

# 东方新价值混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 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：二〇二二年三月二十五日

## § 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 24 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 2021 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.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>21</b>
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>23</b>
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<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.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	67

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<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	227,486,290.01 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	91,090,514.31 份	136,395,775.70 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	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 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	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	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 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	2021 年		2020 年		2019 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	22,489,055.39	20,671,457.95	24,044,992.75	24,870,075.41	-1,002,536.97	3,911,202.37
本期利润	12,093,074.36	11,136,454.17	30,523,347.54	34,419,025.45	2,621,566.05	10,591,058.52
加权平均基金份额本期利润	0.0674	0.0615	0.2025	0.1709	0.1071	0.1587
本期加权平均	4.66%	4.75%	14.99%	14.44%	9.23%	15.04%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	5.30%	4.98%	16.44%	16.07%	4.64%	4.43%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	19,428,790.23	10,755,704.91	16,992,933.32	-6,470,466.99	-2,584,126.59	-28,014,235.38
期末可供分配基金份额利润	0.2133	0.0789	0.0844	-0.0325	-0.0552	-0.1542



期末基金资产净值	134,523,070 .25	179,833,572 .54	282,488,625 .76	250,050,809 .03	56,369,280 .80	196,584,134 .06
期末基金份额净值	1.4768	1.3185	1.4025	1.2559	1.2045	1.0820
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	47.68%	27.90%	40.25%	21.83%	20.45%	8.20%

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	0.76%	0.41%	0.76%	0.01%	0.00%	0.40%
过去六个月	1.82%	0.39%	1.51%	0.01%	0.31%	0.38%
过去一年	5.30%	0.41%	3.00%	0.01%	2.30%	0.40%
过去三年	28.29%	0.41%	9.00%	0.01%	19.29%	0.40%
过去五年	35.81%	0.43%	15.00%	0.01%	20.81%	0.42%
自基金合同生效起至今	47.68%	0.67%	19.72%	0.01%	27.96%	0.66%

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	0.69%	0.41%	0.76%	0.01%	-0.07%	0.40%
过去六个月	1.67%	0.39%	1.51%	0.01%	0.16%	0.38%
过去一年	4.98%	0.41%	3.00%	0.01%	1.98%	0.40%
过去三年	27.26%	0.41%	9.00%	0.01%	18.26%	0.40%
过去五年	33.79%	0.43%	15.00%	0.01%	18.79%	0.42%
自基金合同生效起至今	27.90%	0.59%	18.35%	0.01%	9.55%	0.58%

