东方红货币市场基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年8月27日

§1 重要提示

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。本半年度报告已由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红货币市场基金		
基金简称	东方红货币		
基金主代码	005056		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017年8月25日		
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,565,038,354.18份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	东方红货币A	东方红货币B	东方红货币E
下属分级基金的交易代码:	005056	005057	005058
报告期末下属分级基金的份额总额	57,349,575.68份	1,440,415,557.86份	67,273,220.64份

2.2 基金产品说明

投资目标	在本金安全的前提下,确保基金资产的高流动性,追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对货币金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	当期银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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		上海东方证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	任莉	郭明
	联系电话	021-63325888	010-66105799
	电子邮箱	service@dfham.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009200808	95588
传真		021-63326981	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金半年度报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路318号2号楼31层 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

基金级别	东方红货币A	东方红货币B	东方红货币E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	887,512.19	24,337,809.01	1,332,363.95
本期利润	887,512.19	24,337,809.01	1,332,363.95
本期净值收益率	1.9849%	2.1057%	2.0604%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)		
期末基金资产净值	57,349,575.68	1,440,415,557.86	67,273,220.64
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注:1、表中的“期末”均指报告期最后一日,即2018年6月30日;“本期”指2018年1月1日- 2018年6月30日。

2、东方红货币 A、东方红货币 B 与东方红货币 E 适用不同的销售服务费率。

3、本基金收益分配从为按日结转份额。

4、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。由于货币市场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。

3.2基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红货币A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3154%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.2866%	0.0012%
过去三个月	0.9596%	0.0011%	0.0873%	0.0000%	0.8723%	0.0011%
过去六个月	1.9849%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	1.8113%	0.0011%
自基金合同生效起至今	3.3905%	0.0012%	0.2973%	0.0000%	3.0932%	0.0012%

东方红货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3353%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.3065%	0.0012%
过去三个月	1.0198%	0.0011%	0.0873%	0.0000%	0.9325%	0.0011%
过去六个月	2.1057%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	1.9321%	0.0011%
自基金合同生效起至今	3.6003%	0.0012%	0.2973%	0.0000%	3.3030%	0.0012%

东方红货币E

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3279%	0.0012%	0.0288%	0.0000%	0.2991%	0.0012%
过去三个月	0.9971%	0.0011%	0.0873%	0.0000%	0.9098%	0.0011%
过去六个月	2.0604%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	1.8868%	0.0011%
自基金合同生效起至今	3.5220%	0.0012%	0.2973%	0.0000%	3.2247%	0.0012%

注:1、自基金合同生效日起至今指2017年8月25日-2018年6月30日。

根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金的业绩比较基准=当期银行活期存款利率(税后)。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,t日收益率(benchmark t)按下列公式计算:

benchmark t =100% *[t日当期银行活期存款利率(税后)/365];

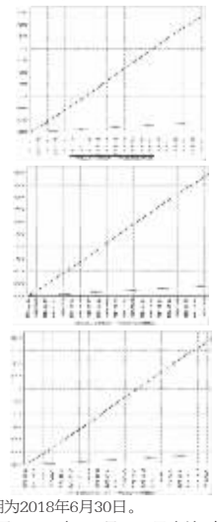
其中,t=1,2,3,. . . T,T表示时间截至日;

t日至T日的期间收益率(benchmark T)按下列公式计算:

benchmark Tt =[∏Tt=(t+benchmark t)]-1

其中,T=2,3,4,. . . ; ∏Tt=(1+benchmark t)表示t日至T日的(1+benchmark t)数学连乘。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、截止日期为2018年6月30日。

2、本基金合同于 2017 年 8 月 25 日生效,自合同生效日起至本报告期末不足一年。

3、本基金建仓期 6 个月,即从 2017 年 8 月 25 日起至 2018 年 2 月 25 日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于2010年7月28日,是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》(证监许可[2010]518号)批准,由东方证券股份有限公司出资3亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013年8月,公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红逸享三年定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红三十三只证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
纪文静	上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理、兼任东方红策略精选混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红睿鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红货币市场基金基金经理。	2017年8月25日	-	11年	硕士,曾任东海证券股份有限公司固定收益部固收投研经理、债券交易经理,德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理,上海东方证券资产管理有限公司固定收益部副总监,现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理兼任东方红策略精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红6个月定期开放纯债、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红战略精选混合、东方红价值精选混合、东方红睿鑫纯债债券、东方红智逸沪港深定开混合、东方红货币基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
徐晨	东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红利债券型证券投资基金、东方红鑫纯债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017年9月15日	-	11年	本科,曾任长信基金管理有限责任公司基金事务部基金会计、交易管理部债券交易员,广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员,富国基金管理有限公司固定收益部基金经理助理,上海东方证券资产管理有限公司机募固定收益投资部投资经理。现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部基金经理兼任东方红策略精选混合、东方红睿阳灵活配置混合、东方红利债券、东方红鑫纯债债券、东方红货币、东方红目标优选定开混合、东方红配置精选混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
李燕	东方红货币市场基金基金经理。	2017年10月25日	-	17年	硕士,曾任国信证券股份有限公司电子商务部部员,富国基金管理有限公司运营部基金会计、基金会计主管、总监助理、副总监,上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部业务总监,现任东方红货币市场基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。

