

东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金

2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人:东兴证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 03 月 31 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3月29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。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自2020年4月15日（基金合同生效日）起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	45
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
8.12 投资组合报告附注.....	46
§9 基金份额持有人信息.....	47
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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情况.....	47
§10 开放式基金份额变动.....	47
§11 重大事件揭示.....	47
11.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
11.4 基金投资策略的改变.....	48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
11.8 其他重大事件.....	50
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	50
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§13 备查文件目录.....	51
13.1 备查文件目录.....	51
13.2 存放地点.....	51
13.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金
基金简称	东兴鑫远三年定开
基金主代码	008165
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年04月15日
基金管理人	东兴证券股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,030,216,831.25份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。主要策略含资产配置策略，银行定期存款、协议存款及大额存单投资策略，信用债投资策略，杠杆投资策略，再投资策略，资产支持证券投资策略。开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。
业绩比较基准	当期封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构三年定期存款利率（税后）+0.25%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	东兴证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王微
	联系电话	95309
	电子邮箱	dxfund@dxzq.net.cn
客户服务电话	95309	95555
传真	010-57307388	0755-83195201
注册地址	北京市西城区金融大街5号 (新盛大厦) 12、15层	深圳市深南大道7088号招商 银行大厦
办公地址	北京市西城区平安里西大街2 8号中海国际中心6层	深圳市深南大道7088号招商 银行大厦
邮政编码	100035	518040
法定代表人	魏庆华	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人 互联网网址	www.fund.dxzq.net
基金年度报告备置地点	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊 普通合伙)	北京市朝阳区针织路23号中国人寿 金融中心10层
注册登记机构	东兴证券股份有限公司	北京市西城区平安里西大街28号中 海国际中心6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	本期2020年04月15日(基金合同生效日) - 2020年12月 31日
---------------	--

本期已实现收益	23,461,480.25
本期利润	23,461,480.25
加权平均基金份额本期利润	0.0116
本期加权平均净值利润率	1.15%
本期基金份额净值增长率	1.16%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末
期末可供分配利润	3,159,313.86
期末可供分配基金份额利润	0.0016
期末基金资产净值	2,033,376,145.11
期末基金份额净值	1.0016
3.1.3 累计期末指标	2020年末
基金份额累计净值增长率	1.16%

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、所述基金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、本基金基金合同于2020年4月15日生效，无可比期间数据，本报告实际报告期为2020年4月15日至2020年12月31日。

3.2 基金净值表现

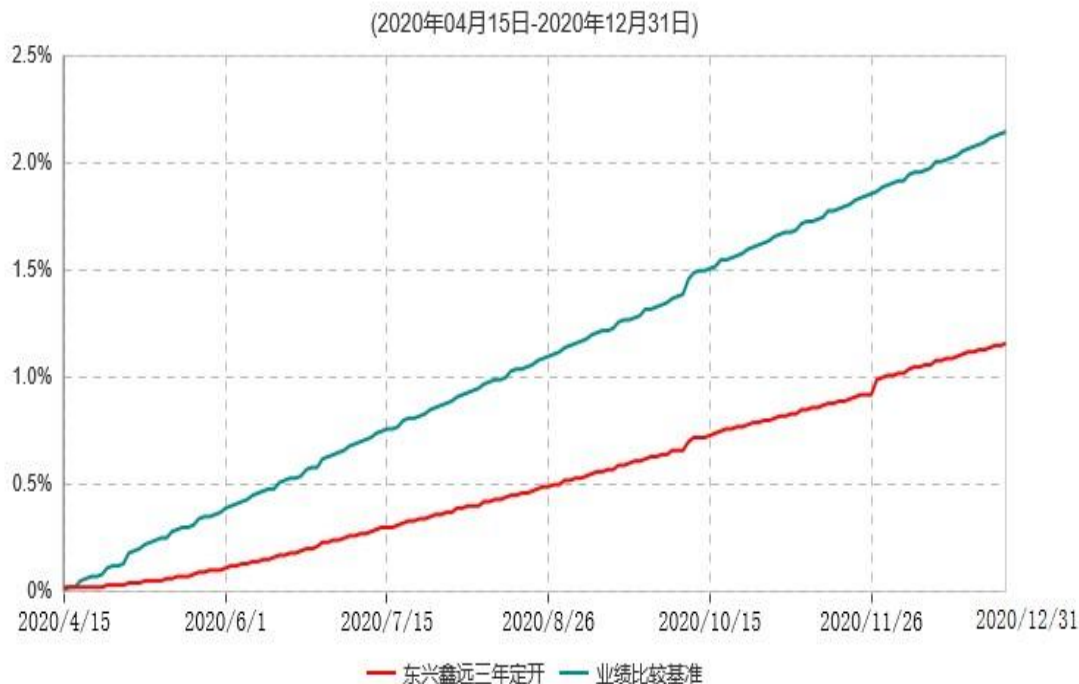
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.50%	0.01%	0.76%	0.01%	-0.26%	0.00%
过去六个月	0.93%	0.01%	1.51%	0.01%	-0.58%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.16%	0.01%	2.15%	0.01%	-0.99%	0.00%

