

# 东方新价值混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年三月二十六日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

2020 年 5 月 26 日，基金管理人官网披露了《关于股权变更及增加注册资本的公告》，公司原股东河北省国有资产控股运营有限公司将所有出资转让给河北国控资本管理有限公司，新增天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）、天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）、天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）为公司股东，公司注册资本从 30,000 万元增至 33,333 万元。

基金管理人于 2020 年 8 月 20 日改制为股份有限公司，名称由东方基金管理有限责任公司变更为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根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	22
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>23</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	23
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.....	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	23
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>24</b>
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	24
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>26</b>
7.1 资产负债表.....	26
7.2 利润表.....	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	28
7.4 报表附注.....	29
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>60</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	60
8.3 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.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
8.6 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.....	65
8.7 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.....	65

8.8 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 .....	66
8.9 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 .....	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.12 投资组合报告附注 .....	66
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>69</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
9.3 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 .....	69
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	69
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>71</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
11.4 基金投资策略的改变 .....	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
11.8 其他重大事件 .....	74
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>81</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	81
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录 .....	82
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方新价值混合型证券投资基金	
基金简称	东方新价值混合	
基金主代码	001495	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 3 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	400,523,556.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东方新价值混合 A	东方新价值混合 C
下属分级基金的交易代码:	001495	002162
报告期末下属分级基金的份额总额	201,420,305.28 份	199,103,250.74 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，积极把握行业 and 个股投资机会，通过对投资价值突出的优质股票投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金根据资本市场实际情况对大类资产比例进行动态调整，力求有效地回避证券市场的系统性风险。同时，以专业的研究分析为根本，挖掘市场中有潜力的投资标的和被低估的投资品种，获得基金的长期稳定增值。	
业绩比较基准	一年期定期存款利率(税后)*2	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。	
	东方新价值混合 A	东方新价值混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

## 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》	
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com	
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区南京东路 61 号四层
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年		2019 年		2018 年	
	东方新价值混合 A	东方新价值混合 C	东方新价值混合 A	东方新价值混合 C	东方新价值混合 A	东方新价值混合 C
本期已实现收益	24,044,992.75	24,870,075.41	-1,002,536.97	3,911,202.37	1,975,720.09	12.03
本期利润	30,523,347.54	34,419,025.45	2,621,566.05	10,591,058.52	-13,640,379.51	9.52
加权平均基金份额本期利润	0.2025	0.1709	0.1071	0.1587	-0.0723	0.0705
本期加权平	14.99%	14.44%	9.23%	15.04%	-6.00%	6.49%

均 净 值 利 润 率						
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	16.44%	16.07%	4.64%	4.43%	-4.47%	-4.66%
3.1. 2 期 末 数 据 和 指 标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	16,992,933.3 2	-6,470,466.9 9	-2,584,126. 59	-28,014,235. 38	-156,902.37	-21.89
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利	0.0844	-0.0325	-0.0552	-0.1542	-0.0068	-0.108 4



润						
期						
末						
基						
金	282,488,625.	250,050,809.	56,369,280.	196,584,134.	26,691,816.9	209.20
资	76	03	80	06	9	
产						
净						
值						
期						
末						
基						
金						
份	1.4025	1.2559	1.2045	1.0820	1.1511	1.0361
额						
净						
值						
指						
标						
3.1.						
3						
累						
计						
期						
末						
指						
标						
	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基						
金						
份						
额						
累						
计						
净	40.25%	21.83%	20.45%	8.20%	15.11%	3.61%
值						
增						
长						
率						

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

东方新价值混合 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
过去三个月	2.66%	0.36%	0.75%	0.01%	1.91%	0.35%
过去六个月	7.92%	0.40%	1.51%	0.01%	6.41%	0.39%
过去一年	16.44%	0.46%	3.00%	0.01%	13.44%	0.45%
过去三年	16.39%	0.48%	9.00%	0.01%	7.39%	0.47%
过去五年	35.99%	0.73%	15.00%	0.01%	20.99%	0.72%
自基金合同生效起至今	40.25%	0.70%	16.72%	0.01%	23.53%	0.69%

东方新价值混合 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
过去三个月	2.58%	0.36%	0.75%	0.01%	1.83%	0.35%
过去六个月	7.76%	0.40%	1.51%	0.01%	6.25%	0.39%
过去一年	16.07%	0.46%	3.00%	0.01%	13.07%	0.45%
过去三年	15.57%	0.48%	9.00%	0.01%	6.57%	0.47%
过去五年	20.56%	0.62%	15.00%	0.01%	5.56%	0.61%
自基金合同生效起至今	21.83%	0.62%	15.35%	0.01%	6.48%	0.61%

