

东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

东方基金管理有限责任公司已于 2020 年 8 月 20 日更名为东方基金管理股份有限公司。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	45
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.11 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	56
§12 备查文件目录.....	57

12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	东方永泰纯债 1 年定期开放债券	
基金主代码	006715	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 18 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,471,433,045.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 A	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码:	006715	006716
报告期末下属分级基金的份额总额	4,731,390,975.01 份	740,042,070.25 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金通过对我国宏观经济运行环境、货币政策等相关政策的深入分析，判断我国中短期利率走势、债券市场预期风险水平和相对收益率。结合本基金定期开放式运作的特点，在基金的封闭期与开放期，本基金采用不同的投资策略。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，理论上其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	东方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩
	联系电话	010-66295888
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com
客户服务电话	010-66578578 或 400-628-5888	95599
传真	010-66578700	010-68121816
注册地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100033	100031
法定代表人	崔伟	周慕冰

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理股份有限公司	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 A	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	87,374,840.48	11,959,176.40
本期利润	57,274,043.31	6,935,241.10
加权平均基金份额本期利润	0.0148	0.0118
本期加权平均净值利润率	1.38%	1.11%
本期基金份额净值增长率	1.94%	1.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	302,565,679.94	42,819,536.81
期末可供分配基金份额利润	0.0639	0.0579
期末基金资产净值	5,051,679,698.17	785,634,956.76
期末基金份额净值	1.0677	1.0616
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	6.77%	6.16%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方永泰纯债 1 年定期开放债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.73%	0.09%	-1.03%	0.19%	0.30%	-0.10%
过去三个月	0.18%	0.09%	-1.70%	0.19%	1.88%	-0.10%
过去六个月	1.94%	0.07%	0.84%	0.18%	1.10%	-0.11%

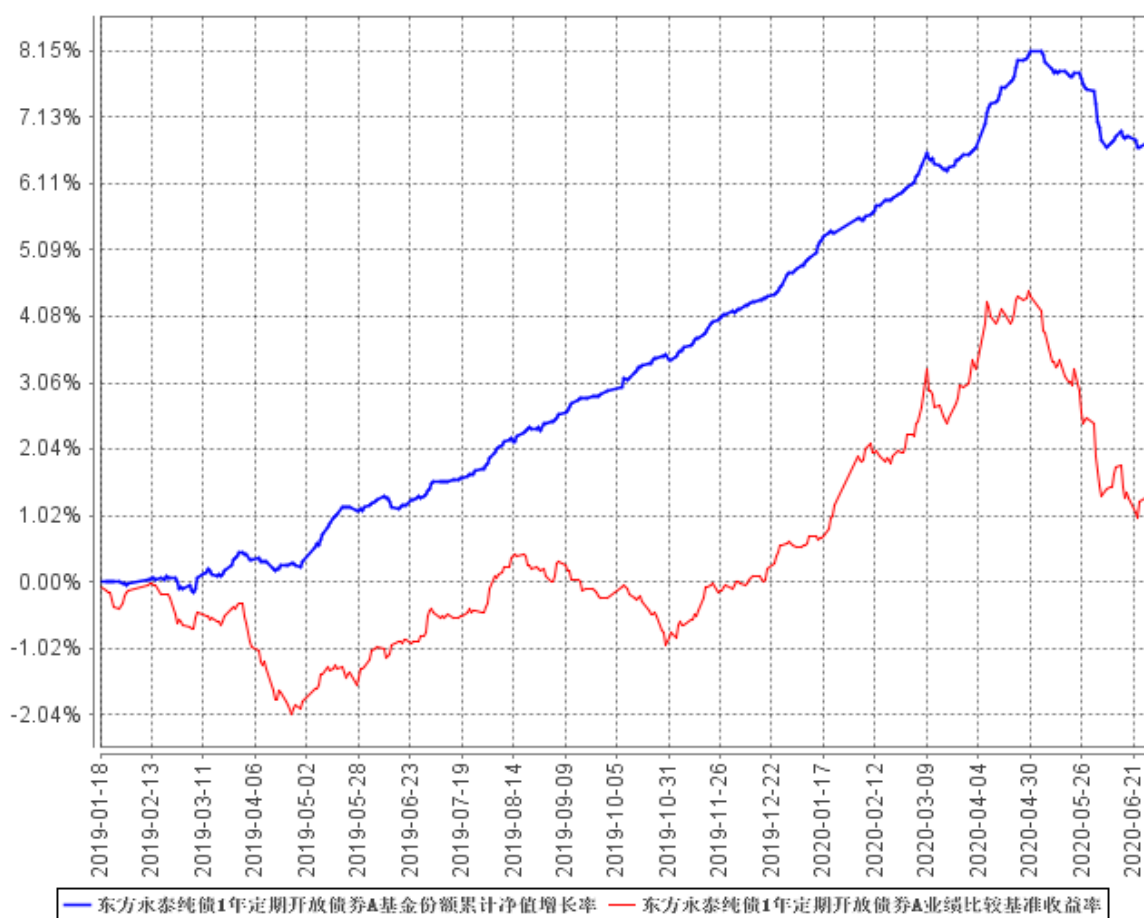
过去一年	5.39%	0.05%	2.33%	0.14%	3.06%	-0.09%
自基金合同生效起至今	6.77%	0.05%	1.47%	0.12%	5.30%	-0.07%