注：本基金基金合同于2020年4月15日生效，截至本报告期末（2020年12月31日）不满一年。

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

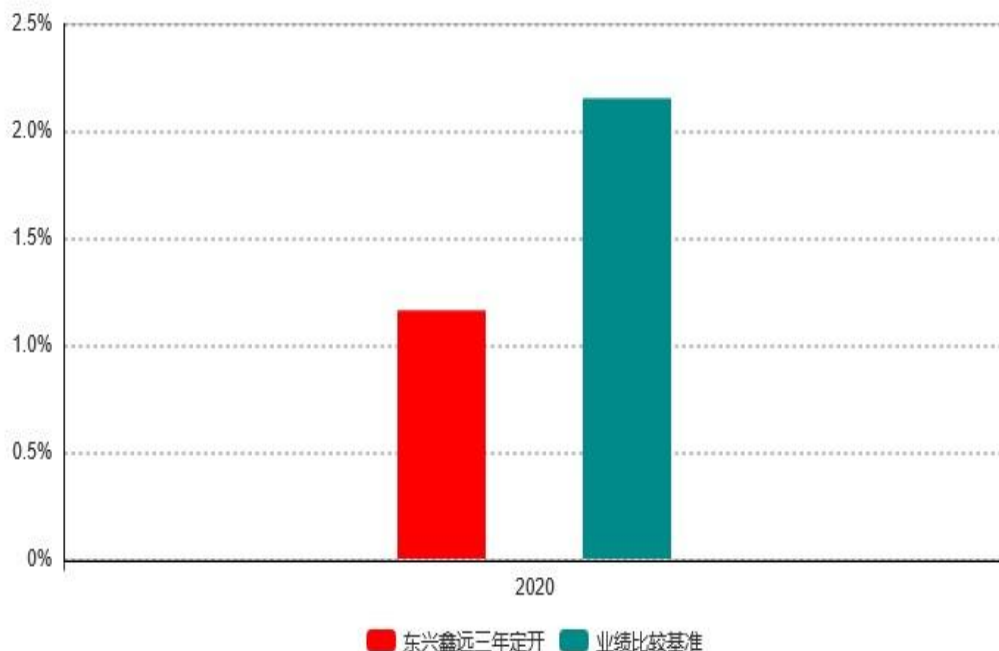
东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为2020年4月15日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内，截止本报告期末距建仓期结束不满一年；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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



注：本基金基金合同于2020年4月15日生效，自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020年	0.100	20,302,034.57	131.99	20,302,166.56	-
合计	0.100	20,302,034.57	131.99	20,302,166.56	-