### 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

东方新价值混合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

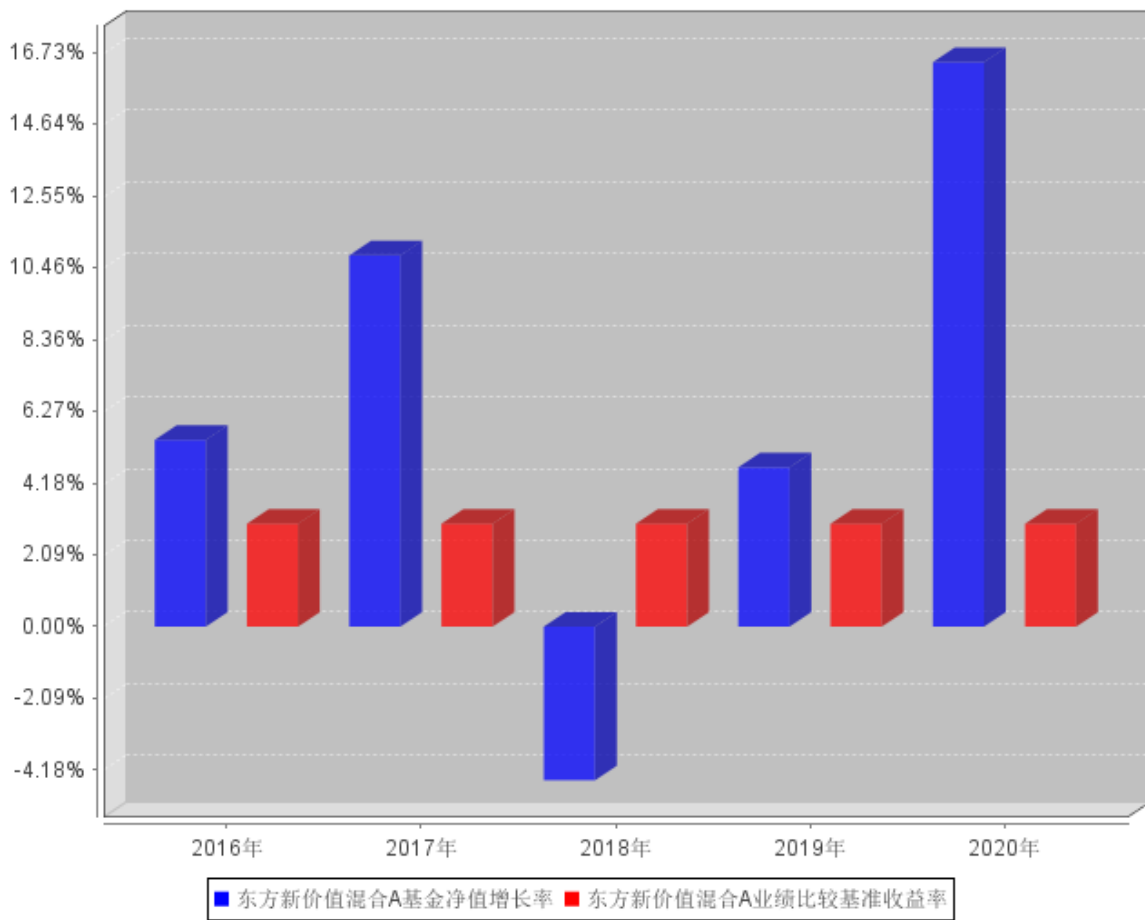


### 东方新价值混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

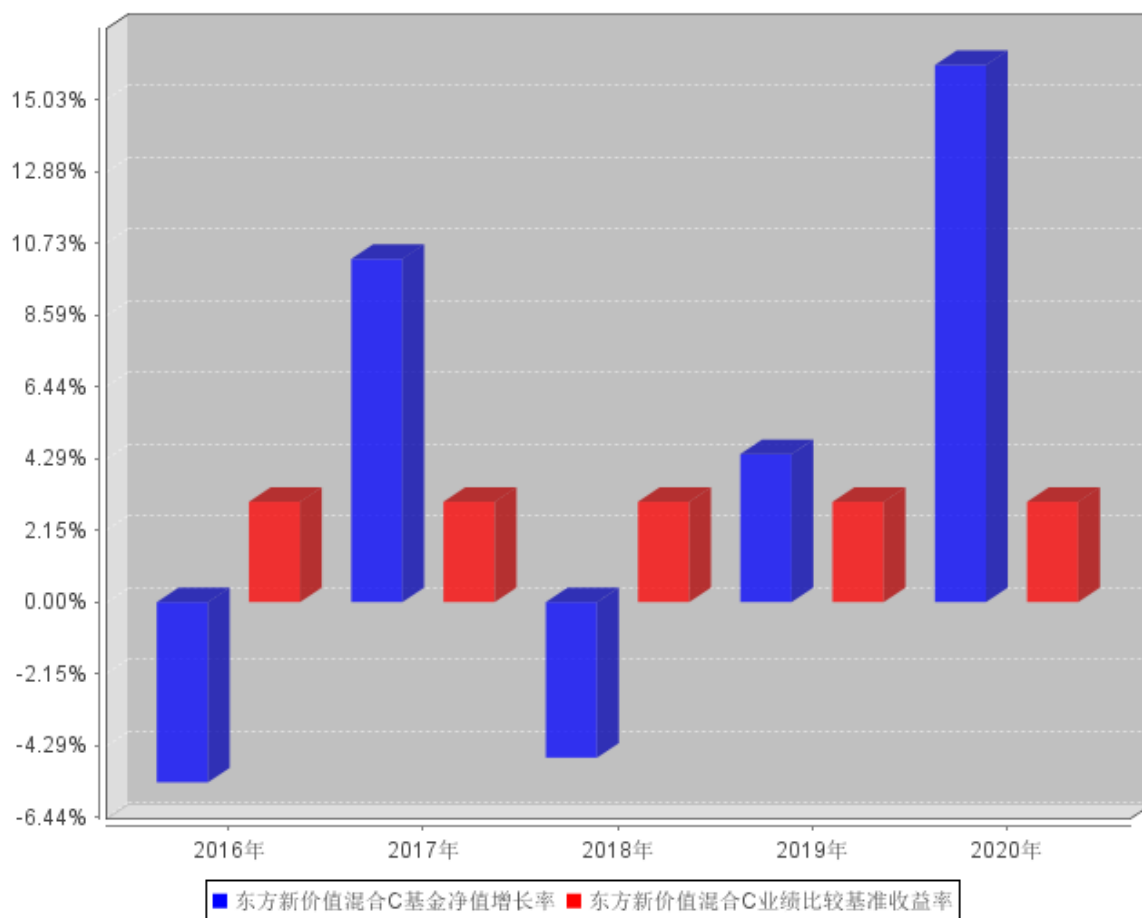


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方新价值混合A过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



东方新价值混合C过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立。截至2020年12月31日，本公司注册资本3.3333亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份19200万股，持股比例57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份8100万股，持股比例24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份2700万股，持股比例8.1%；天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持有本公司股份3.37%；天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止2020年12月31日，本公司管理49只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长回报平衡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、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置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、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃3个月定期开

放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣利混合型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金。

**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		
薛子徽 (先生)	本基金基金经理	2015年7月3日	-	13年	山西大学工商管理、应用心理学专业学士，13年证券从业经历。曾任中宣部政研所研究员、中信基金管理有限责任公司助理研究员、华夏基金管理有限公司研究员。2009年7月加盟本基金管理人，曾任权益投资部房地产、综合、汽车、国防军工、机械设备行业研究员，投资经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金（于2015年7月31日转型为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（自2018年6月



					21 日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金) 基金经理, 现任东方新价值混合型证券投资基金基金经理、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
郑雪莹 (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	复旦大学财务学专业硕士, 5 年证券从业经历。2015 年 7 月加盟本基金管理人, 曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员, 东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方金元宝货币市场基金基金经理助理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理助理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理助理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金证通货币市场基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基

					金经理助理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，现任东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：①2021 年 1 月 4 日，公司发布了《东方中国红利混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自 1 月 4 日起薛子微（先生）担任东方中国红利混合型证券投资基金基金经理。

②2021 年 3 月 20 日，公司发布了《东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自 2021 年 3 月 22 日起薛子微（先生）不再担任东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

