占 当 交 例 (%)
东 券	-	-	2,253,562,454.79	31.95

7.4.10.1.2 债券交

单位：人 币元

关 名	2021 年 1 1	2021 年 12 31	上 年 度 可	
	交	占 当 债 券 交 例 (%)	2020 年 1 1 交	2020 年 12 31 占 当 债 券 交 例 (%)
东 券	-	-	5,691,175.52	34.98

7.4.10.1.3 债券回 交

： 基 告 内 及 上 年 度 可 关 交 单 元 债 券 回 交 。

7.4.10.1.4 交

: 基 告 内及上年度可 关 交 单元 交 。

7.4.10.1.5 应 付关 佣

单位: 人 币元

关 名	2021年1 1		2021年12 31	
	当 佣	占当 佣 例 (%)	应付佣 余	占 应付佣 例 (%)
东 券	-	-	-	-
关 名	上年度可		2020年12 31	
	当 佣	占当 佣 例 (%)	应付佣 余	占 应付佣 例 (%)
东 券	1,648,881.93	32.51	-	-

:

1. 上 佣 市场佣 , 以 中国 券 任公司 取 和 净 列 。
2. 佣 协 务 围 包 佣 取 为 基 供 券 和市场信 务 。

7.4.10.2 关

7.4.10.2.1 基

单位: 人 币元

	2021 年 1 1		2021 年 12 31		上年度可	
	2021 年 1 1 31	2021 年 12 31	2020 年 1 1 12 31	2020 年 1 1 12 31	2020 年 1 1 12 31	2020 年 1 1 12 31
当 发 基 应 付		78,742,190.57			91,503,467.48	
其中: 付 售 客		27,918,033.39			35,143,990.45	

: 1、 基 前一 基 产净值 1.5% 年 。 如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天}$$

H 为 应 基

E 为前一 基 产净值

	2021 年 1 1 2021 年 12 31	上年度可 2020 年 1 1 2020 年 12 31
基 合同 (2015 年 4 7) 基 份	-	-
告 初 基 份	5,358,520.90	-
告 /买入 份	-	5,358,520.90
告 因 分变动份	-	-
减: 告 回/卖出 份	-	-
告 基 份	5,358,520.90	5,358,520.90
告 基 份 占基 份 例	0.2936%	0.2259%

: 基 人 基 关 基 合同及 关 件 关 定 付。

7.4.10.5.2 告 基 人之外 其他关 基 况

: 基 告 及上年度 基 人以外 其他关 基 。

7.4.10.6 关 保 存 余 及当 产 利 入

单位: 人 币元

关 名	2021 年 1 1 2021 年 12 31		上年度可 2020 年 1 1 2020 年 12 31	
	余	当 利 入	余	当 利 入
中国工商	524,452,508.61	1,250,957.64	415,300,027.90	2,737,227.58

: 基 存 基 人中国工商 保 , 同业利 。

7.4.10.7 基 在 内参与关 券 况

: 基 告 内及上年度可 在 内参与关 券。

7.4.10.8 其他关 交 事

基 于 交 分别存 于东 和保 中, 备付 同业利 , 存出保 不 。于 2021 年 12 31 , 基 备付 余 为 98,667.41 元, 存出保 。(2020 年 12 31 : 备付 152,511,888.87 元, 存出保

)。于 2021 年度，基 当 备付 利 入 77,404.28 元(2020 年度：380,518.15 元)。

7.4.11 利 分 况

：基 告 内 利 分 。

7.4.12 (2021 年 12 31) 基 受 券

7.4.12.1 因 发/增发 券 于 受 券

单位：人 币元

7.4.12.1.1 受 券 别：

券代	券名	功	可	受型	价	估 值单价	(单位：)		估值	备
001234	士	2021 年 12 31	2022 年 1 11	上 市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍	2021 年 7 26	2022 年 2 16	定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富	2021 年 8 4	2022 年 2 14	定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰 保	2021 年 9 8	2022 年 3 16	定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久 份	2021 年 8 2	2022 年 2 14	定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	平	2021 年 6 23	2022 年 1 5	定	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封	2021 年 6 28	2022 年 1 6	定	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	光	2021 年 6 28	2022 年 1 6	定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	客 化	2021 年 7 6	2022 年 1 24	定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026		2021	2022		18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-

		年7 8	年1 17	定						
301027	华 团	2021 年7 8	2022 年1 19	定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚	2021 年7 12	2022 年1 20	定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	合	2021 年7 14	2022 年1 24	定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301032	份	2021 年7 15	2022 年1 24	定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	医学	2021 年7 15	2022 年1 26	定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	丰 份	2021 年7 21	2022 年1 28	定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐 份	2021 年7 21	2022 年2 16	定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保 佳	2021 年7 21	2022 年2 7	定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038		2021 年7 22	2022 年2 7	定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中	2021 年7 1	2022 年1 10	定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中	2021 年7 26	2022 年2 7	定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301046		2021 年8 10	2022 年2 17	定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	工	2021 年8 11	2022 年2 28	定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049		2021 年8 17	2022 年2 24	定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-

301050	力	2021 年 8 17	2022 年 2 24	定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301053	信 工业	2021 年 8 25	2022 年 3 1	定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小	2021 年 8 26	2022 年 3 7	定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	份	2021 年 8 27	2022 年 3 7	定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057		2021 年 8 31	2022 年 3 9	定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301063	份	2021 年 9 9	2022 年 3 24	定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事 利	2021 年 9 13	2022 年 3 22	定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301072	中 工	2021 年 9 22	2022 年 3 29	定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭 店	2021 年 9 22	2022 年 3 30	定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子	2021 年 9 30	2022 年 4 14	定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	压	2021 年 10 11	2022 年 4 19	定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301082	久	2021 年 10 14	2022 年 4 27	定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301096	医	2021 年 12 13	2022 年 6 20	定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301100	光 份	2021 年 12	2022 年 6	定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-