### 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

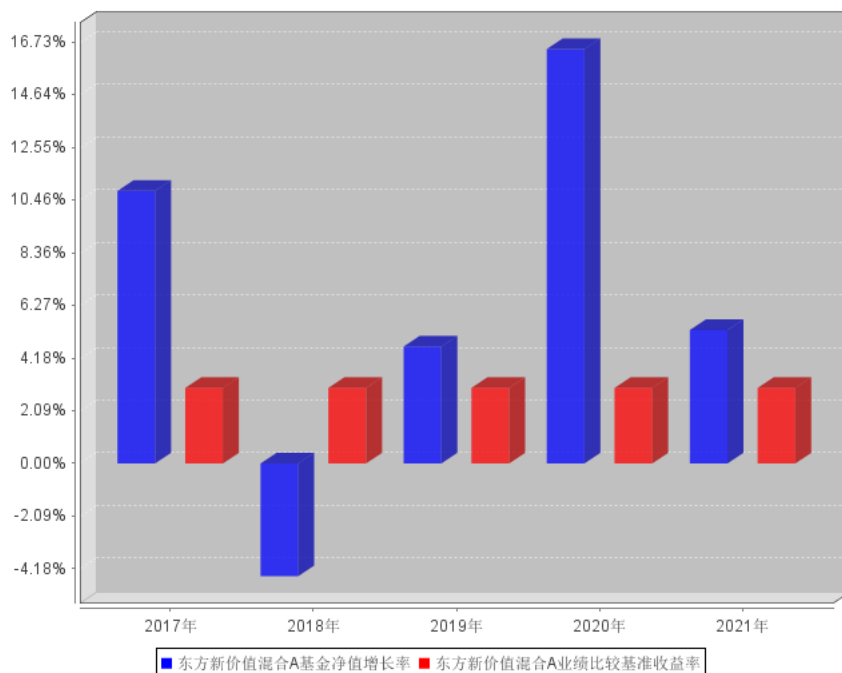


东方新价值混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

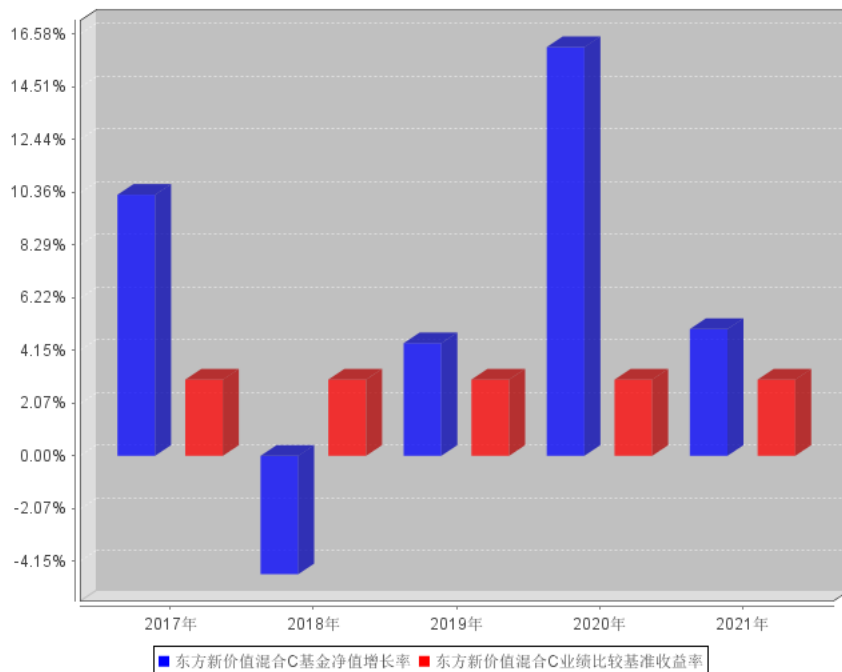


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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2021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2021年12月31日，本公司管理55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、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯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	-	14 年	山西大学工商管理、应用心理学专业学士，14 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

					<p>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、东方周期优选灵活配置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、东方中国红利混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：①2022 年 2 月 15 日，公司发布了《东方新价值混合型证券投资基金基金经理变更公告》、《东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自 2022 年 2 月 15 日起薛子徵先生不再担任东方新价值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。

②2022 年 2 月 15 日，公司发布了《东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》、《东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理变更公告》、《东方新价值混合型证券投资基金基金经理变更公告》、《东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自 2022 年 2 月 15 日起金凤女士担任东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方新价值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。

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

本基金坚持绝对收益投资理念，权益方面，投资主要聚焦于高景气度成长龙头、价值蓝筹、消费龙头。严格控制仓位，精选有安全边际的优质个股，并根据市场情况灵活调整，控制回撤。固收方面，随着稳增长政策不断加码，国内经济有望企稳回升，对债券市场相对谨慎，以稳健的短久期利率债为主，主要采用票息策略，力争获取稳健收益。

结合当前的经济形势和市场特征，在信用扩张+盈利下行的背景下，一方面把握受益稳增长政策的低估值蓝筹估值修复机会，另一方面精选自身盈利趋势较好的成长性行业。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为 5.30%，业绩比较基准收益率为 3.00%，高于业绩比较基准 2.30%；本基金 C 类净值增长率为 4.98%，业绩比较基准收益率为 3.00%，高于业绩比较基准 1.98%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济处于盈利下行周期中，随着经济下行压力增大，稳增长政策有望不断加码。疫情仍然是边际扰动因素。随着地产托底政策持续出台，下半年有望看到社融结构改善，经济有望逐步企稳。

A 股市场经过整体调整，当前主要指数（沪深 300 和中证 500）股息率和市场无风险收益率处于历史标准差的偏低位置，隐含未来回报率较高，具有较好的性价比。

具体来看，在信用扩张+盈利下行的背景下，传统行业的格局有望进一步优化，看好国有地产龙头、消费龙头等的格局改善，龙头集中度有望提升，随着政策发力、新增社融回升，下半年盈利有望加速回升；看好中国先进制造业正作为制造业产业转型升级的代表展现出较强的产业趋势性机会，电动车、光伏、汽车智能化等高成长行业仍是优选赛道，在合理的估值下把握机会。

#### 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，开展定期和实时监察，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界通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并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，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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[2022]第 ZB30081 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 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 1 月 1 日至 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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>
强调事项	—
其他事项	—
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>

<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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</p>	<p>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>2022 年 3 月 24 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	34,603,669.38	90,669,643.71
结算备付金		16,197,445.76	430,343.33
存出保证金		40,166.84	90,788.44
交易性金融资产	7.4.7.2	262,804,022.87	389,099,798.38
其中：股票投资		137,709,522.87	183,871,298.38
基金投资		-	-
债券投资		125,094,500.00	205,228,500.00
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	20,000,000.00	45,000,187.50
应收证券清算款		20,546.60	6,356,784.44
应收利息	7.4.7.5	1,430,865.67	1,933,294.20
应收股利		-	-
应收申购款		189.90	25.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		335,096,907.02	533,580,865.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 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		19,929,302.48	-
应付赎回款		237.90	27,523.57
应付管理人报酬		211,899.51	376,047.28
应付托管费		52,974.87	94,011.83
应付销售服务费		45,228.25	70,060.50
应付交易费用	7.4.7.7	226,361.39	239,486.42
应交税费		259.56	300.61
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	274,000.27	234,000.00
负债合计		20,740,264.23	1,041,430.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	227,486,290.01	400,523,556.02
未分配利润	7.4.7.10	86,870,352.78	132,015,878.77
所有者权益合计		314,356,642.79	532,539,434.79
负债和所有者权益总计		335,096,907.02	533,580,865.00

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.4768 元，C 类基金份额净值 1.3185 元；基金份额总额 227,486,290.01 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 91,090,514.31 份，C 类基金份额总额 136,395,775.70 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		30,285,773.58	71,330,539.55
1.利息收入		8,101,001.57	7,856,216.94
其中：存款利息收入	7.4.7.11	924,107.57	1,634,800.41
债券利息收入		5,079,088.73	3,807,368.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,097,805.27	2,414,048.33
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		42,076,012.04	47,438,749.25
其中：股票投资收益	7.4.7.12	40,373,597.73	46,157,358.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-265,721.49	-584,005.89
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	1,968,135.80	1,865,396.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-19,930,984.81	16,027,304.83
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	39,744.78	8,268.53
<b>减：二、费用</b>		7,056,245.05	6,388,166.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,971,159.74	3,509,653.36
2. 托管费	7.4.10.2.2	992,789.97	877,413.39
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	704,700.37	713,479.09
4. 交易费用	7.4.7.19	1,143,996.58	1,078,717.51
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,930.20	6,664.08
7. 其他费用	7.4.7.20	240,668.19	202,239.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		23,229,528.53	64,942,372.99
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		23,229,528.53	64,942,372.99