③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。

④证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方新价值混合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用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在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年我们经历了百年一遇的新冠疫情，疫情肆虐对于全世界经济运行、人民生活造成了前所未有的巨大影响，而随着各国相应采取医疗、财政、货币等相关抗疫政策，疫情一定程度上得到控制。而我国由于优秀的社会制度、高效的执行力率先走出本轮疫情，并在一定程度上受益于疫情带来的世界经济秩序重塑，并且利用这一机遇，积极进行了产业结构调整，一方面继续向创

新、制造方向迈进，同时通过进一步减税降费刺激内需增长，受此影响，以免税为代表的的社服行业全年上涨 99%位居第一，而高端制造方向的电气设备上涨 94%位列第二，受益于货币宽松，消费升级的视频饮料上涨 85%位列第三；相反的，地产行业一方面因“三条红线”压制了企业杠杆水平压制了企业中长期发展增速，另一方下半年利率持续抬升进一步压制股票估值，受此影响房地产行业全年下跌 10.85%位居最后；通信行业受到 5G 招采低于预期影响下跌 8.33%位列倒数第二；而建筑装饰受到地产行业影响下跌 7.92%倒数第三。

本基金在全年，持仓结构较基本保持稳定，针对不同时期市场特点进行微调。年初我们基本聚焦在业绩稳定增长的消费行业，以及增长空间广阔的物业板块，尽管期间市场受到疫情冲击扰动，但对于看好标的始终进行持有。此后二季度随着疫情得到控制，生产生活逐渐回归正常，我们一定程度增加了可选消费板块的配置比例，而随着 8 月份国内 PPI 见底回升，进一步增配了受益于全球经济复苏的工业金属、造纸等大宗商品板块。四季度随着国内 MLF 价格上调，我们对于部分高估值标的进行了一定程度减持，并转而配置到收益率利率回升的金融板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为 16.44%，业绩比较基准收益率为 3.00%，高于业绩比较基准 13.44%；本基金 C 类净值增长率为 16.07%，业绩比较基准收益率为 3.00%，高于业绩比较基准 13.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年我们对于经济持乐观态度，全年经济将回升至潜在增速以上，但对于二级市场，整体保持谨慎，我们认为市场将呈现出盈利与估值赛跑的结构性行情；其背景是全球经济复苏共振，叠加利率缓慢上行，而国内货币政策边际收紧，对于部分长久期，高估值的行业如消费板块将形成估值压力，但相反，受益于经济复苏，且存在供给瓶颈的行业，如大宗商品、化工等行业将在 2021 年尤其是上半年呈现出业绩高速增长的趋势，将可以对冲利率上行、货币收紧对于估值带来的向下压力。同时对于金融板块而言，银行将受益于货币政策收紧带来息差的回升，带来盈利的持续增长，同时由于经济持续复苏，银行不良率也将出现下降，市场对于行业资产质量的担忧得到缓解，可能出现盈利与估值的戴维斯双击。

总体而言，我们对于 2021 年市场保持谨慎乐观，着重把握结构性行情，看好顺周期的大宗商品、化工、金融等行业。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，开展定期和实时监控，强化内控体系和制度的落实；

在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：（1）开展对公司各项业务的日常监察，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强基金投资运作的监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（3）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。（4）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），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存在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)。

#### 4.8 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, 本基金本报告期末进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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《中华人民共和国证券投资基金法》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 12 月 31 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《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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年度报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2021]第 ZB30134 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方新价值混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了东方新价值混合型证券投资基金(以下简称东方新价值基金)财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了东方新价值基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方新价值基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>东方新价值基金的基金管理人东方基金管理股份有限公司(以下简称基金管理人)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人负责评估东方新价值基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保</p>



<p>责任</p>	<p>证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对东方新价值基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致东方新价值基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>立信会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>朱锦梅   高慧丽</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>上海市黄浦区南京东路 61 号 4 层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2021 年 3 月 25 日</p>

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方新价值混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	90,669,643.71	60,435,339.22
结算备付金		430,343.33	29,702.86
存出保证金		90,788.44	67,339.46
交易性金融资产	7.4.7.2	389,099,798.38	191,525,045.40
其中：股票投资		183,871,298.38	80,907,045.40
基金投资		-	-
债券投资		205,228,500.00	110,618,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	45,000,187.50	-
应收证券清算款		6,356,784.44	-
应收利息	7.4.7.5	1,933,294.20	1,471,911.66
应收股利		-	-
应收申购款		25.00	121.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		533,580,865.00	253,529,460.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		27,523.57	58,221.63
应付管理人报酬		376,047.28	170,477.00
应付托管费		94,011.83	42,619.25
应付销售服务费		70,060.50	49,648.06
应付交易费用	7.4.7.7	239,486.42	28,491.88
应交税费		300.61	7,587.73
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	234,000.00	219,000.12
负债合计		1,041,430.21	576,045.67
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	400,523,556.02	228,490,039.17
未分配利润	7.4.7.10	132,015,878.77	24,463,375.69
所有者权益合计		532,539,434.79	252,953,414.86
负债和所有者权益总计		533,580,865.00	253,529,460.53

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，东方新价值混合 A 基金份额净值 1.4025 元，基金份额总额 201,420,305.28 份；东方新价值混合 C 基金份额净值 1.2559 元，基金份额总额 199,103,250.74 份。东方新价值混合份额总额合计为 400,523,556.02 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东方新价值混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		71,330,539.55	15,047,206.13
1.利息收入		7,856,216.94	1,968,645.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,634,800.41	256,116.05
债券利息收入		3,807,368.20	1,310,338.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,414,048.33	402,190.40
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		47,438,749.25	2,754,119.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	46,157,358.56	2,377,290.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-584,005.89	347,359.61
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,865,396.58	29,469.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	16,027,304.83	10,303,959.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	8,268.53	20,482.25

列)			
<b>减：二、费用</b>		6,388,166.56	1,834,581.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,509,653.36	792,741.00
2. 托管费	7.4.10.2.2	877,413.39	198,185.40
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	713,479.09	211,774.50
4. 交易费用	7.4.7.19	1,078,717.51	453,743.65
5. 利息支出		-	4,630.73
其中：卖出回购金融资产支出		-	4,630.73
6. 税金及附加		6,664.08	3,378.07
7. 其他费用	7.4.7.20	202,239.13	170,128.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		64,942,372.99	13,212,624.57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		64,942,372.99	13,212,624.57