东方永泰纯债1年定期开放债券C

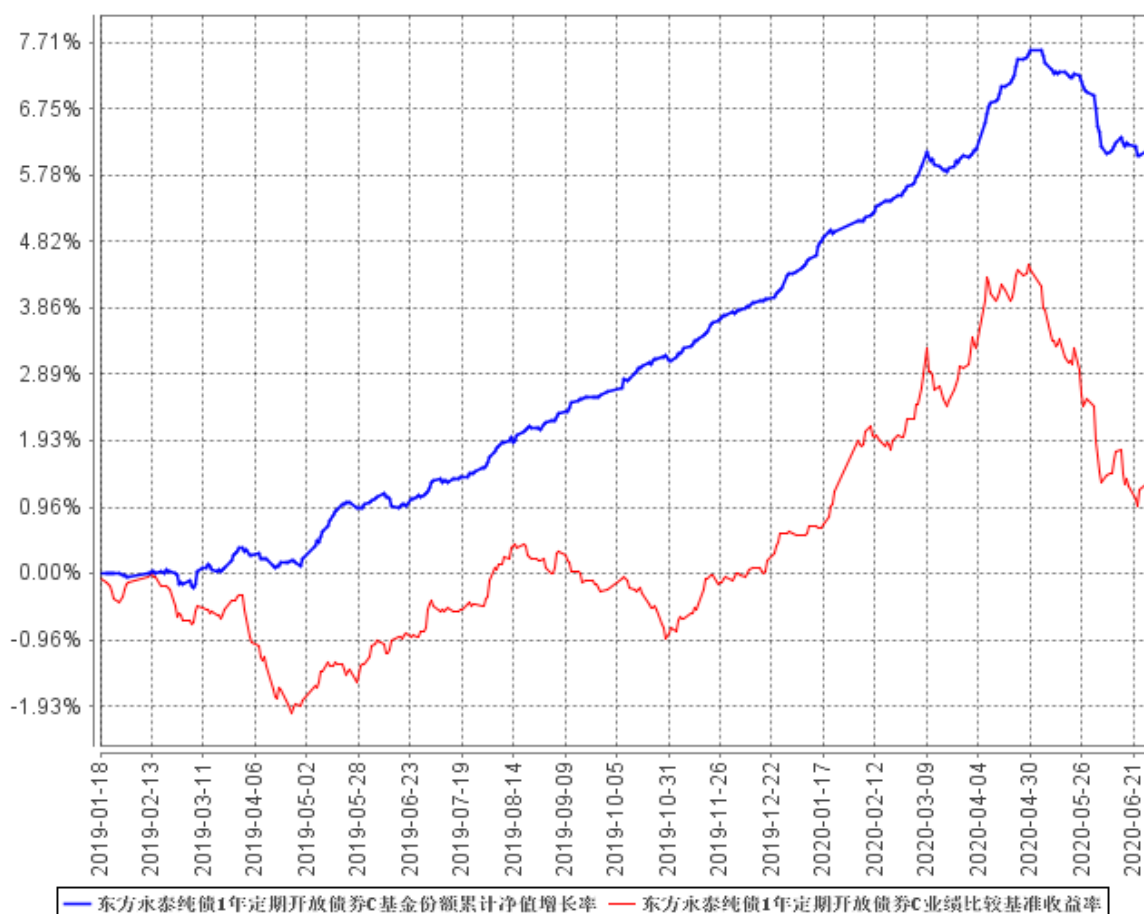
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.77%	0.09%	-1.03%	0.19%	0.26%	-0.10%
过去三个月	0.08%	0.09%	-1.70%	0.19%	1.78%	-0.10%
过去六个月	1.73%	0.07%	0.84%	0.18%	0.89%	-0.11%
过去一年	4.97%	0.05%	2.33%	0.14%	2.64%	-0.09%
自基金合同生效起至今	6.16%	0.05%	1.47%	0.12%	4.69%	-0.07%

