

# 东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:东方阿尔法基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 28 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2023年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至2023年6月30日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 7  |
| 2.4 信息披露方式                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料                              | 8  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 8  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8  |
| 3.2 基金净值表现                              | 9  |
| §4 管理人报告                                | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14 |
| 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       | 15 |
| §5 托管人报告                                | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15 |
| 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 | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 15 |
| 6.1 资产负债表                               | 15 |
| 6.2 利润表                                 | 17 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 19 |
| 6.4 报表附注                                | 21 |
| §7 投资组合报告                               | 51 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 51 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 52 |
| 7.3 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       | 53 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 56 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 58 |
| 7.6 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      | 59 |
| 7.7 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   | 59 |
| 7.8 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   | 59 |
| 7.9 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      | 59 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 59 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 59 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 59 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 60 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 60 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 61 |

|   |    |
|---|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 61 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                | 61 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 62 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 62 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 62 |
| 10.2 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.....   | 62 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 62 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 63 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 63 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 63 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 63 |
| 10.8 其他重大事件.....                        | 64 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 66 |
| 11.1 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..... | 66 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 66 |
| §12 备查文件目录.....                         | 66 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 66 |
| 12.2 存放地点.....                          | 66 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 67 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                       |                 |
|-----------------|-----------------------|-----------------|
| 基金名称            | 东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 东方阿尔法产业先锋混合           |                 |
| 基金主代码           | 011704                |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                |                 |
| 基金合同生效日         | 2021年07月21日           |                 |
| 基金管理人           | 东方阿尔法基金管理有限公司         |                 |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司            |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 2,844,444,980.62份     |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                   |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 东方阿尔法产业先锋混合A          | 东方阿尔法产业先锋混合C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 011704                | 011705          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,118,493,469.82份     | 725,951,510.80份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | <p>本基金在严格控制风险的前提下，通过产业精选和个股研究，力求选择景气度上行产业中具有先锋优势的优质个股，力争实现基金资产的持续稳定增值。</p>  |
| 投资策略 | <p>本基金的投资策略主要有以下10个方面内容：</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金根据对宏观经济周期的分析研究，结合基本面、市场、政策面等多种因素的综合考量，研判所处经济周期的位置及未来发展方向，以确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过产业精选和个股研究相结合，一方面通过产业精选分析产业景气周期的变化和产业格局的变化，筛选具备投资机会的产业；另一方面，通过对公司定性分析、经营分析和估值探讨，判断公司投资</p> |

价值。选择在景气度上行行业内具有先锋优势的优质上市公司，构成本基金的投资组合。

### 3、存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

### 4、债券类资产投资策略

本基金的债券投资将采取较为积极的策略，通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等，研判各类属固定收益类资产的风险趋势与收益预期，精选个券进行投资。

### 5、可转债（含分离交易可转债）及可交换债券投资策略

对于可转换债券的投资，本基金将在评估其偿债能力的同时兼顾公司的成长性，以期通过转换条款分享因股价上升带来的高收益。

### 6、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

### 7、融资业务的投资策略

本基金将根据相关法律法规的规定参与融资业务。本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。

### 8、国债期货的投资策略

基金管理人将结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。

### 9、股票期权的投资策略

本基金投资股票期权将以套期保值为主要目的，

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>10、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金可以投资包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                               | 基金托管人                       |
|---------|------|-------------------------------------|-----------------------------|
| 名称      |      | 东方阿尔法基金管理有限公司                       | 招商银行股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 曾健                                  | 张姗                          |
|         | 联系电话 | 0755-21872900                       | 0755-83077987               |
|         | 电子邮箱 | service@dfa66.com                   | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-930-6677                        | 95555                       |
| 传真      |      | 0755-21872902                       | 0755-83195201               |
| 注册地址    |      | 深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道6008号深圳特区报业大厦23BC | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦          |
| 办公地址    |      | 深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道6008号深圳特区报业大厦23BC | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦          |
| 邮政编码    |      | 518034                              | 518040                      |
| 法定代表人   |      | 刘明                                  | 缪建民                         |

### 2.4 信息披露方式

|                    |   |
|--------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称     | 证券日报  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网 | <a href="https://www.dfa66.com">https://www.dfa66.com</a> |

|            |                                     |
|------------|-------------------------------------|
| 址          |                                     |
| 基金中期报告备置地点 | 深圳市福田区莲花街道紫荆社区深南大道6008号深圳特区报业大厦23BC |

## 2.5 其他相关资料

| 项目       | 名称                       | 办公地址                         |
|----------|--------------------------|------------------------------|
| 会计师事务所   | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼       |
| 金融运营服务机构 | 招商证券股份有限公司               | 广东省深圳市南山区高新南九道9号金地威新软件科技园6号楼 |

## §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

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期<br>(2023年01月01日-2023年06月30日) |                 |
|---------------|----------------------------------|-----------------|
|               | 东方阿尔法产业先锋混合A                     | 东方阿尔法产业先锋混合C    |
| 本期已实现收益       | -195,904,156.28                  | -65,124,779.76  |
| 本期利润          | -236,374,440.29                  | -76,064,259.71  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1091                          | -0.1073         |
| 本期加权平均净值利润率   | -16.72%                          | -16.64%         |
| 本期基金份额净值增长率   | -15.68%                          | -15.90%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2023年06月30日)            |                 |
| 期末可供分配利润      | -874,781,316.29                  | -303,881,817.82 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.4129                          | -0.4186         |
| 期末基金资产净值      | 1,243,712,153.53                 | 422,069,692.98  |
| 期末基金份额净值      | 0.5871                           | 0.5814          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2023年06月30日)            |                 |



|             |         |         |
|-------------|---------|---------|
| 基金份额累计净值增长率 | -41.29% | -41.86% |
|-------------|---------|---------|

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，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的"期末"均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 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

东方阿尔法产业先锋混合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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | -2.07%   | 1.66%       | 0.62%      | 0.69%         | -2.69%  | 0.97% |
| 过去三个月      | -6.32%   | 1.83%       | -3.82%     | 0.64%         | -2.50%  | 1.19% |
| 过去六个月      | -15.68%  | 1.72%       | 0.62%      | 0.64%         | -16.30% | 1.08% |
| 过去一年       | -26.44%  | 2.16%       | -9.29%     | 0.75%         | -17.15% | 1.41% |
| 自基金合同生效起至今 | -41.29%  | 2.14%       | -16.42%    | 0.87%         | -24.87% | 1.27% |

东方阿尔法产业先锋混合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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | -2.12%   | 1.67%       | 0.62%      | 0.69%         | -2.74%  | 0.98% |
| 过去三个月 | -6.44%   | 1.83%       | -3.82%     | 0.64%         | -2.62%  | 1.19% |
| 过去六个月 | -15.90%  | 1.72%       | 0.62%      | 0.64%         | -16.52% | 1.08% |
| 过去一年  | -26.80%  | 2.16%       | -9.29%     | 0.75%         | -17.51% | 1.41% |
| 自基金合同 | -41.86%  | 2.14%       | -16.42%    | 0.87%         | -25.44% | 1.27% |

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

注：1、本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。

2、本基金自2021年7月21日成立至今尚未满三年，无过去三年、过去五年的净值表现。

### 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

东方阿尔法产业先锋混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月21日-2023年06月30日)



东方阿尔法产业先锋混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月21日-2023年06月30日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东方阿尔法基金管理有限公司（以下简称“东方阿尔法基金”）于2017年6月24日经中国证监会批准，2017年7月4日注册成立，公司总部设在广东省深圳市，证券期货业务范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理。截至报告期末，注册资本为1亿元人民币。