### 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	400,523,556.02	132,015,878.77	532,539,434.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,229,528.53	23,229,528.53
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）	-173,037,266.01	-68,375,054.52	-241,412,320.53
其中：1. 基金申购款	138,193,526.66	47,431,676.86	185,625,203.52
2. 基金赎回款	-311,230,792.67	-115,806,731.38	-427,037,524.05
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）	227,486,290.01	86,870,352.78	314,356,642.79
项目	上年度可比期间 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（基金净值）	400,523,556.02	132,015,878.77	532,539,434.79

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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	34,603,669.38	30,669,643.71
定期存款	-	60,000,000.00
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
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	34,603,669.38	90,669,643.71

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		133,161,423.67	137,709,522.87	4,548,099.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	124,912,830.83	125,094,500.00	181,669.17
	合计	124,912,830.83	125,094,500.00	181,669.17
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		258,074,254.50	262,804,022.87	4,729,768.37
项目		上年度末 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

### 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 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,000,000.00	-

项目	上年度末 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	-

#### 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	12,454.77	6,901.86
应收定期存款利息	-	199,180.28
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,786.10	193.70
应收债券利息	1,402,455.90	1,696,865.70
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	13,168.90	40.90
合计	1,430,865.67	1,933,294.20

注：其他为结算保证金利息和应收期货保证金利息。

#### 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	225,096.39	217,174.33
银行间市场应付交易费用	1,265.00	22,312.09
合计	226,361.39	239,486.42

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.27	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	274,000.00	234,000.00
合计	274,000.27	234,000.00

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	201,420,305.28	201,420,305.28
本期申购	48,441,098.76	48,441,098.76
本期赎回（以“-”号填列）	-158,770,889.73	-158,770,889.73
本期末	91,090,514.31	91,090,514.31

金额单位：人民币元

东方新价值混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	199,103,250.74	199,103,250.74
本期申购	89,752,427.90	89,752,427.90
本期赎回（以“-”号填列）	-152,459,902.94	-152,459,902.94
本期末	136,395,775.70	136,395,775.70

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	16,992,933.32	64,075,387.16	81,068,320.48
本期利润	22,489,055.39	-10,395,981.03	12,093,074.36
本期基金份额交易产生的变动数	-20,053,198.48	-29,675,640.42	-49,728,838.90

其中：基金申购款	5,823,586.10	16,445,752.75	22,269,338.85
基金赎回款	-25,876,784.58	-46,121,393.17	-71,998,177.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,428,790.23	24,003,765.71	43,432,555.94

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	-6,470,466.99	57,418,025.28	50,947,558.29
本期利润	20,671,457.95	-9,535,003.78	11,136,454.17
本期基金份额交易产生的变动数	-3,445,286.05	-15,200,929.57	-18,646,215.62
其中：基金申购款	-1,441,298.68	26,603,636.69	25,162,338.01
基金赎回款	-2,003,987.37	-41,804,566.26	-43,808,553.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,755,704.91	32,682,091.93	43,437,796.84

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
活期存款利息收入	337,908.41	282,811.68
定期存款利息收入	532,958.61	1,347,902.40
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	33,196.61	3,318.10
其他	20,043.94	768.23
合计	924,107.57	1,634,800.41

注：其他包括期货保证金和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 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
卖出股票成交总额	384,539,942.28	315,763,536.07
减：卖出股票成本总额	344,166,344.55	269,606,177.51
买卖股票差价收入	40,373,597.73	46,157,358.56

### 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 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-265,721.49	-584,005.89
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	-265,721.49	-584,005.89

#### 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 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	635,555,885.62	383,943,393.05
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	629,970,658.20	380,534,326.82
减：应收利息总额	5,850,948.91	3,993,072.12
买卖债券差价收入	-265,721.49	-584,005.89

#### 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 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------



股票投资产生的股利收益	1,968,135.80	1,865,396.58
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	1,968,135.80	1,865,396.58

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	-19,930,984.81	16,027,304.83
——股票投资	-20,004,860.21	15,952,368.27
——债券投资	73,875.40	74,936.56
——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	-19,930,984.81	16,027,304.83

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
基金赎回费收入	38,858.63	8,267.12
基金转换费收入	886.15	1.41
合计	39,744.78	8,268.53

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
交易所市场交易费用	1,138,421.58	1,073,330.01

银行间市场交易费用	5,575.00	5,387.50
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,143,996.58	1,078,717.51

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费用	36,730.00	37,200.00
银行汇划费用	28,938.19	30,039.13
律师费	-	-
公证费	-	-
合计	240,668.19	202,239.13

#### 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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,971,159.74	3,509,653.36
其中：支付销售机构的客户维护费	64,328.74	68,530.52

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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	992,789.97	877,413.39

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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	659,416.48	659,416.48

合计	-	659,416.48	659,416.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1日至2020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	34,603,669.38	337,908.41	30,669,643.71	282,811.68