§ 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

东兴证券股份有限公司（股票简称“东兴证券”，股票代码“601198”，以下简称“本公司”）是2008年经财政部和中国证监会批准，由中国东方资产管理公司作为主要发起人发起设立的全国性综合类证券公司，2015年2月26日在上海证券交易所上市，是国内首家资产管理公司系上市证券公司。

本公司注册资本27.58亿元，总部设在北京。公司业务涵盖证券经纪、证券投资咨询、与证券交易和证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券投资基金销售

业务、证券自营和证券资产管理业务、融资融券业务、代销金融产品业务、公开募集证券投资基金管理业务，形成覆盖场内与场外、线下和线上、国内和海外的综合金融服务体系。

本公司经中国证券监督管理委员会核准（证监许可【2015】67号）于2015年1月8日获得公开募集证券投资基金管理业务资格。截至2020年12月31日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴核心成长混合型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金共16只开放式基金。

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		
张琳娜女士	本基金基金经理	2020-04-15	-	13年	金融学硕士毕业，13年证券基金行业从业经历。2007年4月至2012年2月任益民基金集中交易部交易员、副总经理，2012年3月至2018年1月任英大基金交易管理部副总经理，固定收益部总经理、基金经理，2018年1月12日加入东兴证券。现任东兴安盈宝货币市场基金基金经理、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴财短债债券型证券投资基金基金经理、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资

					资基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》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》，制定了《东兴证券股份有限公司基金业务公平交易管理办法（修订）》。

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，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，部门应按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由投资总监决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易室根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

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，未直接或通过与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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

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。

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年由于受新冠疫情的冲击，债券市场经历了大起大落的过山车行情。一季度，为应对新冠疫情对经济造成的巨大冲击，货币政策显著宽松，一系列的降准、降息等工具带动市场利率快速下行并创历史新低；二季度末期，随着经济底部企稳回升的动力不断增强，央行货币政策回归正常化，市场利率整体向上，重新回到了2019年年末的位置。

操作上，本基金以摊余成本法估值，在收益上行的过程中逐步进行加仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020年4月15日（基金合同生效日）起至2020年12月31日，本基金净值增长率为1.16%，业绩比较基准收益率为2.15%，低于业绩比较基准0.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年是经济基本面的复苏之年，货币政策虽然“不急转弯”，但社融与M2大概率已于去年11月份见顶，我国的债券市场呈现明显的周期性波动特征，历史上看经济复苏的中后段与融资回落的中期通常对应着债券最佳的配置窗口，整体来说今年对于债券市场风险与机会并存。

操作上，在2021年波动明显加大的环境下，把握住大方向的前提下，有序安排融资期限，以期达到控制融资成本的目的。

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，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织多项法律法规和职业道德培训，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，顺应“放松管制、加强监管”的监管形势，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金在报告期内实施利润分配1次。2020年12月24日，东兴鑫远三年定开每10份基金份额分配0.100元，利润分配金额为20,302,166.56元。

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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金持有人数量不满二百人或者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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	德师报(审)字(21)第P01552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	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金的财务报表，包括2020年12月31日的资产负债表、2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。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和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金2020年12月31日的财务状况以及2020年4月15日（基金合同生

	效日)至2020年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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，我们独立于东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金，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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	东兴证券股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。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。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。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。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资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，除非基金管理人管理层计划清算东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。

	<p>告。合理保证是高水平的保证，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。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，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(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。(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。(3) 评价基金管理人管理层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。(4) 对基金管理人管理层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，就可能对东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资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兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、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>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	杨小真、王亚坤
会计师事务所的地址	北京市朝阳区针织路23号中国人寿金融中心10层
审计报告日期	2021-03-29