东方阿尔法基金作为华南地区首家纯员工持股的公募基金管理公司，公司股权结构为刘明、珠海共同成长投资合伙企业（有限合伙）、肖冰、雷振锋、曾健分别持有公司39.96%、39.56%、13.98%、4.5%和2%的股权。

截至报告期末，东方阿尔法基金管理资产规模82.86亿元，旗下管理8只公开募集证券投资基金和3只私募资产管理计划。

#### 4.1.2 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 |        |  |
| 唐雷 | 助理总经理、研究部总监、基金经理 | 2021-07-21  | -    | 13年    | 唐雷先生，武汉大学物理学理学学士，北京大学光华管理学院工商管理硕士。曾先后任职于民生加银基金、安信证券资产管理部、金信基金。现任东方阿尔法基金助理总经理、研究部总监、基金经理。 |

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公告确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指公告确定的任职日期和离任日期。

2. 证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金《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。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 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

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

本报告期内，本基金管理人利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗（包括当日内、3日内、5日内）对基金管理人管理的不同投资组合反向交易和同向交易的交易价差监控进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在参与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的5%的情况，且不存在其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 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

2023年上半年A股市场大体上处于弱势震荡的格局。后疫情时代，“疤痕效应”和地产下行导致经济弱复苏，市场进入存量博弈阶段。市场资金的存量博弈，一方面导致市场缺乏整体性机会，处于持续震荡的弱势格局；另一方面更重要的是场内资金的腾挪、此消彼长，导致市场风格的显著分化。

市场风格的分化，体现在小市值股票的强势、低估值蓝筹阶段性行情、AI主题的迅速崛起、行业轮动的加速，也体现在业绩因子失效，以新能源为代表的高景气成长板块遭遇系统性估值下杀。

面对市场从增量资金定价转为存量博弈，市场风格发生了巨大变化和分化，我们的投资在今年上半年面临困境和挑战。以光伏和储能为代表的新能源行业虽然今年景气依然高涨、业绩依然优秀，但是由于其在过去三年多的高景气 and 优异表现，聚集了太多的场内资金，在存量博弈情况下，承受巨大的估值下行压力。同时，随着时间的推移，行业不可避免竞争加剧，需求端也有降速的隐忧，新能源的行业景气越来越有高位回落的风险。对于基本面景气的担忧，以及资金估值层面的双重作用，新能源行业表现不佳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东方阿尔法产业先锋混合A基金份额净值为0.5871元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.68%，同期业绩比较基准收益率为0.62%；截至报告期末东方阿尔法产业先锋混合C基金份额净值为0.5814元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.90%，同期业绩比较基准收益率为0.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

面对二季度以来较为疲弱的宏观经济形势，7月中央政治局会议指出，要加强逆周期调节和政策储备，保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定，要活跃资本市场。产业政策方面，会议强调要积极扩大国内需求，要提振汽车、电子产品、家居等大宗消费，推动数字经济与先进制造业深度融合，促进人工智能安全发展，适时调整优化房地产政策，因城施策用好政策工具箱，更好满足居民刚性和改善性住房需求。政治局会议定调积极，对市场关切的几方面都做出了正面回应，政策面出现积极拐点。我们判断在政策底出现之后，随着时间推移疫后“疤痕效应”逐步减弱，宏观经济有望企稳，扭转市场的悲观预期，同时也能够逐步稳定和活跃资本市场。

中期来看，“房住不炒”的背景下，房地产市场承压，居民部门持续去杠杆，我国正在经历经济增速换挡和结构调整的关键期，经济增长中枢下移以及资本市场存量博弈的格局将会持续一段时间。从一季度末开始，当我们意识到市场风格和偏好的变化之后，已经逐步在寻找新能源之后值得重点投资的产业趋势和投资方向，站在目前的时间点，我们重点关注科技成长领域的三个方向：

首先，半导体国产替代是目前最重要也是最明显的产业趋势。从2019年华为被美国加入实体清单之后，美国对我国进行了多方位的技术封锁和禁运，与之对应，我国半导体领域的国产替代不断提速。半导体行业是现代经济活动的基础，随着地缘政治形势持续紧张，半导体尤其是半导体设备材料环节的国产替代是未来综合国力较量的胜负手之一。从产业链调研中，我们也看到半导体设备材料各环节的产品技术研发进展迅速、政策支持到位、企业国产化动力充沛，产业链上下一条心，半导体（尤其是半导体设备材料）国产替代的产业趋势强劲。

其次，人工智能（AI）、MR等新技术新应用有望引领新的产业趋势。由于对主题投资过于谨慎，我们上半年错过了人工智能的板块性机会。但是在这个过程中，我们一直对以Chat GPT为代表的人工智能发展给予积极的关注和研究。我们判断随着海外和国内对AI投入的增加、应用场景的落地，AI未来将逐步由从0到1的导入期进入从1到10的成长期，对应的二级市场将从主题投资阶段进入成长股投资阶段。我们将注重寻找在人工智能产业从1到10的成长期，具有基本面趋势的细分方向和公司，尤其我们将重点关注引领国内人工智能产业发展的AI芯片和算力、AI大模型、AI应用等等领域的龙头公司。

最后，我们看好半导体景气见底之后的上行趋势。半导体景气周期在2022年初见顶，经过了一年半左右的下行周期，行业经历了需求萎缩和强烈的库存去化。随着库存的逐步去化，在部分环节已经出现明显的触底信号。今年下半年，随着旺季来临以及库存进一步去化，半导体行业将探底回升。到今年四季度和明年上半年，产业链从去库存到补库存、消费电子等需求端逐步恢复，以及人工智能和MR等新技术新应用的拉动，半导体景气上行趋势将会越来越明确。

未来一段时间，我们将从以上三个方向去寻找投资机会、构建投资组合。目前我们重点看好半导体领域的国产替代和景气上行趋势，重点配置半导体设备、半导体材料、部分受益于国产替代和景气上行共振的半导体设计公司。同时，我们会积极寻找和配置人工智能（AI）、MR等新产业趋势中从1到10的成长性投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人已将本基金的基金估值核算业务外包给本基金的金融运营服务机构--招商证券股份有限公司。本基金金融运营服务机构按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金金融运营服务机构使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。金融运营服务机构改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。

本基金管理人建立了估值小组，成员由运作保障部、公募投资部、专户投资部、研究部和监察稽核部业务骨干组成，负责指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 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

无

### §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

托管人声明:

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

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 9,032,552.11       | 26,028,122.48       |
| 结算备付金      |         | 2,026,072.68       | 2,010,883.84        |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 存出保证金         |            | -                          | -                           |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 1,657,585,631.81           | 2,011,544,718.18            |
| 其中：股票投资       |            | 1,559,529,644.41           | 1,899,263,033.38            |
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | 98,055,987.40              | 112,281,684.80              |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资         |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                          | -                           |
| 债权投资          |            | -                          | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                          | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 529,941.89                 | 507,738.32                  |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 1,669,174,198.49           | 2,040,091,462.82            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2022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        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | 23,993,414.24               |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |



|             |         |                   |                  |
|-------------|---------|-------------------|------------------|
| 应付赎回款       |         | 705,504.74        | 1,213,689.80     |
| 应付管理人报酬     |         | 2,063,977.24      | 2,551,967.68     |
| 应付托管费       |         | 343,996.22        | 425,327.94       |
| 应付销售服务费     |         | 174,250.35        | 202,398.45       |
| 应付投资顾问费     |         | -                 | -                |
| 应交税费        |         | -                 | -                |
| 应付利润        |         | -                 | -                |
| 递延所得税负债     |         | -                 | -                |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 104,623.43        | 210,599.71       |
| 负债合计        |         | 3,392,351.98      | 28,597,397.82    |
| <b>净资产：</b> |         |                   |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 2,844,444,980.62  | 2,893,643,286.11 |
| 其他综合收益      |         | -                 | -                |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | -1,178,663,134.11 | -882,149,221.11  |
| 净资产合计       |         | 1,665,781,846.51  | 2,011,494,065.00 |
| 负债和净资产总计    |         | 1,669,174,198.49  | 2,040,091,462.82 |