#### 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，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新股锁定限售	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-

688187	时代电气	2021年8月30日	2022年3月7日	科创板限售	31.38	76.63	8,917	279,815.46	683,309.71	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月4日	科创板限售	38.85	289.29	2,149	83,488.65	621,684.21	-
688235	百济神州	2021年12月6日	2022年6月15日	科创板限售	192.60	138.98	3,603	693,937.80	500,744.94	-
688385	复旦微电	2021年7月27日	2022年2月7日	科创板限售	6.23	48.49	8,986	55,982.78	435,731.14	-
688772	珠海冠宇	2021年9月30日	2022年4月15日	科创板限售	14.43	44.55	9,561	137,965.23	425,942.55	-
688800	瑞可达	2021年7月14日	2022年1月24日	科创板限售	15.02	133.06	1,967	29,544.34	261,729.02	-
688733	壹石通	2021年8月10日	2022年2月17日	科创板限售	15.49	75.26	3,409	52,805.41	256,561.34	-
688167	炬光科技	2021年12月17日	2022年6月24日	科创板限售	78.69	209.99	920	72,394.80	193,190.80	-
688248	南网科技	2021年12月14日	2022年6月22日	科创板限售	12.24	21.78	8,696	106,439.04	189,398.88	-
688211	中科微至	2021年10月18日	2022年4月26日	科创板限售	90.20	72.14	1,838	165,787.60	132,593.32	-
688255	凯尔达	2021年10月14日	2022年4月25日	科创板限售	47.11	38.08	1,648	77,637.28	62,755.84	-

688272	富吉瑞	2021年10月8日	2022年4月18日	科创板	22.56	43.56	1,263	28,493.28	55,016.28	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	创业板	60.64	234.57	233	14,129.12	54,654.81	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	创业板	14.14	89.79	462	6,532.68	41,482.98	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	创业板	60.66	116.58	270	16,378.20	31,476.60	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月22日	创业板	21.99	82.90	351	7,718.49	29,097.90	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	创业板	6.96	12.44	2,064	14,365.44	25,676.16	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月27日	创业板	5.17	44.18	539	2,786.63	23,813.02	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	创业板	10.07	19.07	1,214	12,224.98	23,150.98	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	创业板	93.09	75.43	300	27,927.00	22,629.00	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	创业板	10.45	12.19	1,761	18,402.45	21,466.59	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	创业板	8.29	26.02	782	6,482.78	20,347.64	-



300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	创业板	11.90	45.42	420	4,998.00	19,076.40	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	创业板	12.20	28.34	654	7,978.80	18,534.36	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	创业板	22.70	57.27	315	7,150.50	18,040.05	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	创业板	19.11	69.92	220	4,204.20	15,382.40	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	创业板	13.00	23.25	647	8,411.00	15,042.75	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	创业板	11.88	25.59	578	6,866.64	14,791.02	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	创业板	8.34	48.96	290	2,418.60	14,198.40	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	创业板	33.16	24.99	520	17,243.20	12,994.80	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	创业板	18.03	62.68	203	3,660.09	12,724.04	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月1日	创业板	58.08	50.23	250	14,520.00	12,557.50	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	创业板	9.46	41.39	290	2,743.40	12,003.10	-

301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	创业板	5.77	15.34	756	4,362.12	11,597.04	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月2日	创业板	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	创业板	4.13	12.95	843	3,481.59	10,916.85	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	创业板	5.31	13.49	733	3,892.23	9,888.17	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	创业板	14.33	34.23	286	4,098.38	9,789.78	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	创业板	13.57	38.45	241	3,270.37	9,266.45	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2月28日	创业板	8.11	33.66	252	2,043.72	8,482.32	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	创业板	1.55	20.84	403	624.65	8,398.52	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	创业板	12.36	26.38	307	3,794.52	8,098.66	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	创业板	8.40	23.87	328	2,755.20	7,829.36	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	创业板	6.10	31.49	242	1,476.20	7,620.58	-

301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	创业板	12.95	18.33	403	5,218.85	7,386.99	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	创业板	15.14	59.93	108	1,635.12	6,472.44	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	创业板	19.34	32.88	196	3,790.64	6,444.48	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	创业板	4.97	12.50	513	2,549.61	6,412.50	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	创业板	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	创业板	9.08	15.23	416	3,777.28	6,335.68	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	创业板	23.38	29.91	205	4,792.90	6,131.55	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	创业板	7.31	28.18	215	1,571.65	6,058.70	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	创业板	7.46	33.38	181	1,350.26	6,041.78	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	创业板	9.96	27.28	203	2,021.88	5,537.84	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	创业板	17.40	36.13	153	2,662.20	5,527.89	-

301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	创业板限售	6.68	20.22	266	1,776.88	5,378.52	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	创业板限售	8.09	19.29	259	2,095.31	4,996.11	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	创业板限售	11.45	16.63	286	3,274.70	4,756.18	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	创业板限售	14.82	24.24	193	2,860.26	4,678.32	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	创业板限售	12.24	32.06	144	1,762.56	4,616.64	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	创业板限售	8.03	19.01	218	1,750.54	4,144.18	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	创业板限售	13.98	28.36	144	2,013.12	4,083.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	创业板限售	11.92	29.17	140	1,668.80	4,083.80	-

注：流通受限证券可流通日以上公司公告为准。

#### 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 2021 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 2021 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	50,026,000.00	75,073,500.00
合计	50,026,000.00	75,073,500.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020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 2021年12月31日	上年度末 2020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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	10,065,000.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	10,065,000.00	0.00