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	223,642.67
结算备付金		208,154.84
存出保证金		5,322.55
交易性金融资产	7.4.7.2	-
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	43,755,401.58
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	2,807,470,236.36
资产总计		2,851,662,758.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日
负 债：		
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		817,150,124.27
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		260,142.63
应付托管费		86,714.22
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	23,620.61
应交税费		-
应付利息		671,511.16
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	94,500.00
负债合计		818,286,612.89
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	2,030,216,831.25
未分配利润	7.4.7.10	3,159,313.86
所有者权益合计		2,033,376,145.11
负债和所有者权益总计		2,851,662,758.00

注：1、报告截止日2020年12月31日，基金份额净值1.0016元，基金份额总额2,030,216,831.25份。

2、本基金基金合同于2020年4月15日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2020年4月15日至2020年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
一、收入		35,509,509.12
1. 利息收入		35,199,350.36

其中：存款利息收入	7.4.7.11	714,869.20
债券利息收入		33,481,977.92
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,002,503.24
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
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	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	310,158.76
减：二、费用		12,048,028.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,631,538.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	877,179.58
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	-
5. 利息支出		8,435,549.01
其中：卖出回购金融资产支出		8,435,549.01
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	103,761.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,461,480.25
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,461,480.25

注：本基金基金合同于2020年4月15日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2020年4月15日至2020年12月31日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年04月15日（基金合同生效日）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）	2,030,216,699.43	-	2,030,216,699.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,461,480.25	23,461,480.25
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）	131.82	0.17	131.99
其中：1. 基金申购款	131.82	0.17	131.99
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）	-	-20,302,166.56	-20,302,166.56
五、期末所有者权益（基金净值）	2,030,216,831.25	3,159,313.86	2,033,376,145.11

注：本基金基金合同于2020年4月15日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2020年4月15日至2020年12月31日。

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：

魏庆华

张涛

王青

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

东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2019年10月11日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]1900号）的批复，自2020年1月6日至2020年4月3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2,030,052,864.49元人民币，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）“德师报(验)字(20)第00153号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2020年4月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,030,216,699.43份，其中认购资金利息折合163,834.94份。本基金基金管理人为东兴证券股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券(包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具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)。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%。但为开放期流动性需要，保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金所持有现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；在封闭期内，本基金不受该比例的限制。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人根据法律法规的规定或在履行适当程序后对上述资产配置比例进行适当调整。

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2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》（财政部令第33号发布、财政部令第76号修订）、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会制定的《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内容与格式准则第2号-年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号-会计报表附注的编制及披露》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4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日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。本期财务报表的实际编制期间为2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

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

本基金采用买入并持有至到期策略，因此将所持有的债券投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。持有至到期投资按照摊余成本进行计量，在其他资产中核算。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同的一方时，于资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含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。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内按照实际利率法摊销，确认利息收入并评估减值准备。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。以摊余成本计量的金融资产按下述原则评估减值损失：

当以摊余成本计量的金融资产的预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)按原实际利率折现的现值低于其账面价值时，本基金将该以摊余成本计量的金融资产的账面价值减记至该现值，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益。在以摊余成本计量的金融资产确认减值损失后，如有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，本基金将原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。该转回后的账面价值不超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- (2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- (3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

如有确凿证据表明本基金在封闭期内买入持有至到期的投资策略发生变化或其他原因，导致按原有摊余成本法估值不能客观反映上述金融资产或负债于开放期内的公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映金融资产或金融负债于开放期内的公允价值的方法估值。

本基金在计算偏离度时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估

值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

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基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期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

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，按债券的摊余成本与实际利率计算的金额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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同以及后续修订，基金管理费在2020年6月10日前按前一日基金资产净值的0.3%的年费率逐日计提；自2020年6月10日起按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提；

(2) 根据基金合同以及后续修订，基金托管费在2020年6月10日前按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；自2020年6月10日起按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（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；