注：报告截止日2023年06月30日，东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.5871元，C类基金份额净值0.5814元，基金总份额2,844,444,980.62份，其中A类基金份额2,118,493,469.82份，C类基金份额725,951,510.80份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目        | 附注号     | 本期<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至202<br>2年06月30日 |
|-----------|---------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入   |         | -294,593,302.88                   | -265,759,687.19                        |
| 1.利息收入    |         | 44,884.79                         | 49,469.25                              |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 44,884.79                         | 49,469.25                              |
| 债券利息收入    |         | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息  |         | -                                 | -                                      |

|                       |            |                 |                 |
|-----------------------|------------|-----------------|-----------------|
| 收入                    |            |                 |                 |
| 买入返售金融资产收入            |            | -               | -               |
| 证券出借利息收入              |            | -               | -               |
| 其他利息收入                |            | -               | -               |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | -243,529,146.85 | -741,790,406.70 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10   | -250,890,672.24 | -749,609,406.66 |
| 基金投资收益                | 6.4.7.11   | -               | -               |
| 债券投资收益                | 6.4.7.12   | 2,653,003.72    | 2,410,216.66    |
| 资产支持证券投资              | 6.4.7.13   | -               | -               |
| 收益                    |            |                 |                 |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -               | -               |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -               | -               |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 4,708,521.67    | 5,408,783.30    |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 |            | -               | -               |
| 其他投资收益                |            | -               | -               |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -51,409,763.96  | 475,150,334.96  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -               | -               |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 300,723.14      | 830,915.30      |
| <b>减：二、营业总支出</b>      |            | 17,845,397.12   | 21,057,839.38   |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 13,942,878.32   | 16,592,608.09   |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 2,323,813.12    | 2,765,434.68    |
| 3. 销售服务费              | 6.4.10.2.3 | 1,134,062.07    | 1,328,841.16    |
| 4. 投资顾问费              |            | -               | -               |
| 5. 利息支出               |            | 336,405.53      | 261,983.91      |
| 其中：卖出回购金融资产           |            | 336,405.53      | 261,983.91      |

|                     |          |                 |                 |
|---------------------|----------|-----------------|-----------------|
| 支出                  |          |                 |                 |
| 6. 信用减值损失           |          | -               | -               |
| 7. 税金及附加            |          | 5.53            | 2.51            |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.19 | 108,232.55      | 108,969.03      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | -312,438,700.00 | -286,817,526.57 |
| 减：所得税费用             |          | -               | -               |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | -312,438,700.00 | -286,817,526.57 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -               | -               |
| 六、综合收益总额            |          | -312,438,700.00 | -286,817,526.57 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |        |                 |                  |
|----------------------|-------------------------------|--------|-----------------|------------------|
|                      | 实收基金                          | 其他综合收益 | 未分配利润           | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产（基金净值）      | 2,893,643,286.11              | -      | -882,149,221.11 | 2,011,494,065.00 |
| 加：会计政策变更             | -                             | -      | -               | -                |
| 前期差错更正               | -                             | -      | -               | -                |
| 其他                   | -                             | -      | -               | -                |
| 二、本期期初净资产（基金净值）      | 2,893,643,286.11              | -      | -882,149,221.11 | 2,011,494,065.00 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -49,198,305.49                | -      | -296,513,913.00 | -345,712,218.49  |
| （一）、综合收益总额           | -                             | -      | -312,438,700.00 | -312,438,700.00  |

|  |                                    |        |                   |                  |
|--|------------------------------------|--------|-------------------|------------------|
| （二）、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）      | -49,198,305.49                     | -      | 15,924,787.00     | -33,273,518.49   |
| 其中：1.基金申购款                               | 318,144,740.86                     | -      | -112,305,336.86   | 205,839,404.00   |
| 2.基金赎回款                                  | -367,343,046.35                    | -      | 128,230,123.86    | -239,112,922.49  |
| （三）、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） | -                                  | -      | -                 | -                |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                  | -      | -                 | -                |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 2,844,444,980.62                   | -      | -1,178,663,134.11 | 1,665,781,846.51 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |        |                   |                  |
|  | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润             | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 3,018,286,377.61                   | -      | -338,033,829.99   | 2,680,252,547.62 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                  | -      | -                 | -                |
| 前期差错更正                                   | -                                  | -      | -                 | -                |
| 其他                                       | -                                  | -      | -                 | -                |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 3,018,286,377.61                   | -      | -338,033,829.99   | 2,680,252,547.62 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -59,905,462.32                     | -      | -261,926,129.14   | -321,831,591.46  |
| （一）、综合收                                  | -                                  | -      | -286,817,526.57   | -286,817,526.57  |

|  |                  |   |                 |                  |
|--|------------------|---|-----------------|------------------|
| 益总额                                      |                  |   |                 |                  |
| (二)、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)      | -59,905,462.32   | - | 24,891,397.43   | -35,014,064.89   |
| 其中:1.基金申购款                               | 527,945,735.38   | - | -134,001,021.01 | 393,944,714.37   |
| 2.基金赎回款                                  | -587,851,197.70  | - | 158,892,418.44  | -428,958,779.26  |
| (三)、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) | -                | - | -               | -                |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                | - | -               | -                |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 2,958,380,915.29 | - | -599,959,959.13 | 2,358,420,956.16 |

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:

刘明

曹渊

张珂

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

东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金(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[2021]第378号《关于准予东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由东方阿尔法基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》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人民币3,001,977,263.20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(2021)第0687号验资报告予以验证。经向中国证

监会备案，《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》于2021年7月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,003,173,765.96份基金份额，其中认购资金利息折合1,196,502.76份基金份额。本基金的基金管理人为东方阿尔法基金管理有限公司，基金金融运营服务机构为招商证券股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,001,643.79份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》和《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书》(含更新)，本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；不收取认购/申购费、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方阿尔法产业先锋混合型发起式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(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货、国债期货、股票期权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的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的60%-95%；其中投资于基金合同界定的产业先锋相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数收益率×20%。

#### 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<年度报告和中期报告>》、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》、《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》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2023年度中期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2023年6月30日的财务状况以及2023年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **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估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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)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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2023年06月30日 |
|--------|--------------------|
| 活期存款   | 6,145,321.68       |
| 等于：本金  | 6,144,697.51       |
| 加：应计利息 | 624.17             |
| 减：坏账准备 | -                  |
| 定期存款   | -                  |
| 等于：本金  | -                  |
| 加：应计利息 | -                  |
| 减：坏账准备 | -                  |



|              |              |
|--------------|--------------|
| 其中：存款期限1个月以内 | -            |
| 存款期限1-3个月    | -            |
| 存款期限3个月以上    | -            |
| 其他存款         | 2,887,230.43 |
| 等于：本金        | 2,886,666.72 |
| 加：应计利息       | 563.71       |
| 减：坏账准备       | -            |
| 合计           | 9,032,552.11 |