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方新价值混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	228,490,039.17	24,463,375.69	252,953,414.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	64,942,372.99	64,942,372.99
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）	172,033,516.85	42,610,130.09	214,643,646.94
其中：1. 基金申购款	380,967,911.84	91,967,493.73	472,935,405.57
2. 基金赎回款	-208,934,394.99	-49,357,363.64	-258,291,758.63
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	400,523,556.02	132,015,878.77	532,539,434.79

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	23,188,287.60	3,503,738.59	26,692,026.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,212,624.57	13,212,624.57
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）	205,301,751.57	7,747,012.53	213,048,764.10
其中：1. 基金申购款	229,263,242.60	10,739,186.24	240,002,428.84
2. 基金赎回款	-23,961,491.03	-2,992,173.71	-26,953,664.74
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）	228,490,039.17	24,463,375.69	252,953,414.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

          刘鸿鹏  刘鸿鹏  王丹丹            
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东方新价值混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 6 月 2 日中国证监会《关于准予东方新价值混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1113 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《东方新价值混合型证券投资基金基金合同》公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 423,011,150.19 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2015]第 01300054 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方新价值混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 423,027,979.88

份基金单位，其中认购资金利息折合 16,829.69 份基金单位。本基金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。

本基金自 2015 年 11 月 20 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，此前已持有本基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金份额余额为 A 类基金份额。A 类基金份额指在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用，从本类别基金资产中不计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额；C 类基金份额指从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。两级基金份额分别设置基金代码，分别计算基金份额净值并单独公告。详情请见本公司于 2015 年 11 月 20 日刊登的《关于东方新价值混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方新价值混合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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金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—年度报告和中期报告》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### **7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成本基金的金融资产，并形成其他单位的金融负债或权益工具的合同。

##### 1. 金融资产的分类

金融资产应当在初始确认时划分为以下两类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；（2）贷款和应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资等。

本基金持有的其他金融资产包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### 2. 金融负债的分类

金融负债应当在初始确认时划分为以下两类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）其他金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券、同业存单以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

### (1) 股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

### (3) 权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

### (5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。



买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

#### (6) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

#### (7) 同业存单

同业存单视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

具体投资品种的估值方法如下：

#### (1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票，根据 2017 年 9 月 5 日中国证监会发布的【2017】13 号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》内容：如经济环境发生重大变化或证券发行人发

生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价，如指数收益法。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值。

首次公开发行但未上市的股票采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同时股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

## (2) 债券投资

① 证券交易所上市实行净价交易的债券按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

② 证券交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值。

③ 发行未上市流通的债券，按成本估值。

④ 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

⑤ 在全国银行间债券市场交易的债券，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

## (3) 权证投资

① 证券交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价估值。

② 首次发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

③ 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

④ 因认购或获配新发行的分离交易可转债而取得的债券和权证，上市日前，分别按照中国证券业协会公布的债券报价和权证报价确定当日债券和权证的估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述相关原则进行估值。

(4) 资产支持证券等其他有价证券按国家有关规定进行估值。

(5) 同业存单根据其交易场所，采用相应的估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于月末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债及同业存单视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

同业存单投资收益于交易日按卖出同业存单交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

### (3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

### (4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提并确认。

(2) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提并确认。

(3) 基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提并确认。

(4) 卖出回购金融资产利息支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提并确认。

### (5) 交易费用

进行股票、债券、同业存单、权证等交易过程中产生的交易费用，在发生时按照确定的金额计入交易费用。

### (6) 其他费用

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份

额享受当次分红；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	30,669,643.71	20,435,339.22
定期存款	60,000,000.00	40,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	10,000,000.00	-
存款期限 1-3 个月	50,000,000.00	40,000,000.00
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	90,669,643.71	60,435,339.22

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		159,318,338.97	183,871,298.38	24,552,959.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	205,120,706.23	205,228,500.00	107,793.77
	合计	205,120,706.23	205,228,500.00	107,793.77
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		364,439,045.20	389,099,798.38	24,660,753.18
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		72,306,454.26	80,907,045.40	8,600,591.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	323,000.00	323,000.00	-
	银行间市场	110,262,142.79	110,295,000.00	32,857.21
	合计	110,585,142.79	110,618,000.00	32,857.21
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		182,891,597.05	191,525,045.40	8,633,448.35

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	45,000,187.50	-
合计	45,000,187.50	-

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,901.86	3,967.16
应收定期存款利息	199,180.28	123,577.88
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	193.70	13.40
应收债券利息	1,696,865.70	1,344,322.92
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	30,111.76	-
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	40.90	30.30
合计	1,933,294.20	1,471,911.66

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	217,174.33	24,257.15
银行间市场应付交易费用	22,312.09	4,234.73
合计	239,486.42	28,491.88



### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	0.12
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	234,000.00	219,000.00
合计	234,000.00	219,000.12

注：预提费用为按日计提的审计费、账户维护费和信息披露费。

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东方新价值混合 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,799,989.11	46,799,989.11
本期申购	201,292,552.96	201,292,552.96
本期赎回（以“-”号填列）	-46,672,236.79	-46,672,236.79
本期末	201,420,305.28	201,420,305.28

金额单位：人民币元

东方新价值混合 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	181,690,050.06	181,690,050.06
本期申购	179,675,358.88	179,675,358.88
本期赎回（以“-”号填列）	-162,262,158.20	-162,262,158.20
本期末	199,103,250.74	199,103,250.74

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。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东方新价值混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,584,126.59	12,153,418.28	9,569,291.69
本期利润	24,044,992.75	6,478,354.79	30,523,347.54
本期基金份额交易产生的变动数	-4,467,932.84	45,443,614.09	40,975,681.25

其中：基金申购款	-1,028,393.44	60,271,974.90	59,243,581.46
基金赎回款	-3,439,539.40	-14,828,360.81	-18,267,900.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,992,933.32	64,075,387.16	81,068,320.48

单位：人民币元

东方新价值混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-28,014,235.38	42,908,319.38	14,894,084.00
本期利润	24,870,075.41	9,548,950.04	34,419,025.45
本期基金份额交易产生的变动数	-3,326,307.02	4,960,755.86	1,634,448.84
其中：基金申购款	-16,944,816.04	49,668,728.31	32,723,912.27
基金赎回款	13,618,509.02	-44,707,972.45	-31,089,463.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,470,466.99	57,418,025.28	50,947,558.29