		10	17							
301108	份	2021 年 11 25	2022 年 6 6	定	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	万 年	2021 年 11 30	2022 年 6 7	定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301126	嘉 康	2021 年 11 30	2022 年 6 7	定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301133	份	2021 年 11 19	2022 年 5 26	定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	份	2021 年 12 31	2022 年 7 11	定	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华	2021 年 12 8	2022 年 6 15	定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301166	优 宁	2021 年 12 21	2022 年 6 28	定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	份	2021 年 12 2	2022 年 6 10	定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	份	2021 年 12 8	2022 年 6 15	定	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301179	宇	2021 年 12 1	2022 年 6 8	定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301182	凯	2021 年 12 16	2022 年 6 23	定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301189	奥 尼 子	2021 年 12	2022 年 6	定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-

		21	28							
301190	善	2021 年 12 17	2022 年 6 24	定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家	2021 年 12 2	2022 年 6 9	定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜	2021 年 11 25	2022 年 6 2	定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
688176	亚医	2021 年 12 29	2022 年 1 7	上市	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688262	国	2021 年 12 28	2022 年 1 6	上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688280	动	2021 年 10 19	2022 年 4 27	定	13.78	13.63	21,211	292,287.58	289,105.93	-
688553	宇制	2021 年 10 14	2022 年 4 26	定	38.87	32.11	8,928	347,031.36	286,678.08	-
688707	华	2021 年 9 6	2022 年 3 14	定	11.75	47.16	8,130	95,527.50	383,410.80	-
689009	九号公司	2021 年 11 10	2022 年 5 10	公 开	57.00	64.58	720,000	41,040,000.00	46,497,600.00	-

：1、 中国 会《上市公司 券发 办 》、《创业 上市公司 券发 办 》以及《上市公司 公开发 实 则》，基 作为 定 2020年2 14 前发完 公开发 份，发 之 12个 内不 。 《上市公司 东、减 份 干 定》及《 圳/上 券交 上市公司 东及 事、 事、 人员减 份实 则》，基 上市公司 公开发 份，取 中 价交 式 ，在任

90 内，减 份 不 公司 份 1%，且 份 售之 12 个 内，
 中 价交 减 不 基 公开发 份 50%； 取大宗交
 式 ，在任 90 内，减 份 不 公司 份 2%。基 大宗
 交 式受 原上市公司大 东减 定 东减 份，在受 后 6 个 内，不
 受 份。

中国 会《关于修 上市公司 券发 办 决定》、《关于修 创业 上市公
 司 券发 办 决定》以及《关于修 上市公司 公开发 实 则》决定》，
 基 2020 年 2 月 14 日（含）后发 完 公开发 份，发 之 6 个
 内不 。外，基 减 上 公开发 份不 《上市公司 东、 减 份
 干 定》及《 圳/上 券交 上市公司 东及 事、 事、 人员减 份实
 则》 关 定。

2、 《上 券交 创 公开发 委员会促 创 初 企业平 发 业
 倡导建 》，基 创 如 式 定 定 ， 定 为 发 人 上
 市之 6 个 。 《上 券交 创 上市公司 东以向 定 价 和
 售 式减 份实 则》，基 价 受 份，在受 后 6 个 内不 。

3、 《 圳 券交 创业 公开发 券发 与 业务实 则》，发 人和主
 商可以 号 售 式 例 售 式，安 基 下发 分创业
 不低于 6 个 售 。

4、基 可使 以基 名义开 ， 上 下一 式 。其中
 基 参与 下 作为 参与 售 ，在 上市后 定
 内不 ；基 参与 上 ，从 上市 之 不 。

7.4.12.2 停 受

： 基 告 停 受 。

7.4.12.3 债券 回 交 中作为 债券

7.4.12.3.1 市场债券 回

： 基 告 从事 市场债券 回 交 形 卖出回 券 余 。

7.4.12.3.2 交 市场债券 回

基 告 从事交 市场债券 回 交 形 卖出回 券 余 。

7.4.12.4 参与 券出借业务 券

： 基 告 参与 券出借业务 券。

7.4.13 工具 及

7.4.13.1 和

基 工具 主 包 ；信 、 动 、市场 。 基 人制定了 应 和 序 别及分 些 ，并 定 当 及内 制 ， 可 及信 上 各 。 基 人奉 全 体 建 ，在 事会下 合 与 委员会， 对合 和 体 、基 审 并 出 ；对合 和 及其 审 并 出 ；对 事会审 大 决 和 大 决 估 并 出 ；对 事会审 合 告和 估 告 审 并 出 。在 层层 制委员会， 导、协 和 各 和各业务单元开展 工作； 事会制定 原则制 关 制 ， 使公司 体业务发展 与 受 力保 当； 促各 在 常工作中 别各 业务 及 各 大 ， 对 大事件、 大决 和 业务 估，就 关 决 审； 促各 别和 估 产品、 业务 ，就 关 制 审； 促各 关 内 制 弱 和可 公司带 大 失 事件，审 并决定 应 制 和 决 ； 公司 体 和各 与业务单元 分工， 导实 应对 ；审 公司 关 制 。

7.4.13.2 信

信 基 在交 中因交 对 履 合 任， 基 券之发 人 出 、 付到 况，导 基 产 失和 变化 。 基 基 人在交 前对交 对 信 况 了充分 估。 基 存 存在 基 人中国工商 ，因 与 存 关 信 不 大。 基 在交 交 均以中国 券 任公司为交 对 完 券交 和 ， 可 小；在 同业市场 交 前均对交 对 信 估 并 对 券交割 式 制以 制 应 信 。