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年06月30日 |               |                  |               |           |
|---------------|--------------------|---------------|------------------|---------------|-----------|
|               | 成本                 | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动        |           |
| 股票            | 1,559,482,327.01   | -             | 1,559,529,644.41 | 47,317.40     |           |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -             | -                | -             |           |
| 债券            | 交易所市场              | 96,755,002.00 | 1,253,557.40     | 98,055,987.40 | 47,428.00 |
|               | 银行间市场              | -             | -                | -             | -         |
|               | 合计                 | 96,755,002.00 | 1,253,557.40     | 98,055,987.40 | 47,428.00 |
| 资产支持证券        | -                  | -             | -                | -             |           |
| 基金            | -                  | -             | -                | -             |           |
| 其他            | -                  | -             | -                | -             |           |
| 合计            | 1,656,237,329.01   | 1,253,557.40  | 1,657,585,631.81 | 94,745.40     |           |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 485.08             |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | -                  |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 104,138.35         |
| 合计          | 104,623.43         |

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 东方阿尔法产业先锋混合A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(东方阿尔法产业先锋混合A) | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                  |
|----------------------|-------------------------------|------------------|
|                      | 基金份额（份）                       | 账面金额             |
| 上年度末                 | 2,199,439,375.62              | 2,199,439,375.62 |
| 本期申购                 | 99,194,457.87                 | 99,194,457.87    |
| 本期赎回（以“-”号填列）        | -180,140,363.67               | -180,140,363.67  |
| 本期末                  | 2,118,493,469.82              | 2,118,493,469.82 |

##### 6.4.7.7.2 东方阿尔法产业先锋混合C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(东方阿尔法产业先锋混合C) | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                 |
|----------------------|-------------------------------|-----------------|
|                      | 基金份额（份）                       | 账面金额            |
| 上年度末                 | 694,203,910.49                | 694,203,910.49  |
| 本期申购                 | 218,950,282.99                | 218,950,282.99  |
| 本期赎回（以“-”号填列）        | -187,202,682.68               | -187,202,682.68 |
| 本期末                  | 725,951,510.80                | 725,951,510.80  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 东方阿尔法产业先锋混合A

单位：人民币元

| 项目<br>(东方阿尔法产业先锋混合A) | 已实现部分           | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期期初                 | -684,799,675.42 | 16,930,084.09  | -667,869,591.33 |
| 本期利润                 | -195,904,156.28 | -40,470,284.01 | -236,374,440.29 |
| 本期基金份额交易产生的变动数       | 29,306,863.52   | 155,851.81     | 29,462,715.33   |
| 其中：基金申购款             | -34,534,616.34  | 172,140.47     | -34,362,475.87  |
| 基金赎回款                | 63,841,479.86   | -16,288.66     | 63,825,191.20   |
| 本期已分配利润              | -               | -              | -               |
| 本期末                  | -851,396,968.18 | -23,384,348.11 | -874,781,316.29 |

#### 6.4.7.8.2 东方阿尔法产业先锋混合C

单位：人民币元

| 项目<br>(东方阿尔法产业先锋混合C) | 已实现部分           | 未实现部分          | 未分配利润合计         |
|----------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期期初                 | -219,513,195.61 | 5,233,565.83   | -214,279,629.78 |
| 本期利润                 | -65,124,779.76  | -10,939,479.95 | -76,064,259.71  |
| 本期基金份额交易产            | -11,241,921.75  | -2,296,006.58  | -13,537,928.33  |

|          |                 |               |                 |
|----------|-----------------|---------------|-----------------|
| 生的变动数    |                 |               |                 |
| 其中：基金申购款 | -77,640,743.08  | -302,117.91   | -77,942,860.99  |
| 基金赎回款    | 66,398,821.33   | -1,993,888.67 | 64,404,932.66   |
| 本期已分配利润  | -               | -             | -               |
| 本期末      | -295,879,897.12 | -8,001,920.70 | -303,881,817.82 |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                      |
|-----------|-------------------------|
|           | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 活期存款利息收入  | 12,018.10               |
| 定期存款利息收入  | -                       |
| 其他存款利息收入  | 17,677.85               |
| 结算备付金利息收入 | 15,188.84               |
| 其他        | -                       |
| 合计        | 44,884.79               |

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                      |
|------------|-------------------------|
|            | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 1,944,575,096.71        |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,189,731,738.87        |
| 减：交易费用     | 5,734,030.08            |
| 买卖股票差价收入   | -250,890,672.24         |

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,165,824.15                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,487,179.57                  |
| 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                           | 2,653,003.72                  |

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 101,311,125.68                |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 97,854,866.78                 |
| 减：应计利息总额               | 1,960,494.22                  |
| 减：交易费用                 | 8,585.11                      |
| 买卖债券差价收入               | 1,487,179.57                  |

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 4,708,521.67                  |
| 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            | 4,708,521.67                  |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | -51,409,763.96                |
| ——股票投资                 | -51,803,865.74                |
| ——债券投资                 | 394,101.78                    |
| ——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                     | -51,409,763.96                |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 299,753.17                    |
| 转换费收入   | 969.97                        |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 300,723.14 |
|----|------------|

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中A类份额不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额赎回费全部归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 审计费用    | 44,630.98                     |
| 信息披露费   | 59,507.37                     |
| 证券出借违约金 | -                             |
| 汇划手续费   | 4,094.20                      |
| 合计      | 108,232.55                    |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 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      |
|--------------------------|--------------|
| 东方阿尔法基金管理有限公司(“东方阿尔法基金”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”)       | 基金托管人、基金销售机构 |
| 珠海共同成长投资合伙企业(有限合伙)       | 基金管理人股东      |
| 刘明                       | 基金管理人股东      |

|     |         |
|-----|---------|
| 肖冰  | 基金管理人股东 |
| 雷振锋 | 基金管理人股东 |
| 曾健  | 基金管理人股东 |

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2023年01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 13,942,878.32                 | 16,592,608.09                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,368,897.06                  | 5,911,448.55                       |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费



E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
|                | 2023年01月01日至2023年06月30日 | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,323,813.12            | 2,765,434.68            |

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 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                      |              |           |
|----------------|-------------------------|--------------|-----------|
|                | 2023年01月01日至2023年06月30日 |              |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |              |           |
|                | 东方阿尔法产业先锋混合A            | 东方阿尔法产业先锋混合C | 合计        |
| 招商银行           | 0.00                    | 54,326.52    | 54,326.52 |
| 东方阿尔法基金        | 0.00                    | 4,690.42     | 4,690.42  |
| 合计             | 0.00                    | 59,016.94    | 59,016.94 |

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |              |           |
|----------------|------------------------------------|--------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |              |           |
|                | 东方阿尔法产业先锋混合A                       | 东方阿尔法产业先锋混合C | 合计        |
| 招商银行股份有限公司     | 0.00                               | 59,988.98    | 59,988.98 |
| 东方阿尔法基金管理有限公司  | 0.00                               | 6,798.56     | 6,798.56  |
| 合计             | 0.00                               | 66,787.54    | 66,787.54 |

注：1、本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.5%。

2、本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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

支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.4.2 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未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

东方阿尔法产业先锋混合A

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2023年01月01日至<br>2023年06月30日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至<br>2022年06月30日 |
|---------------------|-----------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额         | 5,000,225.04                      | 5,000,225.04                           |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                                 | -                                      |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                                 | -                                      |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                                 | -                                      |
| 报告期末持有的基金份额         | 5,000,225.04                      | 5,000,225.04                           |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.24%                             | 0.22%                                  |