(4) 其他费用

其他费用包括基金运作过程中发生的除上述费用支出以外的其他各项费用，如《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、审计费、公证费、律师费、仲裁费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、证券账户开户费用、银行账户维护费等。发生的其他费用，如不影响估值日份额净值小数点后第四位，发生时可直接计入基金损益，如果影响基金份额净值小数点后第四位的，采用待摊或预提的方法计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为1次，年度收益分配比例不得低于基金年度可供分配利润的90%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、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在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

3、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；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、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；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，并于变更实施日前在指定媒介上公告，且不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期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号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、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】2号《财政部、国家税务总局关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税【2017】56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》，主要税项列示如下：

1. 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自2018年1月1日起，在基金运营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。

2. 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，股权的股息、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。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6. 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，暂免于缴纳印花税、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
活期存款	223,642.67
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	223,642.67

7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

7.4.7.3 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。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末，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
应收活期存款利息	258.70
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	103.07
应收债券利息	43,755,037.17
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	2.64
合计	43,755,401.58

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
其他应收款	-
待摊费用	-
其他应收款	-
待摊费用	-
持有至到期投资	2,807,470,236.36
合计	2,807,470,236.36

注：本基金本报告期末持有的持有至到期投资列示如下：

1、各项持有至到期投资期末余额

截至本报告期末，本基金持有至到期投资中包括的交易所市场债券的余额为168,180,013.46元，银行间市场债券的余额为2,639,290,222.90元。

2、持有至到期投资减值准备

本基金本报告期末无需计提持有至到期投资减值准备。

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
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	23,620.61
合计	23,620.61

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
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	94,500.00
合计	94,500.00

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。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,030,216,699.43	2,030,216,699.43
本期申购	131.82	131.82
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,030,216,831.25	2,030,216,831.25

注：本基金基金合同于2020年4月15日生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,030,216,699.43份，其中：认购资金本金折算基金份额为：2,030,052,864.49份，利息折算基金份额为：163,834.94份。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	23,461,480.25	-	23,461,480.25
本期基金份额交易产生的变动数	0.17	-	0.17
其中：基金申购款	0.17	-	0.17
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-20,302,166.56	-	-20,302,166.56
本期末	3,159,313.86	-	3,159,313.86

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	342,058.86
定期存款利息收入	327,222.22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	45,553.51
其他	34.61
合计	714,869.20

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日无股票投资收益。

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

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日无债券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	-
其他	310,158.76
合计	310,158.76

7.4.7.19 交易费用

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	20,000.00
信息披露费	70,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,261.48
账户维护费	10,500.00
合计	103,761.48

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生改变。

关联方名称	与本基金的关系
中国东方资产管理股份有限公司	基金管理人的控股股东
东兴证券股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
中华联合财产保险股份有限公司	与基金管理人同一控股股东的关联方

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

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	171,243,676.30	100.00%

注：本基金基金合同生效日为2020年4月15日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
-------	--

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	6,795,710,000.00	100.00%

注：本基金基金合同生效日为2020年4月15日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年12月31日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 2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,631,538.80
其中：支付销售机构的客户维护费	12.08

注：1、根据基金合同以及后续修订，基金管理费在2020年6月10日前按前一日基金资产净值的0.3%的年费率逐日计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

自2020年6月10日起按前一日基金资产净值的0.15%年费率逐日计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计算，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5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、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、本基金基金合同于2020年4月15日生效，无可比期间数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	877,179.58

注：1、根据基金合同以及后续修订，基金托管费在2020年6月10日前按前一日基金资产净值的0.1%的年费率逐日计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

自2020年6月10日起按前一日基金资产净值的0.05%年费率逐日计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计算，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5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、本基金基金合同于2020年4月15日生效，无可比期间数据。

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

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日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2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年12月31日未发生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。

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2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年12月31日未发生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。

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

份额单位：份

项目	本期
	2020年04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金合同生效日（2020年04月15日）持有的基金份额	310,008,472.22
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	310,008,472.22
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.27%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用按招募说明书中规定的费率收取。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末	
	2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商银行股份有限公司	600,017,333.33	29.55%
中国东方资产管理股份有限公司	100,014,277.77	4.93%
中华联合财产保险股份有限公司	50,008,166.66	2.46%

