

东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2022 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 东方红中证竞争力指数 |
| 基金主代码 | 007657 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 7 月 31 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 564,964,105.46 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票投资组合。同时为实现对标的指数更好地跟踪，本基金将辅以适当的替代性策略调整组合。本基金力争基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 业绩比较基准 | 中证东方红竞争力指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金是指 |

| | | |
|-----------------|------------------------|-----------------|
| | 数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 上海东方证券资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 东方红中证竞争力指数 A | 东方红中证竞争力指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 007657 | 007658 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 492,347,989.32 份 | 72,616,116.14 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 东方红中证竞争力指数 A | 东方红中证竞争力指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | -23,645,568.55 | -3,635,774.92 |
| 2. 本期利润 | 49,100,569.79 | 7,154,760.80 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0988 | 0.0959 |
| 4. 期末基金资产净值 | 667,207,388.98 | 97,226,151.85 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.3552 | 1.3389 |

注：1、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。

2、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。

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

东方红中证竞争力指数 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 7.97% | 1.36% | 7.31% | 1.37% | 0.66% | -0.01% |
| 过去六个月 | -6.52% | 1.37% | -7.06% | 1.37% | 0.54% | 0.00% |
| 过去一年 | -10.51% | 1.19% | -11.98% | 1.19% | 1.47% | 0.00% |
| 自基金合同 | 35.52% | 1.23% | 26.44% | 1.24% | 9.08% | -0.01% |

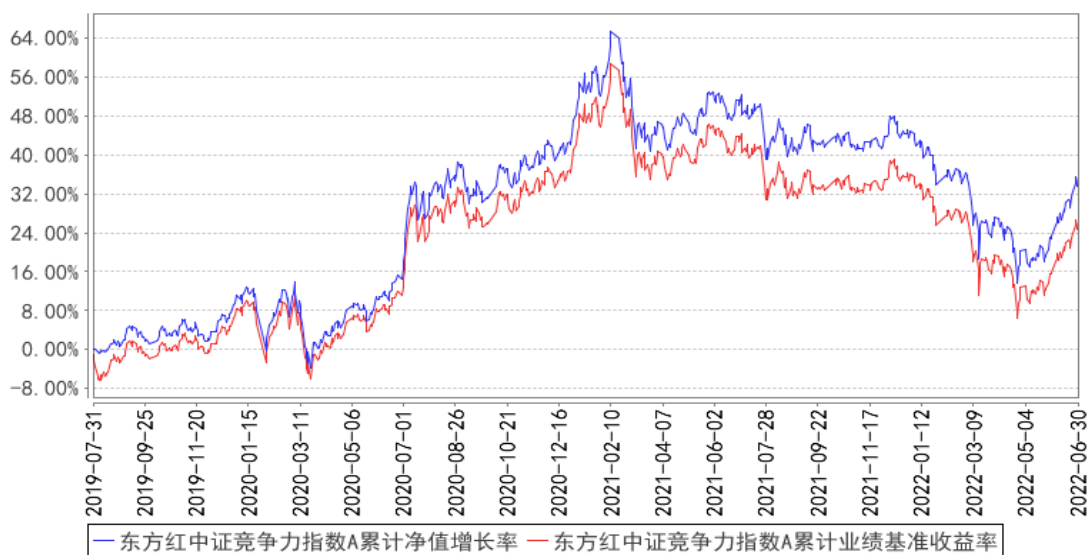
| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