基 基 人建 了信 ， 对 品 信 估 制 券发
人 信 ，且 分 化 以分 信 。

基 债券 信 况 《中国人 信 导 》 定 准
及 。

7.4.13.2.1 信 列 债券

: 基 告 及上年度 信 列 债券 。

7.4.13.2.2 信 列 产 券

: 基 告 及上年度 信 列 产 券 。

7.4.13.2.3 信 列 同业存单

: 基 告 及上年度 信 列 同业存单 。

7.4.13.2.4 信 列 债券

单位: 人 币元

信	2021 年 12 31	上年度 2020 年 12 31
AAA	-	-
AAA 以下	9,400,893.00	8,866,590.20
	-	-
合	9,400,893.00	8,866,590.20

: 债券 取 三 债 。

7.4.13.2.5 信 列 产 券

: 基 告 及上年度 信 列 产 券 。

7.4.13.2.6 信 列 同业存单

: 基 告 及上年度 信 列 同业存单 。

7.4.13.3 动

动 基 在履 与 债 关 义务 到 。 基 动 一 于基 份 人可 回其 基 份 ，另一 于 品 处 交 市场不 带 变 困 因 中 在市场出 剧 动 况下以合 价 变 。

对兑付 回 动 ， 基 基 人 对 基 回 况 严 密 并 动 ，保 基 合中 可 头寸与之 匹 。 基 基 人在基 合同中 了巨 回 ， 定在 常 况下 回 处 式， 制因开 回 式带 动 ， 保 基 人利 。

于 2021 年 12 月 31 日 ， 基 全 债 合 定到 均为一个 月以内且不 超过 3 个月，可 回基 份 净值() 固定到 且不 超过 3 个月，因 余 即为 合 到 。

7.4.13.3.1 告 内 基 合 产 动 分

基 基 人 在 基 作 中 严 格 遵 守 《 公 开 募 集 券 基 金 作 业 办 法 》 及 《 公 开 募 集 开 式 券 基 金 动 作 办 法 》 对 基 合 产 动 的 有 关 规 定 ， 对 基 合 仓 库 中 度 数 、 受 制 品 例 以 及 合 在 内 变 力 合 动 和 分 。

基 于 一 家 公 司 发 行 券 市 值 不 超 过 基 产 净 值 10%， 且 基 与 基 基 人 其 他 基 共 同 一 家 公 司 发 行 券 不 超 过 券 净 值 10%。 基 与 基 基 人 其 他 开 式 基 共 同 一 家 上 市 公 司 发 行 可 交 易 不 超 过 上 市 公 司 可 交 易 净 值 15%， 基 与 基 基 人 全 合 一 家 上 市 公 司 发 行 可 交 易 ， 不 超 过 上 市 公 司 可 交 易 净 值 30% (完 全 关 联 例 券 开 式 基 及 中 国 会 定 合 不 受 上 例 制) 。

基 分 券 在 券 交 易 上 市 ， 其 余 亦 可 在 同 业 市 场 交 易 ， 分 基 产 受 制 不 超 过 7.4.12。 外 ， 基 可 卖 出 回 产 式

借入 应对 动 ，其上 一 不 基 债券 公允价值。 基 主动 于 动 受 产 市值合 不 基 产净值 15%。于 2021 年 12 31 ， 基 动 受 产 市值合 基 产净值 15%。

基 基 人 对基 合 产中 7 个工作 可变 产 可变 价值 审 估与 ， 保 净 回 不 7 个工作 可变 产 可变 价值。于 2021 年 12 31 ， 基 合 产中 7 个工作 可变 产 价值 当 净 回 。

同 ， 基 基 人 合 分 回 交 到 与交 对 中度； 原则对交 对 务 况、偿付 力及 平 尽 与严 准入 ， 以及对不同 交 对 实 交 度 并 动 严 基 从事 回 交 动 和交 对 。 外， 基 基 人建 了 回 交 品 制度： 品 定 平； 品 况与价值变动以 保 品 公允 价值 ；并在与 募 券 产品及中国 会 定 其他主体为交 对 开展 回 交 ，可 受 品 与基 合同 定 围保 一 。

7.4.13.4 市场

市场 基 工具 公允价值 因 处市场各 价 因 变动 发 动 ，包 利 、外 和其他价 。

7.4.13.4.1 利

利 工具 公允价值 受市场利 变动 发 动 。利 工具均 临 于市场利 上升 导 公允价值下 ，其中 动利 工具 临 个付 市场利 定价 对于 影响 。 基 基 人定 对基 临 利 口 ，并 合 久 对上 利 。

基 及 大 分 产和 债不 ，因 基 入及 动 在 大 度上 于市场利 变化。 基 利 产主 为 存 、 备付 、存出保 和债券 。

7.4.13.4.1.1 利 口

单位：人 币元

2021 年 12 月 31 日	1 个 以 内	1-3 个	3 个 -1 年	1-5 年	5 年 以 上	不	合
产							
存	524,452,508.61	-	-	-	-	-	524,452,508.61
备付	1,133,807.41	-	-	-	-	-	1,133,807.41
存出保	264,698.29	-	-	-	-	-	264,698.29
交 产	-	-	-	9,400,893.00	-	4,106,361,306.79	4,115,762,199.79
应 利	-	-	-	-	-	58,666.22	58,666.22
应	53,538.59	-	-	-	-	1,104,629.58	1,158,168.17
应 券	-	-	-	-	-	32,489,881.85	32,489,881.85
产 债	525,904,552.90	-	-	9,400,893.00	-	4,140,014,484.44	4,675,319,930.34
应付 回	-	-	-	-	-	7,046,986.49	7,046,986.49
应付 人	-	-	-	-	-	5,630,000.30	5,630,000.30
应付	-	-	-	-	-	938,333.37	938,333.37
应付交	-	-	-	-	-	784,468.12	784,468.12
应交	-	-	-	-	-	87.15	87.15
其他 债	-	-	-	-	-	257,754.85	257,754.85
债	-	-	-	-	-	14,657,630.28	14,657,630.28
利 度 口	525,904,552.90	-	-	9,400,893.00	-	4,125,356,854.16	4,660,662,300.06
上年度 2020 年 12 月 31 日	1 个 以 内	1-3 个	3 个 -1 年	1-5 年	5 年 以 上	不	合
产							
存	415,300,027.90	-	-	-	-	-	415,300,027.90
备付	154,982,435.58	-	-	-	-	-	154,982,435.58