注:1. 以上表中"报告期末持有的基金份额占基金总份额比例"的计算中,对下属不同类别基金比例的分母采用各自级别的份额。

2. 报告期内基金管理人未运用固有资金投资"东方阿尔法产业先锋混合C"。

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

份额单位：份

东方阿尔法产业先锋混合A

| 关联方名称 | 本期末<br>2023年06月30日 |                  | 上年度末<br>2022年12月31日 |                  |
|-------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 曾健    | 580,186.27         | 0.03%            | 938,404.27          | 0.04%            |
| 刘明    | 2,000,450.36       | 0.09%            | 2,000,450.36        | 0.09%            |

|    |              |       |              |       |
|----|--------------|-------|--------------|-------|
| 肖冰 | 2,813,753.36 | 0.13% | 2,813,753.36 | 0.13% |
|----|--------------|-------|--------------|-------|

东方阿尔法产业先锋混合C

| 关联方名称 | 本期末<br>2023年06月30日 |                  | 上年度末<br>2022年12月31日 |                  |
|-------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 曾健    | 1,000.00           | 0.00%            | 1,000.00            | 0.00%            |
| 肖冰    | 6,000.00           | 0.00%            | 6,000.00            | 0.00%            |

注:1.以上表中"持有的基金份额占基金总份额的比例"的计算中,对下属不同类别基金比例的分母采用各自级别的份额。

2.上述关联方投资本基金适用的认购、申购、赎回费率按照本基金招募说明书的费率执行。

**6.4.10.6 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<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |           | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |           |
|------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
|            | 期末余额                          | 当期利息收入    | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 招商银行股份有限公司 | 6,145,321.68                  | 12,018.10 | 6,943,323.12                       | 15,132.26 |

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末(2023年06月30日)本基金持有的流通受限证券**

6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |       |         |        |        |          |               |               |    |
|----------------------|------|------------|-------|---------|--------|--------|----------|---------------|---------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期   | 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 |
| 300763               | 锦浪科技 | 2023-02-08 | 6个月   | 非公开发行锁定 | 150.00 | 101.14 | 266,666  | 39,999,990.00 | 26,970,599.24 | -  |
| 688063               | 派能科技 | 2023-02-10 | 6个月   | 非公开发行锁定 | 249.25 | 191.39 | 140,421  | 34,999,934.25 | 26,875,175.19 | -  |
| 688249               | 晶合集成 | 2023-04-24 | 6个月   | 新股流通受限  | 19.86  | 18.06  | 7,405    | 147,063.30    | 133,734.30    | -  |
| 301395               | 仁信新材 | 2023-06-21 | 6个交易日 | 新股未上市   | 26.68  | 26.68  | 4,676    | 124,755.68    | 124,755.68    | -  |
| 688472               | 阿特斯  | 2023-06-02 | 6个月   | 新股流通受限  | 11.10  | 17.04  | 6,261    | 69,497.10     | 106,687.44    | -  |
| 301292               | 海科新源 | 2023-06-29 | 6个交易日 | 新股未上市   | 19.99  | 19.99  | 5,241    | 104,767.59    | 104,767.59    | -  |
| 301358               | 湖南裕能 | 2023-02-01 | 6个月   | 新股流通受限  | 23.77  | 42.89  | 2,023    | 48,086.71     | 86,766.47     | -  |
| 688307               | 中润光学 | 2023-02-08 | 6个月   | 新股流通受限  | 23.88  | 31.73  | 2,455    | 58,625.40     | 77,897.15     | -  |
| 688603               | 天承科技 | 2023-06-30 | 6个交易日 | 新股未上市   | 55.00  | 55.00  | 1,391    | 76,505.00     | 76,505.00     | -  |
| 688469               | 中芯集成 | 2023-04-28 | 6个月   | 新股流通受限  | 5.69   | 5.41   | 13,800   | 78,522.00     | 74,658.00     | -  |

|        |      |            |           |                |        |        |       |               |               |   |
|--------|------|------------|-----------|----------------|--------|--------|-------|---------------|---------------|---|
| 301260 | 格力博  | 2023-01-20 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 30.85  | 23.63  | 3,121 | 96,28<br>2.85 | 73,74<br>9.23 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 5个交易<br>日 | 新股<br>未上<br>市  | 25.82  | 25.82  | 2,754 | 71,10<br>8.28 | 71,10<br>8.28 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 7个交易<br>日 | 新股<br>未上<br>市  | 36.90  | 36.90  | 1,775 | 65,49<br>7.50 | 65,49<br>7.50 | - |
| 688531 | 日联科技 | 2023-03-24 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 152.38 | 135.97 | 346   | 52,72<br>3.48 | 47,04<br>5.62 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023-05-04 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 76.80  | 107.95 | 364   | 27,95<br>5.20 | 39,29<br>3.80 | - |
| 688146 | 中船特气 | 2023-04-13 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 36.15  | 38.13  | 1,011 | 36,54<br>7.65 | 38,54<br>9.43 | - |
| 301291 | 明阳电气 | 2023-06-21 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 38.13  | 31.03  | 1,206 | 45,98<br>4.78 | 37,42<br>2.18 | - |
| 001286 | 陕西能源 | 2023-03-31 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 9.60   | 9.41   | 3,767 | 36,16<br>3.20 | 35,44<br>7.47 | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023-03-30 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 6.58   | 7.58   | 4,016 | 26,42<br>5.28 | 30,44<br>1.28 | - |
| 001287 | 中电港  | 2023-03-30 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 11.88  | 21.02  | 1,386 | 16,46<br>5.68 | 29,13<br>3.72 | - |
| 301246 | 宏源药业 | 2023-03-10 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 50.00  | 30.71  | 931   | 46,55<br>0.00 | 28,59<br>1.01 | - |
| 301310 | 鑫宏业  | 2023-05-26 | 6个月       | 新股<br>流通<br>受限 | 67.28  | 65.43  | 409   | 27,51<br>7.52 | 26,76<br>0.87 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023-06-21 | 6个月       | 新股<br>流通       | 26.74  | 40.68  | 648   | 17,32<br>7.52 | 26,36<br>0.64 | - |

|        |      |            |     |        |        |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|--------|--------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      |            |     | 受限     |        |       |       |           |           |   |
| 301303 | 真兰仪表 | 2023-02-13 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.80  | 22.32 | 1,058 | 28,354.40 | 23,614.56 | - |
| 688552 | 航天南湖 | 2023-05-08 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.17  | 23.50 | 956   | 20,238.52 | 22,466.00 | - |
| 688570 | 天玛智控 | 2023-05-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 30.26  | 25.33 | 884   | 26,749.84 | 22,391.72 | - |
| 301307 | 美利信  | 2023-04-14 | 6个月 | 新股流通受限 | 32.34  | 31.86 | 687   | 22,217.58 | 21,887.82 | - |
| 688543 | 国科军工 | 2023-06-14 | 6个月 | 新股流通受限 | 43.67  | 53.05 | 410   | 17,904.70 | 21,750.50 | - |
| 301322 | 绿通科技 | 2023-02-27 | 6个月 | 新股流通受限 | 131.11 | 53.24 | 391   | 34,219.71 | 20,816.84 | - |
| 688458 | 美芯晟  | 2023-05-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 75.00  | 90.76 | 221   | 16,575.00 | 20,057.96 | - |
| 301262 | 海看股份 | 2023-06-13 | 6个月 | 新股流通受限 | 30.22  | 25.50 | 692   | 20,912.24 | 17,646.00 | - |
| 688623 | 双元科技 | 2023-05-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 125.88 | 86.79 | 178   | 22,406.64 | 15,448.62 | - |
| 301332 | 德尔玛  | 2023-05-09 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.81  | 13.73 | 1,122 | 16,616.82 | 15,405.06 | - |
| 301408 | 华人健康 | 2023-02-22 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.24  | 16.95 | 879   | 14,274.96 | 14,899.05 | - |
| 301397 | 溯联股份 | 2023-06-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 53.27  | 40.20 | 362   | 19,283.74 | 14,552.40 | - |
| 68833  | 西高   | 2023-      | 6个月 | 新股     | 14.16  | 16.21 | 888   | 12,57     | 14,39     | - |