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

东方永泰纯债1年定期开放债券A基金份额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



东方永泰纯债1年定期开放债券C基金份额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：本基金基金合同于2019年1月18日生效，建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”），系由东方基金管理有限责任公司于 2020 年 8 月改制设立。本公司经中国证监会批准（证监基金字【2004】80 号）于 2004 年 6 月 11 日成立，是《中华人民共和国证券投资基金法》施行后成立的第一家基金管理公司。本公司注册资本 33333 万元人民币。本公司股东为东北证券股份有限公司，持股比例 57.60%；河北国控资本管理有限公司，持股比例 24.30%；渤海国际信托股份有限公司，持股比例 8.10%；天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙），持股比例 3.51%；天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙），持股比例 3.37%；天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙），持股比例 3.12%。截至 2020 年 6 月 30 日，本公司管理 47 只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方成长回报平衡混合型证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金证通货币市场基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开放纯债

债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣利混合型证券投资基金、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金（该产品已于2020年7月1日发布清算报告，已终止运作）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴萍萍 (女士)	本基金基金经理、固定收益投资部副总经理，投资决策委员会委员	2019年1月18日	-	9年	固定收益投资部副总经理，投资决策委员会委员，中国人民大学应用经济学硕士，9年证券从业经历，曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015年11月加盟本公司，曾任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金（于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理，现任东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债1年定期开放债券型

					证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。
车日楠 (女士)	本基金基金经理助理	2019 年 8 月 5 日	2020 年 4 月 29 日	5 年	北京交通大学计算数学专业硕士，5 年证券从业经历。2015 年加盟本公司，曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员，东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理。

注：①经公司决议通过，自 2020 年 7 月 23 日起，李雅蓉（女士）担任东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。

②此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

③证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，国内外疫情对宏观经济和债券市场运行的节奏带来了显著的影响。突发疫情对宏观经济形成了较大的冲击，经济增速断崖式下行，海内外主要经济体均采取了宽松的政策进行应对；但随着国内疫情控制得当、复工复产顺利推进，内需逐步恢复，外需在防疫物资支撑和出口份额替代的作用下也呈现出了较强的韧性，经济走出了 V 型走势，复苏力度较强。

债券市场的走势紧跟基本面。在 4 月底之前，海内外疫情成为主要矛盾，收益率快速下行，10Y 国债和国开从年初最多分别下行 64bp、79bp 到 2.5% 和 2.79%。进入 5 月份之后，收益率跟随基本面 V 型反转，货币政策从总量宽松回归适度也起到关键作用，政府债券大量发行也挤压了银行的配债行为，10Y 国债和国开到 6 月底回升到 2.82% 和 3.1% 的水平。从资金利率来看，上半年央行先是进行了多次降准降息，并下调了超额存款准备金利率，银行间流动性十分充裕，资金利率处于历史低位；5 月份开始央行关注金融空转，流动性边际收敛，资金利率开始明显抬升。

具体投资策略方面，2020 年上半年基金在做好流动性管理的同时，视宏观经济和市场情况灵活调整久期及仓位，在信用风险可控的情况下，优选中高静态短期限信用债以获取稳健的底仓收益，充分发掘单个券种超额收益机会，利率债方面保持灵活适度操作，择机参与波段机会，获得了较好的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 1.94%，业绩比较基准收益率为 0.84%，高于业绩比较基准 1.10%；本基金 C 类净值增长率为 1.73%，业绩比较基准收益率为 0.84%，高于业绩比较基准 0.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济复苏的态势延续，经济增速有望持续抬升。基建和消费仍然有继续向上的空间，同时出口和房地产部门预计将维持较强的韧性。宏观政策来看，下半年货币政策或将保持平稳，财政政策将以落实为主，继续支持宏观经济的稳步复苏。同时，由于积极财政仍在落地，预计未来几个月债券供给压力较大，可能对债券市场形成抑制。资金利率在前期明显抬升之后初步完成了重定价，如果下半年货币政策能保持平稳，则资金利率将有望重回稳定，但债券供给压力、金融风险等或将对资金利率带来扰动。这一背景下，下半年久期策略存在一定的风险，但可以关注市场超跌等带来的阶段性交易机会。当前信用债收益率已有明显回升，达到了去年四季度前后