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04月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	223,642.67	342,058.86

注：由招商银行股份有限公司保管的银行存款为活期存款，利息收入为活期存款利息收入。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式发放 总额	本期利润 分配合计	备注
1	2020-12-24	2020-12-24	0.100	20,302,034.57	131.99	20,302,166.56	-
合计			0.100	20,302,034.57	131.99	20,302,166.56	-

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

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。

7.4.12.2 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暂时停牌等流通受限的股票。

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，本基金从事银行间市场正回购交易形成的卖出回购证券款余额797,150,124.27元，是以如下债券作为抵押：

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
200303	20进出03	2021-01-04	98.23	3,385,000	332,508,550.00
200303	20进出03	2021-01-06	98.23	1,053,000	103,436,190.00
200402	20农发02	2021-01-04	100.41	3,002,000	301,430,820.00
200402	20农发02	2021-01-08	100.41	1,053,000	105,731,730.00
合计				8,493,000	843,107,290.00

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，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20,000,000.00元，将于2021年1月4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。

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、风险管理部和合规法律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；本基金持有一家公司发行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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末持有的政策性金融债，未包含在按短期信用评级列示的债券投资中。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有同业存单。

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 2020年12月31日
AAA	1,280,489,779.14
AAA以下	-
未评级	-
合计	1,280,489,779.14

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金通过设定单一投资者申购金额上限、收取强制赎回费、拒绝大额申购、暂停基金申购、暂停赎回或延缓支付赎回款项等措施控制基金申购、赎回中的流动性风险。

本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具（包括国内依法发行上市的债券和货币市场工具等），同时本基金基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

本基金在发生巨额赎回时，将通过部分延期赎回、延缓支付赎回款项、摆动定价及中国证监会认定的其他措施对于巨额赎回情形下的流动性风险进行管理控制。

本基金运作过程中，将使用延期办理赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价及中国证监会认定的其他措施控制流动性风险。

（1）延期办理赎回申请、延缓支付赎回款项能够避免在巨额赎回时，因变现需求过大，市场交易量不足，导致证券不能低成本地转变为现金，进而对基金资产净值造成较大波动的情形，对基金份额持有人来说，存在不能及时赎回基金份额的风险。

（2）收取短期赎回费能够控制资金短期频繁的申购赎回，避免净值大幅的波动，维护净值稳定。

（3）在估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时采取暂停基金估值，通过延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请等措施可避免基金份额净值虚高或虚低给申购、赎回客户或存量客户造成损失，对基金份额持有人来说，存在不能及时赎回基金份额的风险。

（4）通过摆动定价将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待，当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

本基金以封闭期为基础进行投资运作，严格采用买入并持有到期策略构建投资组合，投资于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的债券类资产、债券回购和银行存款，力求基金资产在开放前可完全变现。如果封闭期末个别债券出现流动性不足的情形，可能对基金资产的全额变现造成影响。

7.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	223,642.67	-	-	-	-	-	223,642.67
结算备付金	208,154.84	-	-	-	-	-	208,154.84
存出保证金	5,322.55	-	-	-	-	-	5,322.55
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	43,755,401.58	43,755,401.58
其他资产	-	-	-	2,807,470,236.36	-	-	2,807,470,236.36
资产总计	437,120.06	-	-	2,807,470,236.36	-	43,755,401.58	2,851,662,758.00
负债							
卖出回购金融资产款	817,150,124.27	-	-	-	-	-	817,150,124.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	260,142.63	260,142.63
应付托管费	-	-	-	-	-	86,714.22	86,714.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	23,620.61	23,620.61
应付利息	-	-	-	-	-	671,511.16	671,511.16
其他负债	-	-	-	-	-	94,500.00	94,500.00
负债总计	817,150,124.27	-	-	-	-	1,136,488.62	818,286,612.89
利率敏感度缺口	-816,713,004.21	-	-	2,807,470,236.36	-	42,618,912.96	2,033,376,145.11