|        |      |            |     |        |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 4      | 院    | 06-09      |     | 流通受限   |       |       |       | 4.08      | 4.48      |   |
| 688593 | 新相微  | 2023-05-25 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.18 | 14.59 | 959   | 10,721.62 | 13,991.81 | - |
| 301387 | 光大同创 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股流通受限 | 58.32 | 45.36 | 307   | 17,904.24 | 13,925.52 | - |
| 301395 | 仁信新材 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.68 | 26.68 | 520   | 13,873.60 | 13,873.60 | - |
| 301210 | 金杨股份 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股流通受限 | 57.88 | 49.17 | 281   | 16,264.28 | 13,816.77 | - |
| 688512 | 慧智微  | 2023-05-08 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.92 | 19.16 | 721   | 15,083.32 | 13,814.36 | - |
| 301382 | 蜂助手  | 2023-05-09 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.80 | 32.84 | 408   | 9,710.40  | 13,398.72 | - |
| 301320 | 豪江智能 | 2023-06-01 | 6个月 | 新股流通受限 | 13.06 | 20.62 | 642   | 8,384.52  | 13,238.04 | - |
| 688433 | 华曙高科 | 2023-04-07 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.66 | 31.50 | 418   | 11,143.88 | 13,167.00 | - |
| 688629 | 华丰科技 | 2023-06-16 | 6个月 | 新股流通受限 | 9.26  | 18.59 | 708   | 6,556.08  | 13,161.72 | - |
| 688620 | 安凯微  | 2023-06-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.68 | 12.34 | 1,016 | 10,850.88 | 12,537.44 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023-04-17 | 6个月 | 新股流通受限 | 71.88 | 92.60 | 134   | 9,631.92  | 12,408.40 | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023-06-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.99 | 19.99 | 583   | 11,654.17 | 11,654.17 | - |



|        |      |            |     |        |       |       |     |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 688523 | 航天环宇 | 2023-05-26 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.86 | 23.85 | 472 | 10,317.92 | 11,257.20 | - |
| 603135 | 中重科技 | 2023-03-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.80 | 17.89 | 628 | 11,178.40 | 11,234.92 | - |
| 301141 | 中科磁业 | 2023-03-27 | 6个月 | 新股流通受限 | 41.20 | 42.69 | 262 | 10,794.40 | 11,184.78 | - |
| 301225 | 恒勃股份 | 2023-06-08 | 6个月 | 新股流通受限 | 35.66 | 33.26 | 333 | 11,874.78 | 11,075.58 | - |
| 301429 | 森泰股份 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.75 | 21.02 | 499 | 14,346.25 | 10,488.98 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.36 | 11.84 | 875 | 9,065.00  | 10,360.00 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023-06-19 | 6个月 | 新股流通受限 | 25.28 | 29.87 | 336 | 8,494.08  | 10,036.32 | - |
| 688479 | 友车科技 | 2023-05-04 | 6个月 | 新股流通受限 | 33.99 | 29.49 | 332 | 11,284.68 | 9,790.68  | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023-06-08 | 6个月 | 新股流通受限 | 72.50 | 58.42 | 165 | 11,962.50 | 9,639.30  | - |
| 301376 | 致欧科技 | 2023-06-14 | 6个月 | 新股流通受限 | 24.66 | 22.51 | 420 | 10,357.20 | 9,454.20  | - |
| 301355 | 南王科技 | 2023-06-02 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.55 | 16.75 | 563 | 9,880.65  | 9,430.25  | - |
| 301357 | 北方长龙 | 2023-04-11 | 6个月 | 新股流通受限 | 50.00 | 48.39 | 190 | 9,500.00  | 9,194.10  | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023-03-21 | 6个月 | 新股流通   | 29.99 | 23.79 | 378 | 11,336.22 | 8,992.62  | - |

|        |      |            |     |        |       |       |     |           |          |   |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|-----------|----------|---|
|        |      |            |     | 受限     |       |       |     |           |          |   |
| 301323 | 新莱福  | 2023-05-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 39.06 | 39.36 | 228 | 8,905.68  | 8,974.08 | - |
| 688429 | 时创能源 | 2023-06-20 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.20 | 25.53 | 346 | 6,643.20  | 8,833.38 | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023-01-20 | 6个月 | 新股流通受限 | 33.73 | 31.85 | 277 | 9,343.21  | 8,822.45 | - |
| 301170 | 锡南科技 | 2023-06-16 | 6个月 | 新股流通受限 | 34.00 | 34.93 | 250 | 8,500.00  | 8,732.50 | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.66 | 12.26 | 664 | 7,742.24  | 8,140.64 | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023-03-01 | 6个月 | 新股流通受限 | 56.50 | 52.93 | 150 | 8,475.00  | 7,939.50 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 6个月 | 新股流通受限 | 25.82 | 25.82 | 306 | 7,900.92  | 7,900.92 | - |
| 301203 | 国泰环保 | 2023-03-28 | 6个月 | 新股流通受限 | 46.13 | 34.40 | 225 | 10,379.25 | 7,740.00 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.00 | 55.00 | 140 | 7,700.00  | 7,700.00 | - |
| 300804 | 广康生化 | 2023-06-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 42.45 | 32.97 | 226 | 9,593.70  | 7,451.22 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 36.90 | 36.90 | 198 | 7,306.20  | 7,306.20 | - |
| 001380 | 华纬科技 | 2023-05-09 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.84 | 30.78 | 170 | 4,902.80  | 5,232.60 | - |
| 60312  | 常青   | 2023-      | 6个月 | 新股     | 25.98 | 24.53 | 160 | 4,156.    | 3,924.   | - |

|        |      |            |     |        |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 5      | 科技   | 03-30      |     | 流通受限   |       |       |     | 80       | 80       |   |
| 001328 | 登康口腔 | 2023-03-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.68 | 25.49 | 145 | 2,998.60 | 3,696.05 | - |
| 001360 | 南矿集团 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.38 | 14.87 | 177 | 2,722.26 | 2,631.99 | - |
| 603137 | 恒尚节能 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.90 | 17.09 | 139 | 2,210.10 | 2,375.51 | - |
| 001367 | 海森药业 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股流通受限 | 44.48 | 39.48 | 55  | 2,446.40 | 2,171.40 | - |
| 603172 | 万丰股份 | 2023-04-28 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.58 | 16.13 | 122 | 1,778.76 | 1,967.86 | - |

注：1.根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

2.根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

3.根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

4.基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

5.基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 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因参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和交易所回购等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的三级风险防控体系。一级风险防范指基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等。二级风险防范指在公司投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。公司经理层设投资决策委员会，对涉及基金投资的重大问题进行决策，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部在督察长的领导下，独立于公司各业务部门，对各岗位、各部门、各项业务中的风险控制情况实施监督。三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。本基金在交易所进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金目前暂未开展银行间同业市场业务，无此类信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部债券信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于2023年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。  
(2022年12月31日：同)