存出保	630,492.83	-	-	-	-	-	630,492.83
交					8,866,590	5,902,866	5,911,733,
产					.20	,538.84	129.04
应 利						82,672.74	82,672.74
应	95,030.81					3,549,749	3,644,779.
应 券						.04	85
						7,236,252	7,236,252.
						.92	92
产	571,007,987				8,866,590	5,913,735	6,493,609,
债	.12				.20	,213.54	790.86
应付 回						28,302,46	28,302,469
						9.91	.91
应付 人						7,911,882	7,911,882.
						.05	05
应付						1,318,647	1,318,647.
						.02	02
应付交						786,578.7	786,578.70
						0	
应交						935.86	935.86
其他 债						299,139.7	299,139.71
						1	
债						38,619,65	38,619,653
						3.25	.25
利 度	571,007,987				8,866,590	5,875,115	6,454,990,
口	.12				.20	,560.29	137.61

： 中 为 基 产及 债 价值，并 合 定 利 定价 到 孰 予以分 。

7.4.13.4.1.2 利 分

假	市场利 以外 其他市场变 保 不变		对 产 债 基 产净值	
	关 变 变	动	影响 (单位：人 币元)	上年度 (2020 年 12 31)
分	1. 市场利 下 25 个基		104,213.32	118,799.19
	2. 市场利 上升 25 个基		-102,809.98	-116,931.26

7.4.13.4.2 外

外 工具 公允价值 因外 变动 发 动 。 基
产及 债以人 币 价，因 大外 。

7.4.13.4.3 其他价

基 受 其他市场价 ，主 基 工具 公允价值 因
市场利 和外 以外 市场价 因 变动 发 动 。 基 其他市场价 ，
主 受到 券交 上市 同业市场交 券 势 影响， 工具
公允价值决定。 基 合 分 化 低其他市场价 ，并且 基 人 对
基 券价 实 ， 合估值、 业 分 市场价 。

7.4.13.4.3.1 其他价 口

单位：人 币元

	2021年12月31日		上年度 2020年12月31日	
	公允价值	占基 产净值 例 (%)	公允价值	占基 产净值 例 (%)
交 产	4,106,361,306.79	88.11	5,902,866,538.84	91.45
交 基 产	-	-	-	-
交 属 产	-	-	-	-
产	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合	4,106,361,306.79	88.11	5,902,866,538.84	91.45

7.4.13.4.3.2 其他价 分

假	300 以外 其他市场变 保 不变		
关 变 变 动	对 产 债 基 产净值 影响 (单位：人 币元)		
	(2021年12月31日)	上年度 (2020年12月31日)	

分	1. 300 上 升 5%	247,572,344.09	259,850,867.48
	2. 300 下 5%	-247,572,344.09	-259,850,867.48

：基 人 产- 定价 型(CAPM)对 基 其他价 分 。上 为其他 价 分 ，反 了在其他变 不变 假 下， 市场 (300)价 发 合 、可 变动 ，将对基 净值产 影响。

7.4.14 助于 和分 会 其他事

(1)公允价值

(a) 工具公允价值

公允价值 属 层 ， 对公允价值 体 具 义 入值 属 低层 决定：

一层 ： 同 产 债在 市场上 价。

二层 ： 一层 入值外 关 产 债 可 察 入值。

三层 ： 关 产 债 不可 察 入值。

(b) 以公允价值 工具

(i)各层 工具公允价值

于 2021 年 12 31 ， 基 以公允价值 且其变动 入当 产中属 于一层 余 为 4,066,313,325.59 元，属于 二层 余 为 1,253,239.55 元，属于 三层 余 为 48,195,634.65 元。(2020 年 12 31 ： 一层 5,691,537,429.14 元， 二层 220,195,699.90 元， 三层)。

(ii)公允价值 属层 大变动

基 以导 各层 之 事 发 为 各层 之 。

对于 券交 上市 和债券， 出 大事 停 、交 不 (包 停 交 不)、 属于 公开发 况， 基 不会于停 交 复 、交 不 及 售 将 关 和债券 公允价值列入 一层 ；并 估值 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 三层 。

(iii) 三层 公允价值余 和 变动

于 ， 基 公允价值归属于 三层 工具为 48,195,634.65 元(2020 年 12 31 ：)。基 净 出 三层 为 42,207,942.38 元(2020 年 12 31 ：)，

入 三层 工具公允价值变动为 5,987,692.27 元(2020 年度:)。
 于 2021 年 12 月 31 日 基金 三层 交 产(均为交 市场上市交 但
 尚在 售 内)公允价值为 48,195,634.65 元, 平均价 亚式 型作为估值
 估值,不可 察 入值为 受 在剩余 售 内 价 平均 动 , 与公
 允价值之 呈 关关 (2020 年 12 月 31 日 :)。

(c) 以公允价值 工具
 于 2021 年 12 月 31 日 , 基 以公允价值 产(2020 年 12 月 31
 : 同)。

(d) 不以公允价值 工具
 不以公允价值 产和 债主 包 应 和其他 债, 其 价值与公允
 价值 差 小。

(2) 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 会 》和 《企业会 准则 37 号— 工
 具列 》(以下合 “ 工具准则”) 关 定, 以及 、中国 保 委
 员会于 2020 年 12 月 30 日 发布 《关于 一 彻 实 工具 关会 准则 》, 公募
 券 基 应当 2022 年 1 月 1 日 工具准则。 2021 年 12 月 31 日 , 基
 已完 了 工具准则对 务 在影响 估。 于 基 业务 , 工具
 准则 不会对 基 务 况和 产 大影响。