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 2021年12月31日	上年度末 2020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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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

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 2021 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	34,603,669.38	-	-	-	34,603,669.38
结算备付金	16,197,445.76	-	-	-	16,197,445.76
存出保证金	40,166.84	-	-	-	40,166.84
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	137,709,522.87	137,709,522.87
交易性金融资产-债券投资	115,029,500.00	10,065,000.00	0.00	-	125,094,500.00
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	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	20,546.60	20,546.60
应收利息	-	-	-	1,430,865.67	1,430,865.67
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	189.90	189.90
资产总计	185,870,781.98	10,065,000.00	0.00	139,161,125.04	335,096,907.02
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	237.90	237.90
应付管理人报酬	-	-	-	211,899.51	211,899.51
应付托管费	-	-	-	52,974.87	52,974.87
应付交易费用	-	-	-	226,361.39	226,361.39



应付销售服务费	-	-	-	45,228.25	45,228.25
应交税费	-	-	-	259.56	259.56
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	274,000.27	274,000.27
应付证券清算款	-	-	-	19,929,302.48	19,929,302.48
负债总计	0.00	0.00	0.00	20,740,264.23	20,740,264.23
利率敏感度缺口	185,870,781.98	10,065,000.00	0.00	118,420,860.81	314,356,642.79
上年度末 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-债券投资	205,228,500.00	0.00	0.00	-	205,228,500.00
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	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

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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	80,220.76	117,921.23
	市场利率上调 0.25%	-200,402.76	-268,068.23

#### 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 2021年12月31日		上年度末 2020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	137,709,522.87	43.81	183,871,298.38	34.53
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	125,094,500.00	39.79	205,228,500.00	38.54
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	262,804,022.87	83.60	389,099,798.38	73.06

##### 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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）

	沪深 300 指数下跌 5%	-6,600,583.10	-9,271,692.78
	沪深 300 指数上涨 5%	6,600,583.10	9,271,692.78

#### 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 2,113,310.94 元，占基金资产净值比例为 0.67%；上年度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%。

#### 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	137,709,522.87	41.10
	其中：股票	137,709,522.87	41.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	125,094,500.00	37.33
	其中：债券	125,094,500.00	37.33
	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	20,000,000.00	5.97
	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	50,801,115.14	15.16
8	其他各项资产	1,491,769.01	0.45
9	合计	335,096,907.02	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	5,079,000.00	1.62
C	制造业	77,920,400.23	24.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,430,500.00	1.41
E	建筑业	4,866,812.46	1.55
F	批发和零售业	2,123,830.41	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,616.64	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,318,617.99	0.74
J	金融业	26,921,400.00	8.56
K	房地产业	7,538,200.00	2.40
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,900,731.98	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	1,299,732.32	0.41
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	2,305,680.84	0.73
S	综合	-	-
	合计	137,709,522.87	43.81

### 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	002142	宁波银行	180,000	6,890,400.00	2.19
2	600036	招商银行	120,000	5,845,200.00	1.86
3	300059	东方财富	150,000	5,566,500.00	1.77
4	600048	保利发展	300,000	4,689,000.00	1.49
5	000538	云南白药	40,000	4,186,000.00	1.33
6	600887	伊利股份	100,000	4,146,000.00	1.32
7	601899	紫金矿业	370,000	3,589,000.00	1.14
8	688169	石头科技	4,000	3,252,000.00	1.03
9	603659	璞泰来	20,000	3,212,200.00	1.02
10	600519	贵州茅台	1,500	3,075,000.00	0.98
11	600585	海螺水泥	75,000	3,022,500.00	0.96
12	600905	三峡能源	400,000	3,004,000.00	0.96
13	000001	平安银行	180,000	2,966,400.00	0.94
14	000333	美的集团	40,000	2,952,400.00	0.94
15	600958	东方证券	200,000	2,948,000.00	0.94
16	002241	歌尔股份	50,000	2,705,000.00	0.86
17	000776	广发证券	110,000	2,704,900.00	0.86
18	300012	华测检测	100,000	2,687,000.00	0.85
19	000423	东阿阿胶	55,000	2,681,250.00	0.85
20	601669	中国电建	300,000	2,424,000.00	0.77
21	001979	招商蛇口	180,000	2,401,200.00	0.76
22	300413	芒果超媒	40,000	2,288,800.00	0.73
23	000848	承德露露	200,000	2,170,000.00	0.69
24	600690	海尔智家	70,000	2,092,300.00	0.67
25	603806	福斯特	16,000	2,088,800.00	0.66
26	600861	北京城乡	89,967	2,070,140.67	0.66
27	002311	海大集团	27,000	1,979,100.00	0.63