#### 7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
活期存款利息收入	282,811.68	61,860.06
定期存款利息收入	1,347,902.40	190,747.32
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	3,318.10	3,010.64
其他	768.23	498.03
合计	1,634,800.41	256,116.05

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
卖出股票成交总额	315,763,536.07	120,587,049.76
减：卖出股票成本总额	269,606,177.51	118,209,759.24
买卖股票差价收入	46,157,358.56	2,377,290.52

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31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	-584,005.89	347,359.61
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	-584,005.89	347,359.61

#### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	383,943,393.05	114,034,857.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	380,534,326.82	112,735,212.12
减：应收利息总额	3,993,072.12	952,285.69
买卖债券差价收入	-584,005.89	347,359.61

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

股票投资产生的股利收益	1,865,396.58	29,469.37
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,865,396.58	29,469.37

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	16,027,304.83	10,303,959.17
——股票投资	15,952,368.27	10,570,712.70
——债券投资	74,936.56	-266,753.53
——资产支持证券投资	-	-
——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	16,027,304.83	10,303,959.17

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
基金赎回费收入	8,267.12	18,432.33
基金转换费收入	1.41	2,049.92
合计	8,268.53	20,482.25

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
交易所市场交易费用	1,073,330.01	450,192.40

银行间市场交易费用	5,387.50	3,551.25
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,078,717.51	453,743.65

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
审计费用	55,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费用	37,200.00	37,200.00
银行汇划费用	30,039.13	12,928.21
律师费	-	-
公证费	-	-
合计	202,239.13	170,128.21

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
渤海国际信托股份有限公司	本基金管理人股东
河北国控资本管理有限公司	本基金管理人股东
天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）	本基金管理人股东

天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）	本基金管理人股东
天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）	本基金管理人股东
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人下属子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,509,653.36	792,741.00
其中：支付销售机构的客户维护费	68,530.52	29,455.95

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年费率计算。

管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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：基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	877,413.39	198,185.40

注：①计提标准：本基金的托管费每日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：基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方新价值混合 A	东方新价值混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	674,788.27	674,788.27

合计	-	674,788.27	674,788.27
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1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方新价值混合 A	东方新价值混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	194,855.71	194,855.71
合计	-	194,855.71	194,855.71

注：①计提标准：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 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

计算方法如下：

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

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：基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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



### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	30,669,643.71	282,811.68	20,435,339.22	61,860.06

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

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，本基金本报告期末进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	10.76	10.76	3,584	38,563.84	38,563.84	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	13.39	13.39	2,163	28,962.57	28,962.57	-

605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
688185	康希诺	2020年8月4日	2021年2月18日	科创板限售	209.71	355.44	2,519	528,259.49	895,353.36	-
688256	寒武纪	2020年7月10日	2021年1月20日	科创板限售	64.39	143.41	5,998	386,211.22	860,173.18	-
688408	中信博	2020年8月20日	2021年3月1日	科创板限售	42.19	160.48	4,450	187,745.50	714,136.00	-
688311	盟升电子	2020年7月24日	2021年2月1日	科创板限售	41.58	115.25	4,182	173,887.56	481,975.50	-
688580	伟思医疗	2020年7月10日	2021年1月21日	科创板限售	67.58	98.30	3,439	232,407.62	338,053.70	-
688578	艾力斯	2020年11月23日	2021年6月2日	科创板限售	22.73	26.95	10,324	234,664.52	278,231.80	-
688221	前沿生物	2020年10月20日	2021年4月28日	科创板限售	20.50	17.96	13,536	277,488.00	243,106.56	-
688330	宏力达	2020年9月28日	2021年4月15日	科创板限售	88.23	77.70	2,755	243,073.65	214,063.50	-
688550	瑞联新材	2020年8月24日	2021年3月2日	科创板限售	113.72	84.05	2,539	288,735.08	213,402.95	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	创业板限售	118.27	603.96	223	26,374.21	134,683.08	-
300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年2月24日	创业板限售	10.16	110.82	862	8,757.92	95,526.84	-
688698	伟创电气	2020年12月22日	2021年6月	科创板限售	10.75	16.96	4,751	51,073.25	80,576.96	-

		日	29日							
688590	新致软件	2020年11月27日	2021年6月7日	科创板限售	10.73	18.75	4,171	44,754.83	78,206.25	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	创业板限售	24.60	77.12	610	15,006.00	47,043.20	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	创业板限售	43.76	51.08	782	34,220.32	39,944.56	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	创业板限售	138.02	126.64	260	35,885.20	32,926.40	-
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	创业板限售	36.81	65.65	478	17,595.18	31,380.70	-
300894	火星人	2020年12月24日	2021年7月1日	创业板限售	14.07	46.91	628	8,835.96	29,459.48	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	创业板限售	30.54	50.83	569	17,377.26	28,922.27	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	创业板限售	30.26	59.62	474	14,343.24	28,259.88	-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	创业板限售	39.74	73.81	285	11,325.90	21,035.85	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	创业板限售	30.72	41.31	484	14,868.48	19,994.04	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	创业板限售	41.34	48.71	401	16,577.34	19,532.71	-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	创业板限售	29.57	50.16	386	11,414.02	19,361.76	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	创业板限售	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300907	康平科技	2020年11月11日	2021年5月18日	创业板限售	14.30	34.55	473	6,763.90	16,342.15	-
300892	品渥	2020年	2021	创业板	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-

	食品	9月11日	2021年3月24日	限售							
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	创业板限售	20.08	44.69	353	7,088.24	15,775.57	-	
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	创业板限售	44.47	74.49	210	9,338.70	15,642.90	-	
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	创业板限售	71.71	90.83	166	11,903.86	15,077.78	-	
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	创业板限售	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-	
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	创业板限售	14.69	48.84	286	4,201.34	13,968.24	-	
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	创业板限售	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-	
300876	蒙泰高新	2020年8月14日	2021年2月25日	创业板限售	20.09	36.61	350	7,031.50	12,813.50	-	
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	创业板限售	10.58	27.14	466	4,930.28	12,647.24	-	
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	创业板限售	24.35	39.32	309	7,524.15	12,149.88	-	
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	创业板限售	4.97	11.20	1,063	5,283.11	11,905.60	-	
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	创业板限售	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-	
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	创业板限售	16.05	36.78	287	4,606.35	10,555.86	-	
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	创业板限售	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-	
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月5日	创业板限售	14.17	32.30	291	4,123.47	9,399.30	-	