注：表中所示为本基金资产及负债的摊余成本，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

本基金对组合债券采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，因此市场利率变动对本基金的基金资产净值无重大影响。本基金的基金管理人主要通过合理配置债券组合的到期期限管理利率波动带来的利率风险。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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	
	摊余成本	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	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	2,807,470,236.36	138.07
合计	2,807,470,236.36	138.07

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 以公允价值计量的金融工具

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，无属于第一层次、第二层次及第三层次的余额。

(c) 公允价值所属层次间的重大变动

无。

(2) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、持有至到期投资和其他金融负债等。除持有至到期投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于2020年12月31日，本基金持有的持有至到期投资的账面价值为人民币2,807,470,236.36元，公允价值为人民币2,768,923,602.20元。本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次。

持有至到期投资按如下原则确定公允价值：

(a) 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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。

(b) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(c) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,807,470,236.36	98.45
	其中：债券	2,807,470,236.36	98.45
	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	-	-
	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	431,797.51	0.02
8	其他各项资产	43,760,724.13	1.53
9	合计	2,851,662,758.00	100.00

8.2 报告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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日未卖出股票。

8.4.3 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2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日未投资股票。

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,807,470,236.36	138.07
	其中：政策性金融债	1,526,980,457.22	75.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,807,470,236.36	138.07

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)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	200303	20进出03	7,700,000	756,340,217.68	37.20
2	200402	20农发02	6,000,000	602,460,226.08	29.63
3	1928034	19交通银行01	1,800,000	184,202,149.75	9.06
4	2020007	20北京银行小微债01	1,800,000	182,231,964.57	8.96
5	2028008	20民生银行小微债01	1,800,000	181,950,357.99	8.95

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	5,322.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,755,401.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,760,724.13

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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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

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
234	8,676,140.30	2,030,157,777.75	100.00%	59,053.50	0.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	107.05	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情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年04月15日)基金份额总额	2,030,216,699.43
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	131.82
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,030,216,831.25

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期2020年4月15日（基金合同生效日）至2020年12月31日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

本报告期内，本基金管理人的重大人事变动：

公司工会于2020年3月27日组织召开公司2020年第二次职工代表大会，选举公司第五届监事会职工代表监事。经全体职工代表审议，民主选举杜彬先生、郝洁女士为公司第五届监事会职工代表监事，详见《东兴证券股份有限公司关于关于选举第五届监事会职工代表监事的公告》（公告编号：2020-014）。

2020年4月30日，公司副总经理、合规总监兼首席风险官许学礼先生向董事会提交辞职报告，申请辞去公司首席风险官职务，自辞职报告送达董事会时生效。辞职后，许学礼先生继续担任公司副总经理、合规总监；经公司董事长魏庆华先生提名，并经董事会薪酬与提名委员会审议通过，公司第四届董事会第二十五次会议审议通过《关于聘任公司首席风险官的议案》，同意聘任赵慧文女士为公司首席风险官，详见《东兴证券股份有限公司关于关于公司首席风险官发生变动的公告》（公告编号：2020-028）。

2020年6月3日，公司第五届董事会第一次会议审议通过《关于选举公司董事长的议案》、《关于选举董事会专门委员会成员的议案》、《关于聘任公司总经理的议案》、《关于聘任公司其他高级管理人员的议案》、《关于聘任公司证券事务代表的议案》等高级管理人员聘任议案，详见《东兴证券股份有限公司第五届董事会第一次会议决议公告》（公告编号：2020-035）。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