28	600132	重庆啤酒	12,000	1,815,840.00	0.58
29	300073	当升科技	20,000	1,737,400.00	0.55
30	600809	山西汾酒	5,500	1,736,790.00	0.55
31	688121	卓然股份	45,000	1,730,250.00	0.55
32	601233	桐昆股份	80,000	1,694,400.00	0.54
33	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.54
34	605009	豪悦护理	29,000	1,594,710.00	0.51
35	600993	马应龙	55,000	1,581,800.00	0.50
36	002415	海康威视	30,000	1,569,600.00	0.50
37	002493	荣盛石化	85,000	1,543,600.00	0.49
38	603486	科沃斯	10,000	1,509,500.00	0.48
39	601668	中国建筑	300,000	1,500,000.00	0.48
40	300122	智飞生物	12,000	1,495,200.00	0.48
41	600988	赤峰黄金	100,000	1,490,000.00	0.47
42	605358	立昂微	12,000	1,440,120.00	0.46
43	600795	国电电力	450,000	1,426,500.00	0.45
44	002216	三全食品	70,000	1,414,700.00	0.45
45	002841	视源股份	17,000	1,383,800.00	0.44
46	300827	上能电气	15,000	1,363,500.00	0.43
47	003021	兆威机电	17,000	1,357,450.00	0.43
48	300684	中石科技	60,000	1,316,400.00	0.42
49	000400	许继电气	50,000	1,305,000.00	0.42
50	300816	艾可蓝	25,000	1,287,750.00	0.41
51	603799	华友钴业	11,000	1,213,410.00	0.39
52	300866	安克创新	11,000	1,127,500.00	0.36
53	000858	五粮液	5,000	1,113,300.00	0.35
54	600875	东方电气	50,000	1,071,000.00	0.34
55	002028	思源电气	20,000	984,200.00	0.31
56	000895	双汇发展	30,000	946,500.00	0.30
57	000928	中钢国际	100,000	930,000.00	0.30
58	300450	先导智能	10,000	743,700.00	0.24
59	688187	时代电气	8,917	683,309.71	0.22
60	688499	利元亨	2,149	621,684.21	0.20
61	300088	长信科技	40,000	531,200.00	0.17
62	688235	百济神州	3,603	500,744.94	0.16
63	002475	立讯精密	10,000	492,000.00	0.16
64	000656	金科股份	100,000	448,000.00	0.14
65	688385	复旦微电	8,986	435,731.14	0.14
66	688772	珠海冠宇	9,561	425,942.55	0.14

67	300552	万集科技	10,000	402,900.00	0.13
68	000977	浪潮信息	10,000	358,300.00	0.11
69	688800	瑞可达	1,967	261,729.02	0.08
70	688733	壹石通	3,409	256,561.34	0.08
71	600131	国网信通	10,000	218,500.00	0.07
72	688167	炬光科技	920	193,190.80	0.06
73	688248	南网科技	8,696	189,398.88	0.06
74	688211	中科微至	1,838	132,593.32	0.04
75	688255	凯尔达	1,648	62,755.84	0.02
76	688272	富吉瑞	1,263	55,016.28	0.02
77	301050	雷电微力	233	54,654.81	0.02
78	301029	怡合达	462	41,482.98	0.01
79	301155	海力风电	270	31,476.60	0.01
80	301099	雅创电子	351	29,097.90	0.01
81	301039	中集车辆	2,064	25,676.16	0.01
82	301069	凯盛新材	539	23,813.02	0.01
83	301149	隆华新材	1,214	23,150.98	0.01
84	301087	可孚医疗	300	22,629.00	0.01
85	301090	华润材料	1,761	21,466.59	0.01
86	301018	申菱环境	782	20,347.64	0.01
87	300994	久祺股份	420	19,076.40	0.01
88	301180	万祥科技	654	18,534.36	0.01
89	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
90	301118	恒光股份	315	18,040.05	0.01
91	301089	拓新药业	220	15,382.40	0.00
92	301188	力诺特玻	647	15,042.75	0.00
93	301185	鸥玛软件	578	14,791.02	0.00
94	301046	能辉科技	290	14,198.40	0.00
95	301088	戎美股份	520	12,994.80	0.00
96	301026	浩通科技	203	12,724.04	0.00
97	301093	华兰股份	250	12,557.50	0.00
98	301021	英诺激光	290	12,003.10	0.00
99	301078	孩子王	756	11,597.04	0.00
100	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
101	301048	金鹰重工	843	10,916.85	0.00
102	301028	东亚机械	733	9,888.17	0.00
103	301133	金钟股份	286	9,789.78	0.00
104	301040	中环海陆	241	9,266.45	0.00
105	301052	果麦文化	252	8,482.32	0.00

106	301025	读客文化	403	8,398.52	0.00
107	301098	金埔园林	307	8,098.66	0.00
108	300814	中富电路	328	7,829.36	0.00
109	301030	仕净科技	242	7,620.58	0.00
110	301081	严牌股份	403	7,386.99	0.00
111	301033	迈普医学	108	6,472.44	0.00
112	301049	超越科技	196	6,444.48	0.00
113	301032	新柴股份	513	6,412.50	0.00
114	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
115	301083	百胜智能	416	6,335.68	0.00
116	301036	双乐股份	205	6,131.55	0.00
117	301041	金百泽	215	6,058.70	0.00
118	301072	中捷精工	181	6,041.78	0.00
119	300854	中兰环保	203	5,537.84	0.00
120	301063	海锅股份	153	5,527.89	0.00
121	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
122	301038	深水规院	266	5,378.52	0.00
123	301059	金三江	259	4,996.11	0.00
124	301027	华蓝集团	286	4,756.18	0.00
125	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
126	301037	保立佳	193	4,678.32	0.00
127	301073	君亭酒店	144	4,616.64	0.00
128	301057	汇隆新材	218	4,144.18	0.00
129	301068	大地海洋	144	4,083.84	0.00
130	301079	邵阳液压	140	4,083.80	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	002493	荣盛石化	17,796,057.17	3.34
2	600048	保利发展	16,152,159.00	3.03
3	601233	桐昆股份	10,660,820.00	2.00
4	000001	平安银行	9,434,677.00	1.77
5	600585	海螺水泥	9,120,682.00	1.71
6	600346	恒力石化	8,591,524.00	1.61