注:1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日,“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期;对此后非首任基金经理,基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同及其它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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2018年上半年,国内宏观经济增长稳中趋缓,GDP增速小幅回落,货币政策逐步放松,资金面明显趋于宽松,货币市场利率及债券收益率明显下行。上半年末3个月shibor、国有股份制银行3个同业存单发行利率相比去年末分别下行76BP、155BP,债券收益率大幅陡峭化下行,期限利差及信用利差均有所扩大。

一季度,为缓冲2017年以来金融强监管及去杠杆的影响,避免引发系统性风险,货币政策开始有所放松,在央行一月份定向降准及“临时准备金动用安排”实施后,资金面较去年四季度明显宽松,货币市场利率明显下行,资金面在春节、季度末等时点也未出现明显扰动。

二季度,受制于信用紧缩引发的企业融资困难、信用违约,国内投资、消费走弱,中美贸易摩擦反复升级,经济基本面下行压力日益显现,货币政策边际上进一步放松,央行两次宣布降准,并在6月底的货币政策委员会二季度例会中提出要加强形势预判和前瞻性预调微调,保持流动性“合理充裕”。二季度资金面整体较为宽松,仅4月中下旬、6月中下旬出现一定的时点扰动。

本基金上半年操作依然坚持在做好流动性管理的前提下,充分把握资金面的变化进行灵活配置的原则,一季度组合整体保持较短的剩余期限和较低的杠杆水平,二季度组合剩余期限和杠杆水平较一季度有所提升,并充分利用4月中下旬和6月中下旬的时点扰动提升组合收益水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期东方红货币A的基金份额净值收益率为1.9849%,本报告期东方红货币B的基金份额净值收益率为2.1057%,本报告期东方红货币E的基金份额净值收益率为2.0604%,同期业绩比较基准收益率为0.1736%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,7月中采制造业PMI从6月的51.5回落至51.2,反映制造业景气继6月出现拐点后继续回落,企业需求尤其是中小企业需求疲弱,在外部贸易摩擦暂未缓解,内部经济下行压力犹存的背景下,货币政策预计仍将维持稳健偏松。同时,为防止信用收缩继续恶化,除了目前已出台的MLF质押券政策、MLF资金投放与银行信用债投资挂钩、略有放松的《商业银行理财业务管理办法征求意见稿》、下调MPA考核中宏观资本充足率的结构性参数等,引导信用松绑的政策可能还将陆续出台,以进一步缓解小微企业、民企、低等级信用债发行主体结构性融资难融资贵的问题;为托底经济,下半年财政支出加大的可能性及空间均较大。但宽信用政策的传导及财政发力均需要时间,我们认为三季度资金面预计依然将保持宽松,四季度随着宽信用政策的传导及经济数据的变化,资金面的波动可能加大。

因此,下半年基金操作上将继续做好流动性管理,充分挖掘市场机会,进行灵活有效配置。组合仍将采取短久期、低杠杆策略,配置高信用等级优质资产,并根据资金面波动择机调整久期和杠杆水平,努力为持有人获取稳健的收益。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会于2017年9月5日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(2017年9月5日《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》(证监会计字(2007)21号)和《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告(2008)38号)同时废止)等相关规定和基金合同的约定,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。基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,确定本基金管理人采用的估值政策。基金管理人对投资品种的估值程序及技术保持一致性原则,为确保估值程序和技术的持续使用性,基金管理人建立了定期复核和审阅机制。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有基金从业人员资格,同时,公司设估值决策小组负责研究、指导和审议基金估值业务,成员包括:公司总经理、合规总监(督察长)、交易总监、运营总监、基金会计主管等。基金经理不参与基金日常估值业务,对于属于东证资管估值政策范围内的特殊估值变更可参与讨论,但最终决策由估值决策小组讨论决策并联名审批,保证基金估值的公平合理,保持估值政策和程序的一贯性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付。

本报告期内应分配收益26,557,685.15元, 实际分配收益26,555,721.39元,符合本基金基金合同的相关规定。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额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