基 将 2022 年 1 月 1 日 关 定, 并 准则允 实务 便 ,
 初 , 2021 年 将不作 。

(3) 公允价值和 工具准则外, 产 债 基 其他
 事 。

§ 8 合 告

8.1 基 产 合 况

单位: 人 币元

序号			占基 产 例 (%)
1		4,106,361,306.79	87.83
	其中:	4,106,361,306.79	87.83
2	基	-	-
3	固定	9,400,893.00	0.20

	其中：债券	9,400,893.00	0.20
	产 券	-	-
4	属	-	-
5	品	-	-
6	买入 售 产	-	-
	其中：买 式回 买入 售 产	-	-
7	存 和 备付 合	525,586,316.02	11.24
8	其他各 产	33,971,414.53	0.73
9	合	4,675,319,930.34	100.00

：1、基 告 交 制 。

2、基 告 参与 券出借业务 券。

8.2 告 业分 合

8.2.1 告 业分 境内 合

单位：人 币元

代	业 别	公允价值（元）	占基 产净值 例（%）
A	农、 、 、 业	-	-
B	业	-	-
C	制 业	2,862,023,069.43	61.41
D	力、力、 及 产和 供应业	-	-
E	建 业	4,713.80	0.00
F	发和 售业	24,064,901.46	0.52
G	交 、仓储和 业	152,008,336.60	3.26
H	住宿和 业	4,608.00	0.00
I	信 传 、 件和信 务业	221,385,226.26	4.75
J	业	136,505,196.26	2.93
K	地产业	347,510,366.32	7.46
L	和商务 务业	362,674,444.86	7.78
M	学 和 务业	121,159.78	0.00
N	利、 境和公共 业	21,351.71	0.00
O	居 务、修 和其他 务业	-	-
P		-	-
Q	卫 和 会工作	-	-
R	化、体 和娱乐业	37,932.31	0.00
S	合	-	-
	合	4,106,361,306.79	88.11

8.2.2 告 业分 合

： 基 告 交 制 。

8.3 公允价值占基 产净值 例大小 序

单位：人 币元

序号	代	名	()	公允价值 (元)	占基 产净值 例 (%)
1	002475	密	9,343,941	459,721,897.20	9.86
2	002415	康威	8,041,159	420,713,438.88	9.03
3	000333	团	4,993,485	368,569,127.85	7.91
4	002027	分众传媒	44,282,594	362,674,444.86	7.78
5	000002	万 A	17,586,557	347,510,366.32	7.46
6	600887	伊利 份	5,578,352	231,278,473.92	4.96
7	600585		4,501,391	181,406,057.30	3.89
8	600519	州 台	85,581	175,441,050.00	3.76
9	300616	尚品宅	3,739,904	160,404,482.56	3.44
10	689009	九号公司	2,273,418	155,345,599.26	3.33
11	603228	子	4,247,258	146,657,818.74	3.15
12	002352	丰	2,051,062	141,359,193.04	3.03
13	600036	商	2,802,406	136,505,196.26	2.93
14	002153	基信	4,720,692	135,672,688.08	2.91
15	002841	份	1,291,117	105,096,923.80	2.25
16	600276	医	1,736,015	88,033,320.65	1.89
17	600741	华域	3,106,006	87,899,969.80	1.89
18	600060	信 像	6,055,740	81,449,703.00	1.75
19	002555	三七互娱	1,901,600	51,381,232.00	1.10
20	300482	万孚	1,136,599	44,759,268.62	0.96
21	600031	三一 工	1,702,800	38,823,840.00	0.83
22	688088		636,736	28,054,588.16	0.60
23	688798	为 子	116,871	25,244,136.00	0.54
24	688608		79,196	24,154,780.00	0.52
25	300783	三只	613,650	23,913,940.50	0.51
26	688793	倍	202,312	21,141,604.00	0.45
27	688032	份	23,641	16,643,027.59	0.36
28	002223	医	383,400	14,492,520.00	0.31
29	603056	份	1,040,972	10,649,143.56	0.23
30	002311	大 团	85,300	6,252,490.00	0.13
31	688316	云	114,503	5,742,325.45	0.12
32	600426	华 升	181,598	5,684,017.40	0.12
33	688176	亚 医	37,990	873,010.20	0.02
34	688167	光	2,014	441,066.00	0.01
35	688707	华	8,130	383,410.80	0.01

36	688262	国	7,129	299,275.42	0.01
37	688280	动	21,211	289,105.93	0.01
38	688553	宇制	8,928	286,678.08	0.01
39	688206	伦子	6,000	220,140.00	0.00
40	301177	份	792	91,935.36	0.00
41	301136	份	7,172	75,449.44	0.00
42	301050	力	233	54,694.42	0.00
43	301029	合	462	41,519.94	0.00
44	301035	丰份	644	36,244.32	0.00
45	603230	内华	1,141	29,517.67	0.00
46	301039	中	2,064	25,820.64	0.00
47	301189	奥尼子	435	24,629.70	0.00
48	301166	优宁	253	23,908.50	0.00
49	301096	医	272	21,360.16	0.00
50	301082	久	915	19,699.95	0.00
51	300994	久份	420	19,089.00	0.00
52	301100	光份	599	18,652.86	0.00
53	001296		310	18,376.80	0.00
54	301168	份	329	17,150.77	0.00
55	301190	善	575	15,789.50	0.00
56	301108	份	280	15,038.80	0.00
57	301179	宇	295	14,977.15	0.00
58	301046		290	14,207.10	0.00
59	301111	万年	379	13,901.72	0.00
60	301017	平	555	13,209.00	0.00
61	301020	密封	421	12,815.24	0.00
62	301138	华	285	12,785.10	0.00
63	301026		203	12,734.19	0.00
64	301126	嘉康	662	12,730.26	0.00
65	301021	光	290	12,014.70	0.00
66	301048	工	843	10,925.28	0.00
67	301028	东亚	733	9,895.50	0.00
68	300774	倍	444	9,359.52	0.00
69	301040	中	241	9,280.91	0.00
70	301078	孩子	756	9,177.84	0.00
71	301182	凯	294	8,990.52	0.00
72	301193	家	297	8,654.58	0.00
73	301025	客化	403	8,414.64	0.00
74	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
75	300814	中富	328	7,832.64	0.00
76	301055	张小	355	7,731.90	0.00
77	301133	份	286	7,707.70	0.00