东方红中证竞争力指数 C

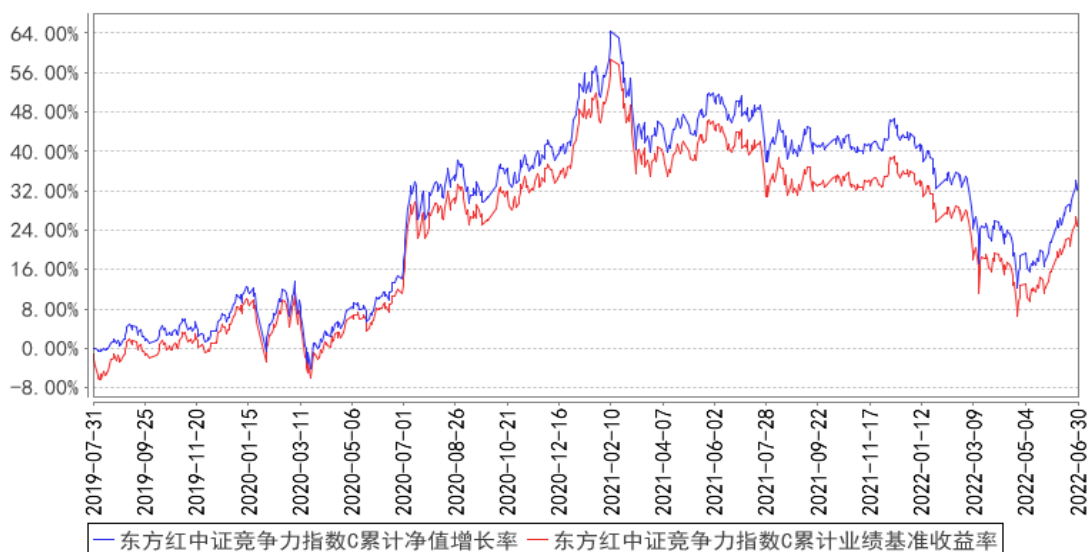
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 7.85% | 1.36% | 7.31% | 1.37% | 0.54% | -0.01% |
| 过去六个月 | -6.70% | 1.37% | -7.06% | 1.37% | 0.36% | 0.00% |
| 过去一年 | -10.87% | 1.19% | -11.98% | 1.19% | 1.11% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.89% | 1.23% | 26.44% | 1.24% | 7.45% | -0.01% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

东方红中证竞争力指数A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



东方红中证竞争力指数C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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐习佳 | 上海东方证券资产管理有限公司公募指数与多策略部副总经理（主持工作）、基金经理 | 2019年7月31日 | - | 21年 | 上海东方证券资产管理有限公司公募指数与多策略部副总经理（主持工作）、基金经理，2019年07月至今任东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金经理、2021年12月至今任东方红中证东方红利低波动指数证券投资基金基金经理。天普大学金融学博士。曾任联合证券投资银行部投行经理，美国 Towers Watson 资深分析师，兴业全球基金金融工程与专题研究部副总监、基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司研究部副总监、量化投资部总经理、投资主办人。具备证券投资基金从业资格。 |
| 戎逸洲 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理 | 2019年11月29日 | - | 7年 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2019年11月至今任东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金经理。福特汉姆大学理学硕士。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化研究员。具备证券投资基金从业资格。 |

注：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。

4.1.1 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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

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，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》、基金合同以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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，国内疫情与国际俄乌冲突的影响，使得供需两条曲线的不确定性加大，叠加金融货币政策博弈，造成在经济发展中积累的部分问题显现。从目前政策面出台的各种政策看，相关问题已经得到各级主管部门重视，内循环外循环上不同程度的栓塞得到关注。短期看，稳增长的政策就是要打通这些血液循环和呼吸系统的堵点；长期看，稳增长更要以此点火，找出可持续增长的新模式。目前看到一点迹象的是以新能源车为初始发力点，推进光伏、储能、以及以车辆为载体的人流物流信息流产业。将过去互联网和全球化初步实现的虚拟世界与现实世界的链接进一步升级、深化与融合，推动生产力的进一步提升。