7	000825	太钢不锈	7,758,203.00	1.46
8	601857	中国石油	6,673,990.00	1.25
9	600309	万华化学	6,595,578.36	1.24
10	600188	兖矿能源	6,548,827.00	1.23
11	600036	招商银行	6,502,376.00	1.22
12	600905	三峡能源	6,396,527.95	1.20
13	601808	中海油服	5,842,948.00	1.10
14	000898	鞍钢股份	5,816,586.00	1.09
15	601669	中国电建	5,614,830.00	1.05
16	300059	东方财富	5,579,814.00	1.05
17	600409	三友化工	5,473,720.08	1.03
18	000422	湖北宜化	5,057,852.00	0.95
19	001979	招商蛇口	4,971,176.00	0.93
20	002714	牧原股份	4,780,779.57	0.90

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	600048	保利发展	22,766,671.00	4.28
2	600519	贵州茅台	22,018,317.00	4.13
3	002493	荣盛石化	14,843,204.00	2.79
4	600188	兖矿能源	14,563,119.00	2.73
5	002968	新大正	14,475,957.25	2.72
6	001914	招商积余	13,045,188.41	2.45
7	601166	兴业银行	12,000,957.00	2.25
8	601318	中国平安	10,714,433.00	2.01
9	300012	华测检测	10,201,096.00	1.92
10	601899	紫金矿业	8,964,766.00	1.68
11	002128	电投能源	8,810,818.00	1.65
12	600966	博汇纸业	8,453,701.00	1.59
13	000333	美的集团	8,187,354.00	1.54
14	600905	三峡能源	7,888,459.48	1.48
15	600309	万华化学	7,184,894.00	1.35

16	600585	海螺水泥	6,814,598.00	1.28
17	601233	桐昆股份	6,796,773.00	1.28
18	600346	恒力石化	6,703,408.00	1.26
19	600690	海尔智家	6,348,435.00	1.19
20	000001	平安银行	6,016,405.00	1.13

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	318,009,429.25
卖出股票收入（成交）总额	384,539,942.28

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	75,068,500.00	23.88
	其中：政策性金融债	65,003,500.00	20.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,026,000.00	15.91
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	125,094,500.00	39.79

### 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	210404	21 农发 04	400,000	39,996,000.00	12.72
2	210201	21 国开 01	250,000	25,007,500.00	7.96
3	012102616	21 临港控股 SCP005	200,000	20,042,000.00	6.38
4	012105466	21 华能水电 SCP015	200,000	19,996,000.00	6.36
5	2120087	21 东莞银行 01	100,000	10,065,000.00	3.20

### 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

本基金所持有的宁波银行（002142）公司因业务违规受到中国人民银行、各地银保监会处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有的招商银行（600036）公司因业务违规受到中国人民银行、各地银保监会处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

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。

本基金投资宁波银行主要基于以下原因：公司属于城商行龙头，地处江浙地区，地区经济发展态势良好，公司主要以小微业务为主，具备行业中最稳健的经营能力和经营质量，公司资产质量良好，风险可控，分红水平稳定，在补充完资本之后，具备很好的成长性。具备一定投资价值。

本基金投资招商银行主要基于以下原因：公司作为银行业零售龙头，零售客户在规模和质量方面均有较大优势，公司在零售业务方面有强大的护城河，业务结构和公司业绩相对稳定，零售创新能力突出，具备一定投资价值。

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	40,166.84
2	应收证券清算款	20,546.60
3	应收股利	-
4	应收利息	1,430,865.67
5	应收申购款	189.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,491,769.01

### 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	873	104,341.94	90,189,686.66	99.01%	900,827.65	0.99%
东方新价值混合 C	56	2,435,638.85	136,390,294.81	100.00%	5,480.89	0.00%
合计	929	244,872.22	226,579,981.47	99.60%	906,308.54	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	201,420,305.28	199,103,250.74
本报告期基金总申购份额	48,441,098.76	89,752,427.90
减:本报告期基金总赎回份额	158,770,889.73	152,459,902.94
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	91,090,514.31	136,395,775.70

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

本报告期，无涉及基金管理人的重大人事变动。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

2022 年 2 月 12 日，基金管理人发布了《东方基金管理股份有限公司高级管理人员变更公告》，自 2022 年 2 月 11 日起许文波先生担任公司副总经理、权益投资总监、基金经理。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。

### 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 2021 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 7 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	



兴业证券股份有限公司	2	444,227,715.15	65.69%	413,710.63	65.69%	-
太平洋证券股份有限公司	2	178,536,502.00	26.40%	166,272.75	26.40%	-
长江证券股份有限公司	2	41,755,177.99	6.17%	38,886.78	6.17%	-
光大证券股份有限公司	2	11,682,926.53	1.73%	10,880.03	1.73%	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	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实力雄厚，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）本报告期内本基金未有交易单元变更。

**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
兴业证券股份有限公司	-	-	4,200,000,000.00	76.23%	-	-
太平洋证券	-	-	600,000,000.00	10.89%	-	-