的水平，票息将是下半年基金获取回报的主要方式。

未来本基金将继续以高静态收益、中低久期的优质信用债为底仓，以获取稳定的票息收入，并择机进行利率债波段操作增厚组合收益。感谢基金持有人对本基金的信任和支持，我们将本着勤勉尽责的精神，秉承“诚信是基、回报为金”的原则，力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营高管、分管投研高管、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益投资部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任1名，委员会副主任1-2名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

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

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

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

4. 风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东方基金管理股份有限公司2020年1月1日至2020年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，东方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2020年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	193,115.60	1,170,904.48
结算备付金		42,978,356.66	22,929,613.36
存出保证金		186,044.26	30,566.91
交易性金融资产	6.4.7.2	7,492,540,461.90	1,045,710,399.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,319,814,061.90	1,045,710,399.00
资产支持证券投资		172,726,400.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,945,000.00	36,084,138.04
应收证券清算款		39,684.73	4,198,224.05
应收利息	6.4.7.5	120,014,111.83	23,094,860.35
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,665,896,774.98	1,133,218,706.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,822,849,333.47	404,648,010.68
应付证券清算款		-	5,321,213.36
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,352,372.93	427,665.04
应付托管费		957,820.80	122,189.99
应付销售服务费		257,861.00	14,861.18
应付交易费用	6.4.7.7	120,939.10	34,804.53
应交税费		785,563.03	166,347.78

应付利息		88,726.58	72,639.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	169,503.14	191,000.00
负债合计		1,828,582,120.05	410,998,732.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,471,433,045.26	689,664,921.10
未分配利润	6.4.7.10	365,881,609.67	32,555,052.65
所有者权益合计		5,837,314,654.93	722,219,973.75
负债和所有者权益总计		7,665,896,774.98	1,133,218,706.19

注：①报告截止日2020年6月30日，东方永泰纯债1年定期开放债券A基金份额净值1.0677元，基金份额总额4,731,390,975.01份；东方永泰纯债1年定期开放债券C基金份额净值1.0616元，基金份额总额740,042,070.25份。东方永泰纯债1年定期开放债券份额总额合计为5,471,433,045.26份。

②本基金基金合同于2019年1月18日生效，故上年度为不完整会计期间，下同。

6.2 利润表

会计主体：东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月18日(基金 合同生效日)至2019年6 月30日
一、收入		99,924,079.45	14,968,851.43
1.利息收入		128,094,873.62	21,044,604.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	368,343.43	569,440.51
债券利息收入		123,787,197.46	19,920,823.95
资产支持证券利息收入		2,001,933.77	-
买入返售金融资产收入		1,937,398.96	554,339.75
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,914,650.75	-3,377,121.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	13,333,200.75	-3,377,121.23
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-6,418,550.00	-
股利收益	6.4.7.16	-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-35,124,732.47	-2,698,631.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	39,287.55	-
减：二、费用		35,714,795.04	6,005,438.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	16,216,006.81	2,165,832.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,633,144.81	618,809.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,211,169.21	75,455.51
4. 交易费用	6.4.7.19	190,494.92	29,124.32
5. 利息支出		12,889,034.71	2,939,535.68
其中：卖出回购金融资产支出		12,889,034.71	2,939,535.68
6. 税金及附加		424,311.48	70,023.90
7. 其他费用	6.4.7.20	150,633.10	106,657.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		64,209,284.41	8,963,413.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		64,209,284.41	8,963,413.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	689,664,921.10	32,555,052.65	722,219,973.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	64,209,284.41	64,209,284.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,781,768,124.16	269,117,272.61	5,050,885,396.77

其中：1.基金申购款	5,351,699,214.81	300,277,978.51	5,651,977,193.32
2.基金赎回款	-569,931,090.65	-31,160,705.90	-601,091,796.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,471,433,045.26	365,881,609.67	5,837,314,654.93
项目	上年度可比期间 2019年1月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,963,413.10	8,963,413.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	689,664,921.10	-	689,664,921.10
其中：1.基金申购款	689,664,921.10	-	689,664,921.10
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	689,664,921.10	8,963,413.10	698,628,334.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘鸿鹏