本报告期内, 本基金托管人在对东方红货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,东方红货币市场基金的管理人——上海东方证券资产管理有限公司在东方红货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对上海东方证券资产管理有限公司编制和披露的东方红货币市场基金2018年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:东方红货币市场基金

报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	524,368,120.43	422,832,303.76
结算备付金	897,936.37	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	498,178,949.87	249,025,889.21
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	498,178,949.87	249,025,889.21
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	580,782,983.18	268,773,123.17
应收证券清算款	24,030.82	-
应收利息	5,636,688.75	4,258,741.31
应收股利	-	-
应收申购款	2,746,499.51	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,612,635,208.93	944,890,057.45
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	45,104,857.45	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	1,440,943.67	90,281.37
应付管理人报酬	363,116.26	307,849.45
应付托管费	96,830.99	82,093.13
应付销售服务费	29,547.57	17,350.28
应付交易费用	40,952.49	23,327.66
应交税费	833.36	-
应付利息	8,003.96	-
应付利润	430,064.78	428,101.02
递延所得税负债	-	-
其他负债	81,704.32	59,000.00
负债合计	47,596,854.75	1,008,002.91
所有者权益:		
实收基金	1,565,038,354.18	943,882,054.54
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,565,038,354.18	943,882,054.54
负债和所有者权益总计	1,612,635,208.93	944,890,057.45

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,565,038,354.18份,其中A类基金份额总额57,349,575.68份,B类基金份额总额1,440,415,557.86份,E类基金份额总额67,273,220.64份。

6.2 利润表

会计主体:东方红货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	29,509,291.43
1.利息收入	29,332,306.99
其中:存款利息收入	13,397,802.60
债券利息收入	6,116,040.62
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	9,818,463.77
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	176,984.44
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	176,984.44
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-
减:二、费用	2,951,606.28
1. 管理人报酬	1,912,049.64
2. 托管费	509,879.94
3. 销售服务费	147,719.45
4. 交易费用	-
5. 利息支出	253,637.66
其中:卖出回购金融资产支出	253,637.66
6. 税金及附加	89.29
7. 其他费用	128,230.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	26,557,685.15
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	26,557,685.15

注:本基金于 2017年 8 月 25 日成立,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方红货币市场基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	943,882,054.54	-	943,882,054.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,557,685.15	26,557,685.15
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)	621,156,299.64	-	621,156,299.64
其中:1.基金申购款	3,607,559,699.21	-	3,607,559,699.21
2.基金赎回款	-2,986,403,399.57	-	-2,986,403,399.57
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)	-	-26,557,685.15	-26,557,685.15
五、期末所有者权益(基金净值)	1,565,038,354.18	0.00	1,565,038,354.18

注:本基金于 2017年 8 月 25 日成立,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

潘 鑫 军 _____ _____ 任 莉 _____

詹朋

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方红货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]635号《关于准予东方红货币市场基金注册的批复》核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,318,025,863.23元, 业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字[2017]第840号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红货币市场基金基金合同》于2017年8月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,318,025,863.23份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《东方红货币市场基金基金合同》和《东方红货币市场基金招募说明书》的规定,本基金根据销售方式或基金份额持有人持有本基金的份额数量进行基金份额类别划分。本基金分设A类、B类和E类三类基金份额,三类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,三类基金份额单独设置基金代码,并单独公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于流动性高、信用风险低、价格波动小的短期金融工具,包括现金;期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券。法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场工具的, 在不改变基金投资目标、投资策略,不改变基金风险收益特征的条件下,在履行适当程序后,本基金可参与其他货币市场工具的投资。具体投资比例限制按照相关法律法规和监管规定执行,但须与基金托管人协商一致后方可纳入基金托管人投资监督范围。本基金的业绩比较基准为:当期银行活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称 “企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红货币市场基金基金合同》 和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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]2号《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》、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)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。

(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。

(3)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。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司(“东证资管”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司(“东方证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券	926,500,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,912,049.64
其中:支付销售机构的客户维护费	28,629.64

注:1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H = E × 0.30% ÷ 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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	509,879.94

注: 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H = E × 0.08% ÷ 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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东方红货币A	东方红货币B	东方红货币E	合计
东证资管	12,567.21	55,930.12	32,568.95	101,066.28
工商银行	-	-	-	-
东方证券	5,715.72	2,081.72	-	7,797.44
合计	18,282.93	58,011.84	32,568.95	108,863.72

注:本基金E 类基金份额的年销售服务费为 0.1%/年。

本基金A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%/年, 对于由B类降级为A类的基金份额持有人,年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。

B类基金份额的年销售服务费率为 0.01%/年,对于由A 类升级为 B 类的基金份额持有人, 年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。

A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额销售服务费计提的计算公式相同,具体如下:

H = E × 年销售服务