股份有限公司						
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	710,000,000.00	12.89%	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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	东方基金管理股份有限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	2021年1月1日
2	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	2021年1月4日
3	东方新价值混合型证券投资基金 2020 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	2021年1月21日
4	关于增加上海天天基金销售有限公司为东方新价值混合型证券投资基金 C 类销售机构同时开通定期定额投资、转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年1月21日
5	关于旗下部分基金与农业银行基金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	2021年1月28日
6	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021年2月8日
7	关于旗下部分基金参与济安财富（北京）基金销售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	2021年3月6日
8	关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台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	2021年3月9日
9	关于增加北京度小满基金销售有限公司为旗下基金销售机构	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理	2021年3月11日

	同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
10	关于旗下部分基金参与宁波银行同业易管家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	2021 年 3 月 17 日
11	关于增加宁波银行股份有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 17 日
12	关于旗下部分基金参与安信证券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	2021 年 3 月 17 日
13	东方基金关于开展直销中心基金转换申购补差费用优惠活动	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	2021 年 3 月 23 日
14	关于东方基金在直销中心（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	2021 年 3 月 24 日
15	关于增加上海基煜基金销售有限公司为东方基金旗下部分产品的销售机构同时开通定期定额投资、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 25 日
16	东方基金管理股份有限公司上海分公司迁址公告	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	2021 年 3 月 26 日
17	东方新价值混合型证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 26 日
18	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	2021 年 3 月 27 日
19	关于旗下部分基金继续参与中国银行部分渠道申购费率和全渠道定投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	2021 年 3 月 31 日
20	东方新价值混合型证券投资基金基金合同(2021 年 4 月修订)	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
21	东方新价值混合型证券投资基金托管协议(2021 年 4 月修订)	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日

22	东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告（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	2021 年 3 月 31 日
23	关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务并参与定投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	2021 年 4 月 1 日
24	东方新价值混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 2 日
25	东方新价值混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021 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	2021 年 4 月 2 日
26	东方新价值混合型证券投资基金 2021 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	2021 年 4 月 21 日
27	关于增加上海爱建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	2021 年 5 月 13 日
28	关于旗下部分基金参与吉林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	2021 年 5 月 28 日
29	关于增加展恒为东方基金旗下部分产品的销售机构同时开通定期定额投资、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 22 日
30	关于旗下部分基金参与上海基煜基金销售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	2021 年 6 月 24 日
31	关于旗下部分基金继续参与交通银行基金申购及定投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	2021 年 6 月 29 日
32	关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售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	2021 年 6 月 29 日
33	关于旗下部分基金参与北京汇成基金销售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	2021 年 6 月 29 日
34	关于增加中国人寿保险股份有	上海证券报、证券日报、证券	2021 年 7 月 6 日

	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	时报、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	
35	关于旗下部分基金参与招商银行股份有限公司申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 7 月 20 日
36	东方新价值混合型证券投资基金 2021 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	2021 年 7 月 21 日
37	关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司等六家销售机构申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 7 月 28 日
38	关于中国工商银行股份有限公司开通东方基金管理股份有限公司旗下开放式基金定投及转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 7 月 29 日
39	关于增加国联证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 8 月 6 日
40	关于旗下部分基金参与兴业银行股份有限公司申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 8 月 6 日
41	关于旗下部分基金参与喜鹊财富基金销售有限公司等两家销售机构申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 8 月 10 日
42	东方新价值混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 16 日
43	东方新价值混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021 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	2021 年 8 月 16 日
44	关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 8 月 21 日
45	关于旗下部分基金参与华夏银行股份有限公司申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 8 月 23 日
46	东方新价值混合型证券投资基金 2021 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	2021 年 8 月 26 日

47	关于旗下部分基金参与中国中金财富证券有限公司申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 3 日
48	关于旗下部分基金参与中国建设银行股份有限公司申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 4 日
49	关于调整停牌股票(000959)估值方法的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 8 日
50	关于增加上海万得基金销售有限公司为东方基金旗下部分开放式基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 8 日
51	关于旗下部分基金参与农业银行股份有限公司申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 9 日
52	关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 9 日
53	关于旗下部分基金参与国金证券股份有限公司等四家销售机构申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 16 日
54	关于在海通证券股份有限公司开通旗下部分基金定投业务并参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 16 日
55	关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 16 日
56	关于旗下部分基金参与中国光大银行股份有限公司申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 9 月 29 日
57	关于旗下部分基金参与海银基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子	2021 年 10 月 18 日

		披露网站	
58	关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 10 月 18 日
59	关于增加泰信财富基金销售有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 10 月 21 日
60	东方新价值混合型证券投资基金 2021 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	2021 年 10 月 26 日
61	关于旗下部分基金参与中信证券股份有限公司等四家销售机构申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 10 月 26 日
62	关于旗下部分基金参与交通银行申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 10 月 30 日
63	关于旗下部分基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 11 月 1 日
64	关于旗下部分基金参与深圳市新兰德证券投资咨询有限公司等 39 家销售机构费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 11 月 5 日
65	关于旗下部分基金参与上海证券有限责任公司等四家销售机构申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 11 月 9 日
66	关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司等 7 家销售机构费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 11 月 16 日
67	关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 11 月 18 日
68	关于旗下部分基金参与浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 11 月 18 日

69	关于增加上海陆金所基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 11 月 19 日
70	东方基金管理股份有限公司关于办公地址变更的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 12 月 4 日
71	关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 12 月 23 日
72	关于旗下部分基金参与邮储银行申购费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 12 月 25 日
73	关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、证券日报、证券时报、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	2021 年 12 月 31 日



## § 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 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

2022 年 3 月 25 日