外循环上，无论是出口还是进口都与供应链的调整与供给曲线的移动相关，而其中的非经济因素，俄乌冲突，显然是一大串经济参数中最有文章可做的一项。自 2022 年 2 月 24 日俄乌冲突爆发，迄今已 4 个月有余，冲突发展已将欧美日韩等主要经济体深度卷入。可以确定的是地缘政治格局将出现不可逆转的变化。经济层面，全球化供应链的大规模重置对于通货膨胀的影响可能是中长期的。考虑到俄、乌不仅是石油和天然气等能源输出国，也是重要农产品和金属原材料的供应者，全球可能遭遇上世纪 70 年代以来最严重的供给冲击。“滞”和“胀”的后果已然发生并会继续。从这个角度看，能够在市场风险偏好下降、利率水平升多降少的情况下承载市场梦想的成长性行业和公司更加稀缺，市场对于盈利和估值的要求会更加苛刻。

今年国家制定的 2022 年 GDP 增长目标目前看完成难度加大，下半年各条线一起发力是确定的，但突破点与突破力度值得大家思考。就近期数据来看，市场认可的几个增量点集中在锂矿、乘用车电气化产业链、光伏储能，而煤炭、有色、石油炼化与基础化工则是主要存量改善领域。归结起来，一方面固定范式的稳增长策略为经济保驾护航，另一方面，围绕新能源积极开展各种基础设施建设与应用场景的自我提升。

根据东方红资产管理提供的指数估值信息，截至 6 月底竞争力指数成分股加权 ROE 约为 15.97%，显著高于沪深 300 约 11.57%，创业板指数约 12.12%的水平。根据指数真实权重计算的 PE 水平约为 15.4 倍，低于沪深 300 约 16.5 倍的估值。同期根据 wind 总市值法公布的中证 500 和创业板指的 PE 水平约 21 倍和 55.5 倍。国际上横向比较 ROE 和 PE 水平的匹配，竞争力指数相较日经 225（8.69%和 19.1 倍）在这两方面均具有优势。和德国 DAX（12.51%和 11.6 倍）比较，竞争力指数的 ROE 水平明显要高，但 PE 上德国 DAX 更低。而标普 500 的 ROE 水平（约 20.15%）虽然较竞争力指数更高，但即使在近期大幅下跌后 PE 估值则达到约 18.7 倍，显著高于竞争力指数。

东方红中证竞争力指数基金作为投资一篮子高 ROE 公司组合的投资载体，在面临种种不确定因素的环境下，保持定力抓住以合理价格投资优秀公司的内生核心理念，适应市场对于盈利和估值更加苛刻的要求，持有优质企业的均衡组合穿越周期，力争赚取优秀企业为投资人带来的长期回报。我们持续关注的竞争力指数成分股组合在持有期盈利能力上相对沪深 300 组合盈利能力的优势继续得到保持，甚至略微超出了通常 3%~4%的区间，而估值上则较为少见的出现了低于沪深 300 指数成分股组合的情况。这是一个值得投资者密切关注的窗口期。我们会持续密切观察竞争力指数的 ROE 和估值水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金 A 类份额净值为 1.3552 元,份额累计净值为 1.3552 元; C 类份额净值为 1.3389 元,份额累计净值为 1.3389 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 7.97%,同期业绩比较基准收益率为 7.31%; C 类份额净值增长率为 7.85%,同期业绩比较基准收益率为 7.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,基金合同生效未满三年,不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 716,496,000.78 | 93.36 |
| | 其中:股票 | 716,496,000.78 | 93.36 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 49,344,819.16 | 6.43 |
| 8 | 其他资产 | 1,586,834.48 | 0.21 |
| 9 | 合计 | 767,427,654.42 | 100.00 |