78	301198	喜	262	7,650.40	0.00
79	301016	尔伟	275	7,128.00	0.00
80	301033	医学	108	6,476.76	0.00
81	301049		196	6,452.32	0.00
82	301032	份	513	6,417.63	0.00
83	301004	嘉 份	312	6,389.76	0.00
84	301056	份	572	6,343.48	0.00
85	301036	双乐 份	205	6,135.65	0.00
86	301072	中 工	181	6,047.21	0.00
87	301007	仕	303	6,035.76	0.00
88	300854	中兰 保	203	5,539.87	0.00
89	301063	份	153	5,524.83	0.00
90	001234	士	333	5,504.49	0.00
91	301038		266	5,381.18	0.00
92	301027	华 团	286	4,761.90	0.00
93	603176	团	1,924	4,713.80	0.00
94	301037	保 佳	193	4,682.18	0.00
95	301073	君亭 店	144	4,608.00	0.00
96	301053	信工业	155	4,460.90	0.00
97	301057		218	4,146.36	0.00
98	301079	压	140	3,474.80	0.00

8.4 告 内 合 大变动

8.4.1 买 入 出 初基 产净值 2% 前 20 名

单位：人 币元

序号	代	名	买入	占 初基 产净值 例(%)
1	002475	密	351,446,981.95	5.44
2	002352	丰	119,383,965.53	1.85
3	000002	万 A	80,852,414.50	1.25
4	600585		74,135,535.24	1.15
5	689009	九号公司	69,805,452.87	1.08
6	002841	份	67,814,030.98	1.05
7	600597	光 乳业	62,363,269.50	0.97
8	002415	康威	58,720,091.65	0.91
9	300482	万孚	56,600,430.96	0.88
10	002555	三七互娱	51,786,485.17	0.80
11	600276	医	51,036,453.82	0.79
12	002153	基信	48,663,321.14	0.75
13	600031	三一 工	40,533,676.00	0.63
14	600887	伊利 份	38,702,495.00	0.60
15	688088		30,483,500.41	0.47
16	688798	为 子	29,297,883.78	0.45

17	688599	天合光	27,876,238.67	0.43
18	603228	子	25,350,256.27	0.39
19	688559		23,178,372.78	0.36
20	688608		23,084,261.44	0.36

: “ 买入 ” 买入 交 (交单价乘以 交) 填列, 不 关交 。

8.4.2 卖出 出 初基 产净值 2% 前 20 名

单位: 人 币元

序号	代	名	卖出	占 初基 产净值 例 (%)
1	002415	康威	386,229,276.15	5.98
2	600426	华 升	306,281,331.84	4.74
3	600887	伊利 份	284,411,809.59	4.41
4	002475	密	245,882,658.48	3.81
5	600036	商	215,667,800.07	3.34
6	600741	华域	171,453,296.02	2.66
7	000002	万 A	167,985,842.52	2.60
8	002027	分众传媒	161,271,266.20	2.50
9	601111	中国国	155,805,439.55	2.41
10	002925		114,945,714.70	1.78
11	002558	巨人	81,603,607.86	1.26
12	000333	团	80,100,975.23	1.24
13	603228	子	70,500,590.23	1.09
14	600597	光 乳业	44,417,296.33	0.69
15	600660		43,801,507.43	0.68
16	605337	子园	40,484,389.40	0.63
17	600519	州 台	38,911,756.00	0.60
18	688599	天合光	32,584,197.33	0.50
19	002841	份	31,111,863.30	0.48
20	600276	医	29,078,256.50	0.45

: “ 卖出 ” 卖出 交 (交单价乘以 交) 填列, 不 关交 。

8.4.3 买入 及卖出 入

单位: 人 币元

买入 (交)	1,581,492,596.13
卖出 入 (交)	3,038,903,565.88

: “买入 (交) ” 和 “卖出 入 (交) ” 买卖 交 (交单价 乘以 交) 填列, 不 关交 。

8.5 债券品 分 债券 合

单位：人 币元

序号	债券品	公允价值	占基 产净值 例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央	-	-
3	债券	-	-
	其中： 债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业 券	-	-
6	中	-	-
7	可 债 (可交 债)	9,400,893.00	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合	9,400,893.00	0.20

8.6 公允价值占基 产净值 例大小 序 前五名债券

单位：人 币元

序号	债券代	债券名	(张)	公允价值	占基 产净值 例 (%)
1	113602	20 债	65,580	9,400,893.00	0.20

8.7 公允价值占基 产净值 例大小 序 产 券

: 基 告 产 券。

8.8 告 公允价值占基 产净值 例大小 序 前五名 属

: 基 告 属。

8.9 公允价值占基 产净值 例大小 序 前五名

: 基 告 。

8.10 告 基 交 况

8.10.1 告 基 仓和

: 基 告 。

8.10.2 基

基 以套 保值为 ，以回 市场 。 头 合 价值主
与 合 多头价值 对应。 基 人 动 合 ，以 取 应

合 。

8.11 告 基 国债 交 况

8.11.1 国债

基 国债 以套 保值为 ，以回 市场 。 国债 头 合 价值主 与债券 合 多头价值 对应。基 人 动 国债 合 ，以 取 应债券 合 。

8.11.2 告 基 国债 仓和

： 基 告 国债 。

8.11.3 国债 价

： 基 告 国债 。

8.12 合 告

8.12.1 基 前十名 券 发 主体 否出 ， 在 告 制 前一年内受到公开 、处 形

基 前十名 券 发 主体 出 ， 在 告 制 前一年内受到公开 、处 形。

8.12.2 基 前十名 否 出基 合同 定 备 库

基 前十名 出基 合同 定 备 库。

8.12.3 其他各 产

单位：人 币元

序号	名	
1	存出保	264,698.29
2	应 券	32,489,881.85
3	应 利	-
4	应 利	58,666.22
5	应	1,158,168.17
6	其他应	-
7		-