基金管理人负责人

_____ 刘鸿鹏

主管会计工作负责人

_____ 王丹丹

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2018年4月2日中国证监会《关于准予东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可

【2018】597 号)和 2018 年 12 月 11 日中国证监会证券投资基金机构监管部《关于东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》(机构部函【2018】2894 号)的核准,由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》自 2018 年 12 月 17 日至 2019 年 1 月 11 日公开募集设立。本基金为债券型证券投资基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 689,500,197.38 元人民币,业经瑞华会计师事务所“瑞华验字【2019】01210005 号验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 1 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 689,500,197.38 份基金单位,其中认购资金利息折合 164,723.72 份基金单位。本基金的基金管理人为东方基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- 2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

5、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	活期存款	193,115.60
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
合计：	193,115.60	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,987,093,022.90	1,967,687,749.90
	银行间市场	5,363,786,435.25	5,352,126,312.00
	合计	7,350,879,458.15	7,319,814,061.90
资产支持证券	172,004,986.30	172,726,400.00	721,413.70
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	7,522,884,444.45	7,492,540,461.90	-30,343,982.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,945,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	9,945,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,773.20
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	13,524.57
应收债券利息	117,889,525.40
应收资产支持证券利息	2,073,882.74
应收买入返售证券利息	34,330.59
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	75.33
合计	120,014,111.83

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	120,939.10
合计	120,939.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	169,503.14
合计	169,503.14

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东方永泰纯债 1 年定期开放债券 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	647,582,057.59	647,582,057.59
本期申购	4,611,204,074.25	4,611,204,074.25
本期赎回(以“-”号填列)	-527,395,156.83	-527,395,156.83
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,731,390,975.01	4,731,390,975.01

金额单位：人民币元

东方永泰纯债 1 年定期开放债券 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,082,863.51	42,082,863.51
本期申购	740,495,140.56	740,495,140.56
本期赎回(以“-”号填列)	-42,535,933.82	-42,535,933.82
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	740,042,070.25	740,042,070.25

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东方永泰纯债 1 年定期开放债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,235,523.90	4,490,118.44	30,725,642.34
本期利润	87,374,840.48	-30,100,797.17	57,274,043.31
本期基金份额交易产生的变动数	188,955,315.55	43,333,721.95	232,289,037.50
其中：基金申购款	212,812,295.12	48,348,911.51	261,161,206.63
基金赎回款	-23,856,979.57	-5,015,189.56	-28,872,169.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	302,565,679.93	17,723,043.22	320,288,723.15

单位：人民币元

东方永泰纯债 1 年定期开放债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,538,778.83	290,631.48	1,829,410.31
本期利润	11,959,176.40	-5,023,935.30	6,935,241.10
本期基金份额交易产生的变动数	29,321,581.59	7,506,653.52	36,828,235.11
其中：基金申购款	31,123,413.76	7,993,358.12	39,116,771.88

基金赎回款	-1,801,832.17	-486,704.60	-2,288,536.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,819,536.82	2,773,349.70	45,592,886.52

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	84,284.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	260,116.44
其他	23,942.57
合计	368,343.43

注：其他为结算保证金利息收入和期货保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	13,333,200.75
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	13,333,200.75

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	14,272,430,068.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	14,112,245,720.65

减：应收利息总额	146,851,146.99
买卖债券差价收入	13,333,200.75

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2020年1月1日至2020年6月30日
国债期货投资收益	-6,418,550.00
股指期货-投资收益	-

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-35,124,732.47
——股票投资	-
——债券投资	-35,846,146.17
——资产支持证券投资	721,413.70
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-35,124,732.47

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	39,287.55
合计	39,287.55

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	31,072.42
银行间市场交易费用	159,422.50
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	190,494.92

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	30,830.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费用	18,600.00
银行汇划费用	41,529.96
其他费用	-
合计	150,633.10

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

注：东方基金管理有限责任公司已于 2020 年 8 月 20 日更名为东方基金管理股份有限公司。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,216,006.81	2,165,832.00
其中:支付销售机构的客户维护费	9,698,160.17	977,411.66

注:①计提标准:本基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计算。

管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式:基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,633,144.81	618,809.13