300886	华业香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	创业板限售	18.59	45.65	147	2,732.73	6,710.55	-
--------	------	----------------	-----------------	-------	-------	-------	-----	----------	----------	---

注：流通受限证券可流通日以上上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝

支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金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证券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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31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	75,073,500.00	50,112,000.00
合计	75,073,500.00	50,112,000.00

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。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31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

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31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

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	30,551,000.00
AAA 以下	0.00	281,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	30,832,000.00

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	19,658,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	19,658,000.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

#### 7.4.13.3 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（7.4.12 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	90,669,643.71	-	-	-	90,669,643.71
结算备付金	430,343.33	-	-	-	430,343.33
存出保证金	90,788.44	-	-	-	90,788.44
交易性金融资产-股票 投资	-	-	-	183,871,298.38	183,871,298.38
交易性金融资产-债券	205,228,500.00	0.00	0.00	-	205,228,500.00



投资					
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	45,000,187.50	-	-	-	45,000,187.50
应收证券清算款	-	-	-	6,356,784.44	6,356,784.44
应收利息	-	-	-	1,933,294.20	1,933,294.20
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	25.00	25.00
资产总计	341,419,462.98	0.00	0.00	192,161,402.02	533,580,865.00
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	27,523.57	27,523.57
应付管理人报酬	-	-	-	376,047.28	376,047.28
应付托管费	-	-	-	94,011.83	94,011.83
应付交易费用	-	-	-	239,486.42	239,486.42
应付销售服务费	-	-	-	70,060.50	70,060.50
应交税费	-	-	-	300.61	300.61
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	234,000.00	234,000.00
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	1,041,430.21	1,041,430.21
利率敏感度缺口	341,419,462.98	0.00	0.00	191,119,971.81	532,539,434.79
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	60,435,339.22	-	-	-	60,435,339.22
结算备付金	29,702.86	-	-	-	29,702.86
存出保证金	67,339.46	-	-	-	67,339.46
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	80,907,045.40	80,907,045.40
交易性金融资产-债券投资	110,295,000.00	0.00	323,000.00	-	110,618,000.00
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	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	1,471,911.66	1,471,911.66
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	121.93	121.93
资产总计	170,827,381.54	0.00	323,000.00	82,379,078.99	253,529,460.53
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00

应付赎回款	-	-	-	58,221.63	58,221.63
应付管理人报酬	-	-	-	170,477.00	170,477.00
应付托管费	-	-	-	42,619.25	42,619.25
应付交易费用	-	-	-	28,491.88	28,491.88
应付销售服务费	-	-	-	49,648.06	49,648.06
应交税费	-	-	-	7,587.73	7,587.73
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	219,000.12	219,000.12
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	576,045.67	576,045.67
利率敏感度缺口	170,827,381.54	0.00	323,000.00	81,803,033.32	252,953,414.86

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值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12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下调0.25%	117,921.23	33,897.28
	市场利率上调0.25%	-268,068.23	-195,769.28

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	183,871,298.38	34.53	80,907,045.40	31.98
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	205,228,500.00	38.54	110,618,000.00	43.73
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	389,099,798.38	73.06	191,525,045.40	75.72

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-9,271,692.78	-2,627,793.14
	沪深 300 指数上涨 5%	9,271,692.78	2,627,793.14

#### 7.4.13.4.4 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 3,179,376.04 元，占基金资产净值比例为 0.60%；上年度末本基金风险价值为 1,339,592.81 元，占基金资产净值比例为 0.53%。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	183,871,298.38	34.46
	其中：股票	183,871,298.38	34.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	205,228,500.00	38.46
	其中：债券	205,228,500.00	38.46
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	45,000,187.50	8.43
	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	91,099,987.04	17.07
8	其他各项资产	8,380,892.08	1.57
9	合计	533,580,865.00	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,829,000.00	3.91
C	制造业	72,848,975.90	13.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,994.04	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	985,691.14	0.19
J	金融业	36,477,000.00	6.85
K	房地产业	38,945,667.50	7.31
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,700,642.90	2.57
N	水利、环境和公共设施管理业	15,077.78	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	32,926.40	0.01
S	综合	-	-
	合计	183,871,298.38	34.53

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	12,000	23,976,000.00	4.50
2	001914	招商积余	770,000	16,578,100.00	3.11
3	000333	美的集团	150,000	14,766,000.00	2.77
4	300012	华测检测	500,000	13,685,000.00	2.57
5	601318	中国平安	150,000	13,047,000.00	2.45
6	002968	新大正	259,850	12,875,567.50	2.42
7	601166	兴业银行	600,000	12,522,000.00	2.35
8	601899	紫金矿业	1,300,000	12,077,000.00	2.27
9	600966	博汇纸业	800,000	12,024,000.00	2.26
10	600048	保利地产	600,000	9,492,000.00	1.78
11	002128	露天煤业	800,000	8,752,000.00	1.64
12	002142	宁波银行	200,000	7,068,000.00	1.33
13	002025	航天电器	80,000	5,214,400.00	0.98
14	600690	海尔智家	150,000	4,381,500.00	0.82
15	601601	中国太保	100,000	3,840,000.00	0.72
16	002532	天山铝业	500,000	3,785,000.00	0.71
17	600038	中直股份	50,000	3,135,500.00	0.59
18	000887	中鼎股份	99,995	1,170,941.45	0.22
19	688185	康希诺	2,519	895,353.36	0.17
20	688256	寒武纪	5,998	860,173.18	0.16
21	688408	中信博	4,450	714,136.00	0.13
22	688311	盟升电子	4,182	481,975.50	0.09
23	688580	伟思医疗	3,439	338,053.70	0.06
24	688578	艾力斯	10,324	278,231.80	0.05
25	688221	前沿生物	13,536	243,106.56	0.05
26	688330	宏力达	2,755	214,063.50	0.04
27	688550	瑞联新材	2,539	213,402.95	0.04
28	300896	爱美客	223	134,683.08	0.03