8	其他	-
9	合	33,971,414.53

8.12.4 处于 可 债券

单位:人 币元

序号	债券代	债券名	公允价值	占基 产净值 例 (%)
1	113602	20 债	9,400,893.00	0.20

8.12.5 前十名 中存在 受 况

单位:人 币元

序号	代	名	受 分 公允价值	占基 产净值 例 (%)	受 况
1	689009	九号公司	46,497,600.00	1.00	公开

8.12.6 合 告 其他 字 分

于四 五入 原因, 合 告中市值占净值 例 分 之和与合 之 可 存在尾差。

§9 基 份 人信

9.1 基 份 人 及 人

份 单位:份

人 ()	均 基 份	人			
				个人	
		份	占 份 例 (%)	份	占 份 例 (%)
114,909	15,883.61	158,840,077.69	8.70	1,666,329,924.20	91.30

9.2 基 人 从业人员 基 况

	份 (份)	占基 份 例 (%)
基 人 从业人员 基	6,774,383.14	0.37

9.3 基 人 从业人员 开 式基 份 区 况

	基 份 区 (万份)
公司 人员、基 和 人 开 式基	>100
基 基 开 式基	0~10

9.4 兼任募产划基人及其亲属人 产品况

: 基基告兼任募产划。

§ 10 开式基份变动

单位: 份

基合同 (2015年4月7日)基份	13,856,118,720.97
告初基份	2,371,928,132.17
告基份	579,028,474.91
减: 告基回份	1,125,786,605.19
告基分变动份 (份减少以“-”填列)	-
告基份	1,825,170,001.89

§ 11 大事件

11.1 基份人大会议

基告内召开基份人大会议。

11.2 基人、基人专基大人事变动

刚同于2021年3月12日不再任基人副务;张同于2021年8月20日任基人务,同任同不再任务;丽同于2021年9月24日任基人席务。

基人中国工商份公司工作,任命刘彤女士任产,全主产关工作。刘彤女士人人员任信已在中国券基业协会备。勇先不再任产务。

11.3 及基人、基产、基业务

告内发基人、基产、基业务。

11.4 基变

基告内变。

11.5 为基审会师事务况

为基审会师事务华中天会师事务(合伙)。会师事务2017年度为基供审务今。基告应付事务审

为 13.1 万元人 币。

11.6 人、 人及其 人员受 处 况

告 内基 人、 人及其 人员 受 处 况。

11.7 基 券公司交 单元 关 况

11.7.1 基 券公司交 单元 及佣 付 况

单位：人 币元

券商名	交 单元	交		应 付 券 商 佣		备
		交	占当 交 例	佣	占当 佣 例	
国 券	1	1,930,125,578.65	42.39%	1,372,905.61	42.37%	-
券	2	905,407,190.93	19.88%	645,000.78	19.91%	-
券	2	627,701,471.17	13.78%	446,478.28	13.78%	-
国信 券	1	416,771,347.78	9.15%	296,453.51	9.15%	-
中信 券	2	385,612,047.35	8.47%	274,360.33	8.47%	-
东吴 券	2	164,505,877.31	3.61%	117,007.46	3.61%	-
东 国 券	1	109,805,119.95	2.41%	78,145.39	2.41%	-
华 券	1	13,760,225.52	0.30%	9,788.48	0.30%	-
安信 券	1	-	-	-	-	-
东北 券	1	-	-	-	-	-
东 券	6	-	-	-	-	-
东兴 券	1	-	-	-	-	-
券	1	-	-	-	-	-
华 券	1	-	-	-	-	-
光大 券	1	-	-	-	-	-
广发 券	2	-	-	-	-	-
国 券	1	-	-	-	-	-
国 君安 券	2	-	-	-	-	-
券	2	-	-	-	-	-
宏信 券	1	-	-	-	-	-
华安 券	1	-	-	-	-	-
华创 券	1	-	-	-	-	-
券	1	-	-	-	-	-

平安 券	1	-	-	-	-	-
券	2	-	-	-	-	-
万宏	1	-	-	-	-	-
信 券	1	-	-	-	-	-
兴业 券	2	-	-	-	-	-
商 券	2	-	-	-	-	-
商 券	2	-	-	-	-	-
中 公司	3	-	-	-	-	-
中 券	2	-	-	-	-	-
中信建 券	3	-	-	-	-	-

:

1、处 佣 单一券商 交 单元 、 交 (如) 合 付 券商 佣 合 , 不 单 交 佣 。

2、交 单元 准和 序

(1) 准

券 商 务 况 好、 为 , 一 年 大 为; 具 强 务 力; 交 佣 合 。

(2) 序

基 人 以 上 准 对 不 同 券 商 合 价, 后 价 券 商, 与 其 协 交 单 元。

3、基 告 内 券 商 交 单 元 变 况: 增 华 券 交 单 元 1 个、华 安 券 交 单 元 1 个、 商 券 交 单 元 2 个、 商 券 交 单 元 2 个。

11.7.2 基 券 公 司 交 单 元 其 他 券 况

单位: 人 币 元

券 商 名	债 券 交		债 券 回 交		交	
	交	占 当 债 券 交 例	交	占 当 回 交 例	交	占 当 交 例
国 券	-	-	-	-	-	-
券	509,872.60	41.56%	-	-	-	-
券	280,739.80	22.88%	-	-	-	-
国 信 券	-	-	-	-	-	-
中 信 券	261,336.40	21.30%	-	-	-	-