自2020年8月28日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内涉及基金管理人的诉讼：详见本公司在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）刊登的《东兴证券股份有限公司关于公司涉及诉讼的进展公告》（公告日：2020年1月4日）、《东兴证券股份有限公司关于公司涉及诉讼的进展公告》（公告日：2020年1月20日）、《东兴证券股份有限公司涉及诉讼的进展公告》（公告日：2020年4月30日）、《东兴证券股份有限公司关于累计涉及诉讼事项的公告》（公告日：2020年10月13日）。

本报告期内，无涉及基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘会计师事务所,本报告期应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用20,000.00元。

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,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受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	
东兴证券股份有限公司	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:财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上,且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

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、由于交易所系统限制,本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能在租赁其他证券公司的交易单元。

4、本基金本报告期内的租用2个交易单元,分别为东兴证券股份有限公司上海交易所交易单元及深圳交易所交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券股份	171,243,676.30	100.00%	6,795,710,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	关于东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金延期结束募集的公告	指定报刊、指定网站	2020-03-14
2	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告	指定网站、指定报刊	2020-04-16
3	东兴证券股份有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司代销旗下基金业务的公告	指定网站、指定报刊	2020-05-07
4	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金降低管理费率托管费率的公告	指定网站、指定报刊	2020-06-10
5	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金基金合同	指定网站	2020-06-10
6	东兴鑫远三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）	指定网站	2020-06-12
7	东兴鑫远三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）	指定网站	2020-06-12
8	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金半年度最后一个市场交易日净值公告	指定网站	2020-07-01
9	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金2020年第二季度报告	指定网站	2020-07-21
10	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定网站	2020-08-31
11	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金2020年中期报告	指定网站	2020-08-31
12	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金2020年第三季度报告	指定网站	2020-10-28
13	东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金分红公告	指定网站、指定报刊	2020-12-23

§ 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	2020年4月15日至2020年12月31日	0.00	600,017,333.33	0.00	600,017,333.33	29.55%

2	2020年4月15日至2020年12月31日	0.00	670,101,361.11	0.00	670,101,361.11	33.01%
产品特有风险						
<p>1、本基金在封闭期内不开放基金份额的申购与赎回，投资人在封闭运作期间存在无法按照基金份额净值进行赎回的风险。</p> <p>2、本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿还风险等风险，可能影响基金整体收益。</p> <p>3、信用风险对本基金买入持有到期投资策略的影响 为控制本基金的信用风险，本基金将定期对所投债券的信用资质和发行人的偿付能力进行评估。对于存在信用风险隐患的发行人所发行的债券，及时制定风险处置预案。封闭期内，如本基金持有债券的信用风险显著增加时，为减少信用损失，本基金将对该债券进行处置。</p> <p>4、基金封闭期到期日因部分资产无法变现或者无法以合理价格变现导致基金部分资产尚未变现的，基金将暂停进入下一开放期，封闭期结束的下一个工作日，基金份额应全部自动赎回，按已变现的基金财产支付部分赎回款项，未变现资产对应赎回款延缓支付，待该部分资产变现后支付剩余赎回款。赎回价格按全部资产最终变现净额确定。基金管理人应就上述延缓支付部分赎回款项的原因和安排在封闭期结束后的下一个工作日发布公告并提示最终赎回价格与封闭期到期日的净值可能存在差异的风险。</p> <p>5、在封闭期内，本基金采用买入并持有至到期策略，一般情况下，持有的固定收益类品种和结构在封闭期内不会发生变化，在行情波动时，可能损失一定的交易收益。</p> <p>6、本基金定期对持有的固定收益品种的账面价值进行检查，如有客观证据表明其发生了减值的，应当与托管人协商一致后对所投资资产计算确认减值损失。因此，摊余成本法估值不等同于保本，基金资产发生计提减值准备可能导致基金份额净值下跌。</p>						

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 一、中国证监会核准东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会关于核准东兴证券股份有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复、营业执照、公司章程

13.2 存放地点

北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

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.fund.dxzq.net)查阅。

东兴证券股份有限公司

二〇二一年三月三十一日