29	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
30	300869	康泰医学	862	95,526.84	0.02
31	688698	伟创电气	4,751	80,576.96	0.02
32	688590	新致软件	4,171	78,206.25	0.01
33	300919	中伟股份	610	47,043.20	0.01
34	300861	美畅股份	782	39,944.56	0.01
35	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
36	300860	锋尚文化	260	32,926.40	0.01
37	300870	欧陆通	478	31,380.70	0.01
38	300894	火星人	628	29,459.48	0.01
39	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
40	300877	金春股份	569	28,922.27	0.01
41	300910	瑞丰新材	474	28,259.88	0.01
42	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
43	300908	仲景食品	285	21,035.85	0.00
44	300873	海晨股份	484	19,994.04	0.00
45	300878	维康药业	401	19,532.71	0.00
46	300909	汇创达	386	19,361.76	0.00
47	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
48	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
49	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
50	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
51	300907	康平科技	473	16,342.15	0.00
52	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
53	300925	法本信息	353	15,775.57	0.00
54	300887	谱尼测试	210	15,642.90	0.00
55	300864	南大环境	166	15,077.78	0.00
56	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
57	300890	翔丰华	286	13,968.24	0.00
58	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
59	300876	蒙泰高新	350	12,813.50	0.00
60	300879	大叶股份	466	12,647.24	0.00
61	300911	亿田智能	309	12,149.88	0.00
62	300918	南山智尚	1,063	11,905.60	0.00
63	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
64	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
65	300922	天秦装备	287	10,555.86	0.00
66	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
67	300881	盛德鑫泰	291	9,399.30	0.00

68	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
69	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
70	300886	华业香料	147	6,710.55	0.00
71	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600606	绿地控股	18,479,955.63	7.31
2	002968	新大正	16,391,129.25	6.48
3	000651	格力电器	14,629,744.36	5.78
4	601318	中国平安	13,418,365.53	5.30
5	000100	TCL 科技	13,072,212.00	5.17
6	000002	万 科 A	11,832,868.77	4.68
7	601899	紫金矿业	11,770,482.00	4.65
8	002128	露天煤业	11,732,719.00	4.64
9	000540	中天金融	11,650,034.11	4.61
10	300012	华测检测	11,134,687.76	4.40
11	601166	兴业银行	10,913,813.00	4.31
12	600048	保利地产	9,602,491.74	3.80
13	603983	丸美股份	9,301,514.00	3.68
14	000333	美的集团	9,189,804.86	3.63
15	001914	招商积余	8,947,973.89	3.54
16	603605	珀莱雅	8,796,058.00	3.48
17	600739	辽宁成大	8,514,950.72	3.37
18	600966	博汇纸业	8,486,953.86	3.36
19	603818	曲美家居	8,424,559.00	3.33
20	603833	欧派家居	7,632,638.10	3.02
21	002142	宁波银行	7,241,234.99	2.86
22	601088	中国神华	6,473,956.28	2.56
23	601816	京沪高铁	6,319,848.88	2.50
24	603801	志邦家居	5,763,994.40	2.28
25	002460	赣锋锂业	5,644,430.00	2.23
26	600115	东方航空	5,417,724.51	2.14

27	603659	璞泰来	5,400,677.00	2.14
28	600362	江西铜业	5,168,347.00	2.04

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600606	绿地控股	18,005,284.00	7.12
2	601988	中国银行	14,083,422.00	5.57
3	688981	中芯国际	13,604,289.10	5.38
4	000100	TCL 科技	13,440,966.00	5.31
5	000651	格力电器	13,110,466.06	5.18
6	601939	建设银行	12,821,451.20	5.07
7	000002	万 科 A	12,789,737.68	5.06
8	601398	工商银行	12,297,346.00	4.86
9	000540	中天金融	10,891,292.00	4.31
10	600739	辽宁成大	10,247,303.85	4.05
11	603605	珀莱雅	9,329,316.03	3.69
12	601818	光大银行	8,356,632.46	3.30
13	601816	京沪高铁	8,145,719.51	3.22
14	603818	曲美家居	7,815,220.00	3.09
15	603983	丸美股份	7,789,525.00	3.08
16	601088	中国神华	7,664,787.00	3.03
17	603833	欧派家居	7,258,885.00	2.87
18	603659	璞泰来	5,767,837.00	2.28
19	603801	志邦家居	5,660,609.08	2.24
20	002460	赣锋锂业	5,449,940.60	2.15
21	000725	京东方 A	5,210,991.00	2.06
22	600115	东方航空	5,059,704.00	2.00

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元



买入股票成本（成交）总额	358,710,339.02
卖出股票收入（成交）总额	315,763,536.07

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,155,000.00	24.44
	其中：政策性金融债	130,155,000.00	24.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	75,073,500.00	14.10
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	205,228,500.00	38.54

### 8.6 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	200216	20 国开 16	1,000,000	100,170,000.00	18.81
2	012004270	20 龙源电力 SCP016	250,000	24,997,500.00	4.69
3	012001270	20 甬交投 SCP004	200,000	20,054,000.00	3.77
4	012002487	20 宝钢 SCP016	200,000	20,018,000.00	3.76
5	200201	20 国开 01	200,000	20,002,000.00	3.76

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

## 8.9 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

本报告期末本基金未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

本基金所持有的兴业银行(601166)于近一年内公告了兴业银行股份有限公司南京分行等多个分支机构被中国银行保险监督管理委员会江苏监管局等监管机构分别处以处罚,主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。兴业银行(601166)于近一年内公告了赵洲等多位分支行高管被中国银行保险监督管理委员会河北监管局等监管机构分别处以处罚,违法事实涉及:对兴业银行石家庄分行违规办理同业投资业务负直接经办责任等。

本基金所持有的贵州茅台(600519)于2020年12月31日公告,公司时任董事董事长高卫东被上交所予以监管关注。主要内容为“经查明,2020年12月16日,贵州茅台酒股份有限公司(以下简称贵州茅台或公司)召开2020年度贵州茅台酱香系列酒全国经销商联谊会。会议上公司董事长高卫东表示,公司2020年预计可完成酱香系列酒销量2.95万吨,实现含税销售额106亿元,同比增长4%。同时,多家媒体对会议内容进行报道,引发了市场和投资者的广泛关注。近期,白酒板块上市公司受到投资者及媒体的广泛关注,相关公司的产销情况及业绩信息是市场高度关注的热点信息,可能对公司股票交易及投资者决策产生较大影响。高卫东作为公司时任董事长,通过非法定信息披露渠道自行对外发布涉及公司经营的重要信息。鉴于上述违规事实和情节,根据《股票上市规则》第17.1条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》有关规定,我部做出如下监管措施决定:对贵州茅台酒股份有限公司时任董事长高卫东予以监管关注。”

公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序:

(1) 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议,讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资

超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资兴业银行主要基于以下原因：基本面向好，贷款利率和业绩增速均已迎来拐点，在经济数据改善和年底估值切换的催化下，有望重启上涨行情。