东吴 券						
东 国 券	174,816.70	14.25%				
华 券						
安信 券						
东北 券						
东 券						
东兴 券						
券						
华 券						
光大 券						
广发 券						
国 券						
国君安						
券						
宏信 券						
华安 券						
华创 券						
券						
平安 券						
券						
万宏						
信 券						
兴业 券						
商 券						
商 券						
中 公司						
中 券						
中信建 券						

11.8 其他 大事件

序号	公告事	定 式	定
1	上 东 券 产 公司关于 住 变 告	上 券 、中国 券 、 券 、 券 、中国 会基 子 、公司官	2021 年 1 8
2	上 东 券 产 公司关于 下基 在 平台开展 优 动 告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 1 11

3	东 中国优势 合型 券 基 2020 年 4 季度 告/ 公告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 1 22
4	东 中国优势 合型 券 基 基 产品	中国 会基 子 、公司官	2021 年 2 9
5	东 中国优势 合型 券 基 募 书 () (2021 年 1 号)	中国 会基 子 、公司官	2021 年 2 9
6	上 东 券 产 公司关于 下 分基 增加中国人寿保 份 公司为代 售 并开 定 业务 公告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 2 22
7	上 东 券 产 公司关于 下 分基 在 平台开 业 务并开展 优 动 公告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 3 2
8	上 东 券 产 公司关于 人员变 公告	上 券 、中国 券 、 券 、 券 、中国 会基 子 、公司官	2021 年 3 13
9	关于东 中国优势 合型 券 基 增加代 售 公 告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 3 22
10	东 中国优势 合型 券 基 2020 年年度 告/ 告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 3 31
11	东 中国优势 合型 券 基 2021 年 1 季度 告/ 公告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 4 22
12	上 东 券 产 公司关于 下 分基 增加交 份 公司为代 售 并开 定 业务 公告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 6 18
13	关于上 东 券 产 公司 中 变 公告	上 券 、中国 券 、 券 、 券 、中国 会基 子 、公司官	2021 年 6 22
14	上 东 券 产 公司关于 下 分基 增加 南农 商业 份 公司为代 售 并 开 定 业务 公告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 7 5
15	上 东 券 产 公司关于 下 分基 在 上 平台开展 优 动 公告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 7 13
16	上 东 券 产 公司关于	券 、中国 会	2021 年 7 14

	下分基在安基售(圳)公司开定定业务公 告	基子、公 司官	
17	东中国优势合型券 基2021年2季度告/ 公告	券、中国会 基子、公 司官	2021年7月21
18	上东券产公司关于 下分基增加北京创 售公司为代售并开 定业务公告	券、中国会 基子、公 司官	2021年8月19
19	上东券产公司关于 人员变公告	上券、中国券 、券、券 、中国会基 子、公司官	2021年8月21
20	东中国优势合型券 基2021年中告/ 公告	券、中国会 基子、公 司官	2021年8月31
21	上东券产公司关于 下分基增加上基售 公司为代售公告	券、中国会 基子、公 司官	2021年9月22
22	上东券产公司关于 人员变公告	上券、中国券 、券、券 、中国会基 子、公司官	2021年9月25
23	上东券产公司关于 下分基增加北京基售 公司为代售并开定 业务公告	券、中国会 基子、公 司官	2021年9月30
24	东中国优势合型券 基2021年3季度告/ 公告	券、中国会 基子、公 司官	2021年10月27
25	上东券产公司关于 下基在平台开展客 优动公告	上券、中国券 、券、券 、中国会基 子、公司官	2021年11月3
26	关于东中国优势合型 券基增加中国券份 公司为代售并开定 业务公告	券、中国会 基子、公 司官	2021年11月8
27	上东券产公司关于 下分基可北京券交 公告	上券、中国券 、券、券 、中国会基 子、公司官	2021年11月19
28	上东券产公司关于	券、中国会	2021年11月29

	下分基在上平台开展 优 动 告	基 子 、公 司官	
29	上 东 券 产 公司关于 北京分公司 告	上 券 、中国 券 、 券 、 券 、中国 会基 子 、公司官	2021 年 12 月 2 日
30	上 东 券 产 公司关于 下分基 及 回 制 告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 12 月 3 日
31	上 东 券 产 公司关于 平台 及 完善、 份 信 告	上 券 、中国 券 、 券 、 券 、中国 会基 子 、公司官	2021 年 12 月 10 日
32	上 东 券 产 公司关于 公司上 平台 停 务 告	上 券 、中国 券 、 券 、 券 、中国 会基 子 、公司官	2021 年 12 月 22 日
33	关于东 中国优势 合型 券 基 增加北京 基 售 公司为代 售 并开 定 业务 告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 12 月 28 日
34	上 东 券 产 公司关于 下分基 增加北京度小 基 售 公司为代 售 并开 定 业务 告	券 、中国 会 基 子 、公 司官	2021 年 12 月 29 日
35	东 中国优势 合型 券 基 募 书 (2021 年 2 号)	中国 会基 子 、公司官	2021 年 12 月 31 日
36	东 中国优势 合型 券 基 基 产品	中国 会基 子 、公司官	2021 年 12 月 31 日

§ 12 影响 决 其他 信

12.1 告 内单一 基 份 例 到 20% 况

： 基 告 内 发 单一 基 份 例 到 20% 况。

12.2 影响 决 其他 信

。

§ 13 备 件 录

13.1 备 件 录

- 1、中国 会 准 东 中国优势 合型 券 基 件；
- 2、《东 中国优势 合型 券 基 基 合同》；
- 3、《东 中国优势 合型 券 基 协 》；
- 4、东 中国优势 合型 券 基 务 及 ；
- 5、 告 内在 定媒介上 各 公告；
- 6、基 人业务 件、 业 ；
- 7、中国 会 其他 件。

13.2 存 地

备 件存 于基 人办公场 ；上 市 区外 108 号 7 层。

13.3 式

可到基 人 办公场 免 备 件，亦可 公司 ，公司 址为：
www.dfham.com。

上 东 券 产 公司
2022 年 3 月 31 日