注:1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 8,969,806.00 | 1.17 |
| B | 采矿业 | 14,872,532.00 | 1.95 |
| C | 制造业 | 422,218,074.94 | 55.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,785,337.00 | 2.59 |
| E | 建筑业 | 21,769,759.11 | 2.85 |
| F | 批发和零售业 | 4,548,068.00 | 0.59 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,951,630.00 | 1.96 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 18,408,874.60 | 2.41 |
| J | 金融业 | 155,288,349.13 | 20.31 |
| K | 房地产业 | 7,358,797.00 | 0.96 |
| L | 租赁和商务服务业 | 10,448,225.00 | 1.37 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 352,032.00 | 0.05 |
| Q | 卫生和社会工作 | 15,723,771.84 | 2.06 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 887,230.00 | 0.12 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 715,582,486.62 | 93.61 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 644,943.03 | 0.08 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 21,401.16 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 216,862.20 | 0.03 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 30,307.77 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 913,514.16 | 0.12 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 600809 | 山西汾酒 | 104,138 | 33,824,022.40 | 4.42 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 14,706 | 30,073,770.00 | 3.93 |
| 3 | 600803 | 新奥股份 | 1,064,300 | 19,785,337.00 | 2.59 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 413,900 | 17,466,580.00 | 2.28 |
| 5 | 600132 | 重庆啤酒 | 117,904 | 17,284,726.40 | 2.26 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 367,100 | 17,139,899.00 | 2.24 |
| 7 | 600660 | 福耀玻璃 | 398,400 | 16,657,104.00 | 2.18 |
| 8 | 002142 | 宁波银行 | 437,929 | 15,682,237.49 | 2.05 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 785,900 | 15,639,410.00 | 2.05 |
| 10 | 601009 | 南京银行 | 1,428,502 | 14,884,990.84 | 1.95 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1 | 688297 | 中无人机 | 3,426 | 182,194.68 | 0.02 |
| 2 | 688400 | 凌云光 | 7,505 | 164,584.65 | 0.02 |
| 3 | 688173 | 希荻微 | 3,641 | 115,128.42 | 0.02 |
| 4 | 688234 | 天岳先进 | 1,545 | 100,718.55 | 0.01 |
| 5 | 301233 | 盛帮股份 | 1,576 | 65,435.52 | 0.01 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动 (元) | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|--------------|---------------|------------|
| IF2209 | IF2209 | 7 | 9,339,120.00 | 726,840.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 726,840.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 63,296.95 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 616,680.00 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并通过对证券市场和期货市场运行趋势的研判，结合对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，以对冲系统性风险和流动性风险。本基金还将利用股指期货，降低股票仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

本基金投资的前十名证券发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到宁波银保监局的处罚；山西杏花村汾酒厂股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到山西省繁峙县工商行政管理局的处罚；兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管

理委员会、中国人民银行、国家外汇管理局福建省分局的处罚。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,235,379.43 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 351,455.05 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,586,834.48 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 688400 | 凌云光 | 164,584.65 | 0.02 | 新股未上市 |
| 2 | 688173 | 希荻微 | 115,128.42 | 0.02 | 新股锁定 |
| 3 | 688234 | 天岳先进 | 100,718.55 | 0.01 | 新股锁定 |
| 4 | 301233 | 盛帮股份 | 58,875.36 | 0.01 | 新股未上市 |
| 4 | 301233 | 盛帮股份 | 6,560.16 | 0.00 | 新股锁定 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东方红中证竞争力指数 A | 东方红中证竞争力指数 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 499,721,766.12 | 75,145,030.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 16,337,740.91 | 2,326,317.38 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 23,711,517.71 | 4,855,231.24 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 492,347,989.32 | 72,616,116.14 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 东方红中证竞争力指数 A | 东方红中证竞争力指数 C |
|--------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 19,777,178.64 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 19,777,178.64 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 4.02 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，本基金管理人不存在申购、赎回或交易本基金的情况。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,005,850.58 | 1.77 | 10,005,850.58 | 1.77 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|----|---------------|------|---------------|------|-----|
| 东 | | | | | |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,005,850.58 | 1.77 | 10,005,850.58 | 1.77 | 3 年 |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：
www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2022 年 7 月 21 日