注:①计提标准:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。

托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式:基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 A	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 C	合计
东方基金管理有限责任公司	-	22,471.26	22,471.26
合计	-	22,471.26	22,471.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 18 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 A	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 C	合计
东方基金管理有限责任公司	-	71,731.39	71,731.39
合计	-	71,731.39	71,731.39

注：①本基金仅对 C 类基金份额收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，登记机构收到后按相关合同规定支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月18日(基金合同生效日)至 2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	193,115.60	84,284.42	69,544.10	257,725.30

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额533,049,333.47元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011902838	19云锡股SCP004	2020年7月1日	100.56	100,000	10,056,000.00
101901472	19泉州城建MTN001	2020年7月1日	101.86	941,000	95,850,260.00
102000418	20闽冶金MTN001	2020年7月1日	100.37	131,000	13,148,470.00
011902307	19鲁能源SCP001	2020年7月1日	100.42	300,000	30,126,000.00
101900812	19阳煤MTN002	2020年7月1日	102.05	211,000	21,532,550.00
101900060	19金川MTN001	2020年7月1日	101.49	156,000	15,832,440.00
1880142	18珠实专项债	2020年7月1日	106.85	10,000	1,068,500.00
1180052	11国投债1	2020年7月1日	109.85	423,000	46,466,550.00
101754021	17长发集团MTN001	2020年7月1日	103.23	500,000	51,615,000.00
1380178	13同煤债	2020年7月1日	100.84	1,500,000	151,260,000.00
011902669	19国网租赁SCP004	2020年7月1日	100.37	750,000	75,277,500.00
101800823	18广州地铁MTN004	2020年7月1日	102.06	300,000	30,618,000.00
102000228	20兴泰金融MTN001	2020年7月1日	99.39	200,000	19,878,000.00
合计				5,522,000	562,729,270.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额共1,289,800,000元，分别于2020年7月1日和2020年7月3日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，

按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和监察稽核部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的股票市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	380,765,000.00	20,132,000.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	621,740,000.00	155,715,500.00

合计	1,002,505,000.00	175,847,500.00
----	------------------	----------------

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	3,481,785,089.90	215,569,465.00
AAA以下	2,588,073,972.00	654,293,434.00
未评级	0.00	0.00
合计	6,069,859,061.90	869,862,899.00

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	114,764,200.00	0.00
AAA以下	0.00	0.00

未评级	57,962,200.00	0.00
合计	172,726,400.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA以下	49,890,000.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	49,890,000.00	0.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 流动性风险

所谓流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	193,115.60	-	-	-	193,115.60
结算备付金	42,978,356.66	-	-	-	42,978,356.66
存出保证金	186,044.26	-	-	-	186,044.26
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融资产-债券投资	2,269,951,361.90	4,605,825,200.00	444,037,500.00	-	7,319,814,061.90
交易性金融资产-资产支持证券投资	85,974,400.00	86,752,000.00	0.00	-	172,726,400.00
买入返售金融资产	9,945,000.00	-	-	-	9,945,000.00
应收证券清算款	-	-	-	39,684.73	39,684.73
应收利息	-	-	-	120,014,111.83	120,014,111.83
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	2,409,228,278.42	4,692,577,200.00	444,037,500.00	120,053,796.56	7,665,896,774.98
负债					
卖出回购金融资产款	1,822,849,333.47	-	-	-	1,822,849,333.47
应付赎回款	-	-	-	0.00	0.00

应付管理人报酬	-	-	-	3,352,372.93	3,352,372.93
应付托管费	-	-	-	957,820.80	957,820.80
应付交易费用	-	-	-	120,939.10	120,939.10
应付销售服务费	-	-	-	257,861.00	257,861.00
应交税费	-	-	-	785,563.03	785,563.03
应付利息	-	-	-	88,726.58	88,726.58
其他负债	-	-	-	169,503.14	169,503.14
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	1,822,849,333.47	0.00	0.00	5,732,786.58	1,828,582,120.05
利率敏感度缺口	586,378,944.95	4,692,577,200.00	444,037,500.00	114,321,009.98	5,837,314,654.93
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,170,904.48	-	-	-	1,170,904.48
结算备付金	22,929,613.36	-	-	-	22,929,613.36
存出保证金	30,566.91	-	-	-	30,566.91
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融资产-债券投资	410,182,205.00	635,528,194.00	0.00	-	1,045,710,399.00
交易性金融资产-资产支持证券投资	0.00	0.00	0.00	-	0.00
买入返售金融资产	36,084,138.04	-	-	-	36,084,138.04
应收证券清算款	-	-	-	4,198,224.05	4,198,224.05
应收利息	-	-	-	23,094,860.35	23,094,860.35
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	470,397,427.79	635,528,194.00	0.00	27,293,084.40	1,133,218,706.19
负债					
卖出回购金融资产款	404,648,010.68	-	-	-	404,648,010.68
应付赎回款	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	427,665.04	427,665.04
应付托管费	-	-	-	122,189.99	122,189.99
应付交易费用	-	-	-	34,804.53	34,804.53
应付销售服务费	-	-	-	14,861.18	14,861.18
应交税费	-	-	-	166,347.78	166,347.78
应付利息	-	-	-	72,639.88	72,639.88
其他负债	-	-	-	191,000.00	191,000.00
应付证券清算款	-	-	-	5,321,213.36	5,321,213.36
负债总计	404,648,010.68	0.00	0.00	6,350,721.76	410,998,732.44
利率敏感度缺口	65,749,417.11	635,528,194.00	0.00	20,942,362.64	722,219,973.75