本基金投资贵州茅台主要基于以下原因：国内白酒行业出现弱复苏强分化特征，龙头企业集中度进一步提升，公司是国内白酒龙头，主打高端酒价位段，拥有绝对强的品牌壁垒，业绩表现良好、财务指标过硬。我们认为公司具备较宽的护城河，在国内白酒行业分化的背景之下，公司作为全国化高端龙头具备投资价值。

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

### 8.12.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 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	90,788.44
2	应收证券清算款	6,356,784.44
3	应收股利	-
4	应收利息	1,933,294.20
5	应收申购款	25.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,380,892.08

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(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
东方新价值混合 A	882	228,367.69	199,894,583.54	99.24%	1,525,721.74	0.76%
东方新价值混合 C	51	3,903,985.31	199,021,465.29	99.96%	81,785.45	0.04%
合计	933	429,285.70	398,916,048.83	99.60%	1,607,507.19	0.40%

### 9.2 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	东方新价值混合 A	0.00	0.00%
	东方新价值混合 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

### 9.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方新价值混合 A	0
	东方新价值混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方新价值混合 A	0
	东方新价值混合 C	0
	合计	0

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方新价值混合 A	东方新价值混合 C
基金合同生效日（2015 年 7 月 3 日）基金份额总额	423,027,979.88	-
本报告期期初基金份额总额	46,799,989.11	181,690,050.06
本报告期基金总申购份额	201,292,552.96	179,675,358.88
减:本报告期基金总赎回份额	46,672,236.79	162,262,158.20
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	201,420,305.28	199,103,250.74

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2020 年 7 月 1 日，公司发布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。

2020 年 8 月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 55,000.00 元；截至 2020 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 6 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券股份有限公司	2	354,014,255.39	55.56%	329,687.02	55.56%	-
浙商证券股份有限公司	2	163,945,728.81	25.73%	152,683.89	25.73%	-



太平洋证券股份有限公司	2	119,249,444.98	18.71%	111,051.92	18.71%	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	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要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，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浙商证券股份有限公司上海、深圳交易席位各一个。

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券股份有限公司	231,146.56	35.97%	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	411,530.88	64.03%	-	-	-	-

申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	东方新价值混合型证券投资基金 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
6	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
7	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
8	东方新价值混合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	2020 年 3 月 11 日

		网站	
9	东方新价值混合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
10	东方新价值混合型证券投资基金托管协议(2020年3月修订)	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	东方新价值混合型证券投资基金基金合同(2020年3月修订)	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
13	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
14	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
15	东方新价值混合型证券投资基金2019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
16	东方新价值混合型证券投资基金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
17	东方新价值混合型证券投资基金恢复10万元以上(不含10万元)申购、转换转入、定期定额投资公告	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4月25日
18	东方基金管理有限责任公司关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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4月25日
19	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	2020年4月30日

		基金电子披露网站	
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	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
27	东方新价值混合型证券投资基金暂停100万元以上（不含100万元）申购、转换转入、定期定额投资公告	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6月18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	2020年6月30日

		基金电子披露网站	
29	东方基金管理有限责任公司 半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 7 月 1 日
30	东方基金管理有限责任公司 高级管理人员变更公告	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 7 月 1 日
31	东方新价值混合型证券投资 基金 2020 年第 2 季度报告	基金管理人网站及 中国证监会基金电 子披露网站	2020 年 7 月 21 日
32	东方新价值混合型证券投资 基金招募说明书(更新)摘要 (2020 年第 2 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 8 月 15 日
33	东方新价值混合型证券投资 基金招募说明书(更新)(2020 年第 2 号)	基金管理人网站及 中国证监会基金电 子披露网站	2020 年 8 月 15 日
34	东方基金管理股份有限公司 关于公司法定名称变更的公 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 8 月 22 日
35	东方基金管理股份有限公司 高级管理人员变更公告	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 8 月 24 日
36	东方新价值混合型证券投资 基金招募说明书(更新)(2020 年第 3 号)	基金管理人网站及 中国证监会基金电 子披露网站	2020 年 8 月 25 日
37	东方新价值混合型证券投资 基金招募说明书(更新)摘要 (2020 年第 3 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 8 月 25 日
38	东方基金管理股份有限公司 关于旗下部分基金参与恒泰 证券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 8 月 28 日
39	东方新价值混合型证券投资 基金 2020 年中期报告	基金管理人网站及 中国证监会基金电 子披露网站	2020 年 8 月 29 日

40	东方新价值混合型证券投资基金基金产品资料概要	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 8 月 31 日
41	关于增加北京植信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 9 月 9 日
42	东方基金管理股份有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	基金管理人网站	2020 年 9 月 14 日
43	关于旗下部分基金参与中国银行申购以及定期定额投资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 9 月 19 日
44	关于旗下部分基金参与招商银行招赢通平台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 9 月 30 日
45	东方新价值混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 28 日
46	东方基金管理股份有限公司关于终止大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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 11 月 11 日
47	东方基金管理股份有限公司关于对旗下基金持有的债券调整估值的公告	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 11 月 13 日
48	关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司及申万宏源西部证券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 11 月 20 日
49	关于旗下部分基金参与中国银河证券股份有限公司等 10 家销售机构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 11 月 28 日

50	关于旗下部分基金参与上海天天基金销售有限公司等 48 家销售机构费率优惠的公告	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 11 月 28 日
51	东方基金管理股份有限公司关于终止泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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 12 月 15 日
52	关于继续参加中国工商银行开展个人电子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 12 月 18 日
53	关于继续参加中国工商银行 AI 投服务基金申购费率优惠活动	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 12 月 18 日
54	关于继续参加中国工商银行 2020 倾心回馈基金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 12 月 18 日
55	东方基金管理股份有限公司关于设立海口分公司的公告	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 12 月 19 日
56	关于增加东北证券股份有限公司和光大证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	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 12 月 22 日
57	关于旗下部分基金继续参与交通银行基金申购及定投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 12 月 30 日
58	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	2020 年 12 月 30 日

---

		基金电子披露网站	
--	--	----------	--



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200204 - 20200607	43,939,713.50	-	43,939,713.50	-	-
	2	20200101 - 20200705	73,292,289.65	68,641,652.62	73,292,289.65	68,641,652.62	17.14%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品	1	20200204 - 20200607	43,975,373.79	-	-	43,975,373.79	10.98%
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。</p>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 一、《东方新价值混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方新价值混合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

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2021 年 3 月 26 日