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，监察稽核部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监察稽核部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持的证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计占基金资产净值的比例为3.35%（2022年12月31日：3.52%）。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2023年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 年<br>06 月 30<br>日 | 1 个月以内        | 1-3 个月 | 3 个月-1 年      | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
|-------------------------------|---------------|--------|---------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 资产                            |               |        |               |       |       |                  |                  |
| 银行存款                          | 9,032,552.11  | -      | -             | -     | -     | -                | 9,032,552.11     |
| 结算备付金                         | 2,026,072.68  | -      | -             | -     | -     | -                | 2,026,072.68     |
| 交易性金融资产                       | 23,334,325.81 | -      | 74,721,661.59 | -     | -     | 1,559,529,644.41 | 1,657,585,631.81 |
| 应收申购款                         | -             | -      | -             | -     | -     | 529,941.89       | 529,941.89       |
| 资产总计                          | 34,392,950.60 | -      | 74,721,661.59 | -     | -     | 1,560,059,586.30 | 1,669,174,198.49 |
| 负债                            |               |        |               |       |       |                  |                  |
| 应付赎回款                         | -             | -      | -             | -     | -     | 705,504.74       | 705,504.74       |
| 应付管理人报酬                       | -             | -      | -             | -     | -     | 2,063,977.24     | 2,063,977.24     |
| 应付托管费                         | -             | -      | -             | -     | -     | 343,996.22       | 343,996.22       |
| 应付销售服务费                       | -             | -      | -             | -     | -     | 174,250.35       | 174,250.35       |
| 其他负债                          | -             | -      | -             | -     | -     | 104,623.43       | 104,623.43       |
| 负债总计                          | -             | -      | -             | -     | -     | 3,392,351.98     | 3,392,351.98     |

|                             |               |       |                |      |      |                  |                  |
|-----------------------------|---------------|-------|----------------|------|------|------------------|------------------|
| 利率敏感度缺口                     | 34,392,950.60 | -     | 74,721,661.59  | -    | -    | 1,556,667,234.32 | 1,665,781,846.51 |
| 上年度末<br>2022年<br>12月31<br>日 | 1个月以内         | 1-3个月 | 3个月-1年         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息              | 合计               |
| 资产                          |               |       |                |      |      |                  |                  |
| 银行存款                        | 26,028,122.48 | -     | -              | -    | -    | -                | 26,028,122.48    |
| 结算备付金                       | 2,010,883.84  | -     | -              | -    | -    | -                | 2,010,883.84     |
| 交易性金融资产                     | 11,528,368.36 | -     | 100,753,316.44 | -    | -    | 1,899,263,033.38 | 2,011,544,718.18 |
| 应收申购款                       | -             | -     | -              | -    | -    | 507,738.32       | 507,738.32       |
| 资产总计                        | 39,567,374.68 | -     | 100,753,316.44 | -    | -    | 1,899,770,771.70 | 2,040,091,462.82 |
| 负债                          |               |       |                |      |      |                  |                  |
| 卖出回购金融资产款                   | 23,993,414.24 | -     | -              | -    | -    | -                | 23,993,414.24    |
| 应付赎回款                       | -             | -     | -              | -    | -    | 1,213,689.80     | 1,213,689.80     |
| 应付管理人报酬                     | -             | -     | -              | -    | -    | 2,551,967.68     | 2,551,967.68     |
| 应付托管费                       | -             | -     | -              | -    | -    | 425,327.94       | 425,327.94       |
| 应付销售服务费                     | -             | -     | -              | -    | -    | 202,398.45       | 202,398.45       |
| 其他负债                        | -             | -     | -              | -    | -    | 210,599.71       | 210,599.71       |
| 负债总计                        | 23,993,414.24 | -     | -              | -    | -    | 4,603,983.58     | 28,597,397.82    |
| 利率敏感度缺口                     | 15,573,960.44 | -     | 100,753,316.44 | -    | -    | 1,895,166,788.12 | 2,011,494,065.00 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为5.89%(2022年12月31日：5.58%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022年12月31日：同)。



#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的60%-95%；其中投资于基金合同界定的产业先锋相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2023年06月30日 |                          | 上年度末<br>2022年12月31日 |                          |
|--------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|              | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 1,559,529,644.41   | 93.62                    | 1,899,263,033.38    | 94.42                    |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—贵金属投 | -                  | -                        | -                   | -                        |

|        |                  |       |                  |       |
|--------|------------------|-------|------------------|-------|
| 资      |                  |       |                  |       |
| 衍生金融资产 |                  |       |                  |       |
| —权证投资  | -                | -     | -                | -     |
| 其他     | -                | -     | -                | -     |
| 合计     | 1,559,529,644.41 | 93.62 | 1,899,263,033.38 | 94.42 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|----|-----------------------|-----------------------------|---------------------|
| 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<br>2023年06月30日          | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|    | 1.沪深300指数上升5%         | 76,026,232.53               | 98,024,854.86       |
|    | 2.沪深300指数下降5%         | -76,026,232.53              | -98,024,854.86      |

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023年06月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 1,503,708,398.73   | 1,828,372,013.15    |
| 第二层次          | 98,539,356.34      | 112,281,684.80      |
| 第三层次          | 55,337,876.74      | 70,891,020.23       |
| 合计            | 1,657,585,631.81   | 2,011,544,718.18    |

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022年12月31日：同）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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     | 1,559,529,644.41 | 93.43        |
|    | 其中：股票    | 1,559,529,644.41 | 93.43        |
| 2  | 基金投资     | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资   | 98,055,987.40    | 5.87         |
|    | 其中：债券    | 98,055,987.40    | 5.87         |
|    | 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      | 11,058,624.79    | 0.66   |
| 8 | 其他各项资产            | 529,941.89       | 0.03   |
| 9 | 合计                | 1,669,174,198.49 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末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              | 1,559,303,898.69 | 93.61        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,447.47        | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 10,516.15        | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 83,928.25        | 0.01         |
| 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  | 50,871.72        | 0.00         |
| 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       | 37,242.13        | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 7,740.00         | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 1,559,529,644.41 | 93.62        |