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日

孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	28,588,458.72	2,227,667.91
	市场利率上调 0.25%	-42,846,638.64	-4,319,033.45

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,319,814,061.90	125.40	1,045,710,399.00	144.79
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	172,726,400.00	2.96	-	-
合计	7,492,540,461.90	128.36	1,045,710,399.00	144.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	0.00	0.00
	沪深 300 指数上涨 5%	0.00	0.00

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 20,569,080.87 元，占基金资产净值比例为 0.35%；上年度末本基金风险价值为 899,599.31 元，占基金资产净值比例为 0.12%。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,492,540,461.90	97.74
	其中：债券	7,319,814,061.90	95.49
	资产支持证券	172,726,400.00	2.25
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	9,945,000.00	0.13
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	43,171,472.26	0.56
8	其他各项资产	120,239,840.82	1.57
9	合计	7,665,896,774.98	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	197,560,000.00	3.38

2	央行票据	-	-
3	金融债券	472,681,000.00	8.10
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,914,676,561.90	49.93
5	企业短期融资券	1,002,505,000.00	17.17
6	中期票据	2,516,596,000.00	43.11
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	49,890,000.00	0.85
9	其他	165,905,500.00	2.84
10	合计	7,319,814,061.90	125.40

注：其他为地方政府债和项目收益票据。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	2022018	20 上汽通用债	2,800,000	274,876,000.00	4.71
2	200006	20 付息国债 06	2,000,000	197,560,000.00	3.38
3	122179	12 科环 03	1,800,000	186,318,000.00	3.19
4	1380178	13 同煤债	1,500,000	151,260,000.00	2.59
5	2005200	20 河北债 14	1,150,000	116,000,500.00	1.99

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	165897	联融 01 优	660,000	65,736,000.00	1.13
2	138521	东逸 2A1	300,000	29,979,000.00	0.51
3	165865	龙联 06A	280,000	27,983,200.00	0.48
4	165912	20 佳美 2A	230,000	23,009,200.00	0.39
5	142801	17 九通 A6	100,000	10,659,000.00	0.18
6	142800	17 九通 A5	100,000	10,357,000.00	0.18
7	138391	海诺 1A1	50,000	5,003,000.00	0.09

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有 17 新城控股 MTN001 (101752008. IB)，发行人新城控股集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2019 年 7 月 9 日对外公告了公司实际控制人兼董事长被刑拘事项的监管工作函。公告称，于 2019 年 7 月 1 日公司董事长王振华因涉嫌猥亵儿童，被公安采取强制措施。目前王振华已辞去董事长职务，公司已恢复正常运行。

本基金决策依据及投资程序：

(1) 研究：本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台，由研究部负责，采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势进行分析，深入研究国家宏观经济走势、政策走向和利率变化趋势；通过对信用利差的分析判断，可转债的投资价值分析等，深入研究各类债券合理的投资价值。在全面深入研究的基础上，提出大类资产配置建议、目标久期建议、类属资产配置建议等。

(2) 资产配置决策：投资决策委员会依据上述研究报告，对基金的资产配置比例、目标久期设定等提出指导性意见。基金经理基于投研部门的投资建议，根据自己对未来一段时期内宏观经济走势的基本判断，对基金资产的投资，制定月度资产配置和久期设置计划，并报投资决策委员会审批，审批通过，方可按计划执行。

(3) 组合构建：大类资产配置比例范围及目标久期设定范围确定后，基金经理参考研究员的投资建议，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。

(4) 交易执行：交易管理部负责具体的交易执行，依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

(5) 风险监控：本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控，定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况，责令投资不规范的基金经理进行检讨，并及时调整。

(6) 风险绩效评估：风险管理部定期和不定期对基金的投资进行风险绩效评估，并提供相关报告，使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略，并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整和优化投资组合。

(7) 组合调整：基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，以及组合风险与绩效的评估结果，结合基金申购和赎回的现金流量情况，对投资组合进行动态调整，使之不断得到优化。

本基金投资 17 新城控股 MTN001 主要基于以下原因：

17 新城控股 MTN001 的债项评级为 AAA，主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

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

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内本基金没有投资股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	186,044.26
2	应收证券清算款	39,684.73
3	应收股利	-
4	应收利息	120,014,111.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120,239,840.82

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东方永泰纯债1年定期开放债券A	45,762	103,391.26	32,825,983.92	0.69%	4,698,564,991.09	99.31%
东方永泰纯债1年定期开放债券C	7,945	93,145.64	-	-	740,042,070.25	100.00%
合计	53,707	101,875.60	32,825,983.92	0.60%	5,438,607,061.34	99.40%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方永泰纯债1年定期开放债券A	0.94	0.00%
	东方永泰纯债1年定期开放债券C	0.00	0.00%
	合计	0.94	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金	东方永泰纯债1年定	0

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	期开放债券 A	
	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 A	0
	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 A	东方永泰纯债 1 年定期开放债券 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 18 日）基金份 额总额	647,582,057.59	42,082,863.51
本报告期期初基金份额总额	647,582,057.59	42,082,863.51
本报告期基金总申购份额	4,611,204,074.25	740,495,140.56
减：本报告期基金总赎回份额	527,395,156.83	42,535,933.82
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,731,390,975.01	740,042,070.25

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2020年7月1日,公司发布《东方基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》,自2020年7月1日起,聘任杨贵宾先生为公司副总经理,关洪波先生为公司副总经理。上述人员的变更已报北京监管局及中国证券投资基金业协会备案。

2020年8月24日,公司发布《东方基金管理股份有限公司高级管理人员变更公告》,自2020年8月24日起,聘任张科先生为公司副总经理。上述人员的变更已报北京监管局及中国证券投资基金业协会备案。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

司						
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资金雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需，并能为基金提供全面的信息服；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

（3）本报告期内本基金新增租用2个交易单元，分别为浙商证券股份有限公司上海、深圳交易所交易单元各1个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源证券有限公司	3,104,827,520.65	100.00%	39,408,825,000.00	100.00%	-	-
太平洋证	-	-	-	-	-	-

券股份有 限公司						
兴业证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方基金管理有限责任公司年度最后一日基金净值公告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 2 日
2	关于继续参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 2 日
3	关于旗下基金参与中国农业银行基金申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 4 日
4	关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 4 日
5	东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金 2020 年临时公告_基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 16 日
6	东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金 2019 年 第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 17 日
7	关于东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金参与部分销售机构开展的费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 20 日

8	关于延长 2020 年春节放假及休市时间的通知	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 30 日
9	关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 10 日
10	东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2020 年第 1 号）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
11	东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2020 年第 1 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
12	东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金托管协议（2020 年 3 月修订）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
13	东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同（2020 年 3 月修订）	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
14	东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同及托管协议的公告（一）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 11 日
15	东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同及托管协议的公告（二）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 19 日
16	东方基金管理有限责任公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 27 日
17	东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金 2019 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 17 日
18	东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 22 日
19	东方基金管理有限责任公司关于暂停泰诚财富基金销售	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金	2020 年 4 月 25 日

	(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
20	关于增加中信证券华南股份有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年4月30日
21	关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年5月15日
22	关于增加玄元保险代理有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年5月16日
23	关于旗下部分基金参与和合期货有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年5月22日
24	关于旗下部分基金参与中国国际期货股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年5月22日
25	东方基金管理有限责任公司关于暂停包商银行股份有限公司相关基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年5月23日
26	东方基金管理有限责任公司关于股权变更及增加注册资本的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年5月26日
27	关于东方基金管理有限责任公司在直销中心(含网上交易)开展部分基金赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年6月3日
28	关于参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年6月30日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、《东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2020 年 8 月 29 日