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

## 7.3 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(元)        | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|-----------|----------------|----------------------|
| 1  | 002371 | 北方华创 | 418,655   | 132,985,760.75 | 7.98                 |
| 2  | 688012 | 中微公司 | 801,467   | 125,389,512.15 | 7.53                 |
| 3  | 688072 | 拓荆科技 | 289,709   | 123,407,342.73 | 7.41                 |
| 4  | 688120 | 华海清科 | 457,862   | 115,404,117.10 | 6.93                 |
| 5  | 300567 | 精测电子 | 1,158,300 | 110,212,245.00 | 6.62                 |
| 6  | 688037 | 芯源微  | 609,323   | 104,163,766.85 | 6.25                 |
| 7  | 300604 | 长川科技 | 1,938,800 | 92,073,612.00  | 5.53                 |
| 8  | 688082 | 盛美上海 | 751,497   | 82,965,268.80  | 4.98                 |
| 9  | 002409 | 雅克科技 | 997,800   | 72,719,664.00  | 4.37                 |
| 10 | 300782 | 卓胜微  | 711,400   | 68,742,582.00  | 4.13                 |
| 11 | 603690 | 至纯科技 | 1,796,520 | 62,590,756.80  | 3.76                 |
| 12 | 300666 | 江丰电子 | 894,888   | 60,816,588.48  | 3.65                 |
| 13 | 002436 | 兴森科技 | 3,531,900 | 54,744,450.00  | 3.29                 |
| 14 | 300820 | 英杰电气 | 655,560   | 54,005,032.80  | 3.24                 |
| 15 | 688126 | 沪硅产业 | 2,409,234 | 50,352,990.60  | 3.02                 |
| 16 | 688200 | 华峰测控 | 314,085   | 48,055,005.00  | 2.88                 |
| 17 | 300260 | 新莱应材 | 1,175,990 | 46,475,124.80  | 2.79                 |
| 18 | 688019 | 安集科技 | 270,792   | 44,634,645.36  | 2.68                 |
| 19 | 300054 | 鼎龙股份 | 1,323,200 | 32,722,736.00  | 1.96                 |
| 20 | 300763 | 锦浪科技 | 266,666   | 26,970,599.24  | 1.62                 |
| 21 | 688063 | 派能科技 | 140,421   | 26,875,175.19  | 1.61                 |
| 22 | 605111 | 新洁能  | 260,910   | 11,354,803.20  | 0.68                 |
| 23 | 000063 | 中兴通讯 | 183,800   | 8,370,252.00   | 0.50                 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 24 | 301325 | 曼恩斯特 | 3,636  | 413,937.80 | 0.02 |
| 25 | 301291 | 明阳电气 | 12,054 | 391,066.98 | 0.02 |
| 26 | 688525 | 佰维存储 | 4,614  | 368,612.46 | 0.02 |
| 27 | 688582 | 芯动联科 | 6,476  | 299,402.44 | 0.02 |
| 28 | 301210 | 金杨股份 | 2,801  | 143,168.37 | 0.01 |
| 29 | 301395 | 仁信新材 | 5,196  | 138,629.28 | 0.01 |
| 30 | 688249 | 晶合集成 | 7,405  | 133,734.30 | 0.01 |
| 31 | 301292 | 海科新源 | 5,824  | 116,421.76 | 0.01 |
| 32 | 688472 | 阿特斯  | 6,261  | 106,687.44 | 0.01 |
| 33 | 301358 | 湖南裕能 | 2,023  | 86,766.47  | 0.01 |
| 34 | 301202 | 朗威股份 | 3,060  | 79,009.20  | 0.00 |
| 35 | 688307 | 中润光学 | 2,455  | 77,897.15  | 0.00 |
| 36 | 688603 | 天承科技 | 1,391  | 76,505.00  | 0.00 |
| 37 | 688469 | 中芯集成 | 13,800 | 74,658.00  | 0.00 |
| 38 | 301260 | 格力博  | 3,121  | 73,749.23  | 0.00 |
| 39 | 301261 | 恒工精密 | 1,973  | 72,803.70  | 0.00 |
| 40 | 688531 | 日联科技 | 346    | 47,045.62  | 0.00 |
| 41 | 688146 | 中船特气 | 1,011  | 38,549.43  | 0.00 |
| 42 | 001286 | 陕西能源 | 3,767  | 35,447.47  | 0.00 |
| 43 | 601061 | 中信金属 | 4,016  | 30,441.28  | 0.00 |
| 44 | 001287 | 中电港  | 1,386  | 29,133.72  | 0.00 |
| 45 | 301246 | 宏源药业 | 931    | 28,591.01  | 0.00 |
| 46 | 301310 | 鑫宏业  | 409    | 26,760.87  | 0.00 |
| 47 | 301303 | 真兰仪表 | 1,058  | 23,614.56  | 0.00 |
| 48 | 301297 | 富乐德  | 1,015  | 22,847.65  | 0.00 |
| 49 | 688552 | 航天南湖 | 956    | 22,466.00  | 0.00 |
| 50 | 688570 | 天玛智控 | 884    | 22,391.72  | 0.00 |
| 51 | 301307 | 美利信  | 687    | 21,887.82  | 0.00 |
| 52 | 688543 | 国科军工 | 410    | 21,750.50  | 0.00 |
| 53 | 301322 | 绿通科技 | 391    | 20,816.84  | 0.00 |
| 54 | 688458 | 美芯晟  | 221    | 20,057.96  | 0.00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 55 | 301262 | 海看股份 | 692   | 17,646.00 | 0.00 |
| 56 | 688623 | 双元科技 | 178   | 15,448.62 | 0.00 |
| 57 | 301332 | 德尔玛  | 1,122 | 15,405.06 | 0.00 |
| 58 | 301408 | 华人健康 | 879   | 14,899.05 | 0.00 |
| 59 | 301397 | 溯联股份 | 362   | 14,552.40 | 0.00 |
| 60 | 688334 | 西高院  | 888   | 14,394.48 | 0.00 |
| 61 | 688593 | 新相微  | 959   | 13,991.81 | 0.00 |
| 62 | 301387 | 光大同创 | 307   | 13,925.52 | 0.00 |
| 63 | 688512 | 慧智微  | 721   | 13,814.36 | 0.00 |
| 64 | 301382 | 蜂助手  | 408   | 13,398.72 | 0.00 |
| 65 | 301320 | 豪江智能 | 642   | 13,238.04 | 0.00 |
| 66 | 688433 | 华曙高科 | 418   | 13,167.00 | 0.00 |
| 67 | 688629 | 华丰科技 | 708   | 13,161.72 | 0.00 |
| 68 | 688620 | 安凯微  | 1,016 | 12,537.44 | 0.00 |
| 69 | 301360 | 荣旗科技 | 134   | 12,408.40 | 0.00 |
| 70 | 688523 | 航天环宇 | 472   | 11,257.20 | 0.00 |
| 71 | 603135 | 中重科技 | 628   | 11,234.92 | 0.00 |
| 72 | 301141 | 中科磁业 | 262   | 11,184.78 | 0.00 |
| 73 | 301225 | 恒勃股份 | 333   | 11,075.58 | 0.00 |
| 74 | 301429 | 森泰股份 | 499   | 10,488.98 | 0.00 |
| 75 | 601065 | 江盐集团 | 875   | 10,360.00 | 0.00 |
| 76 | 688631 | 莱斯信息 | 336   | 10,036.32 | 0.00 |
| 77 | 688479 | 友车科技 | 332   | 9,790.68  | 0.00 |
| 78 | 301232 | 飞沃科技 | 165   | 9,639.30  | 0.00 |
| 79 | 301376 | 致欧科技 | 420   | 9,454.20  | 0.00 |
| 80 | 301355 | 南王科技 | 563   | 9,430.25  | 0.00 |
| 81 | 301357 | 北方长龙 | 190   | 9,194.10  | 0.00 |
| 82 | 301386 | 未来电器 | 378   | 8,992.62  | 0.00 |
| 83 | 301323 | 新莱福  | 228   | 8,974.08  | 0.00 |
| 84 | 688429 | 时创能源 | 346   | 8,833.38  | 0.00 |
| 85 | 301373 | 凌玮科技 | 277   | 8,822.45  | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 86 | 301170 | 锡南科技 | 250 | 8,732.50 | 0.00 |
| 87 | 601133 | 柏诚股份 | 664 | 8,140.64 | 0.00 |
| 88 | 301157 | 华塑科技 | 150 | 7,939.50 | 0.00 |
| 89 | 301203 | 国泰环保 | 225 | 7,740.00 | 0.00 |
| 90 | 300804 | 广康生化 | 226 | 7,451.22 | 0.00 |
| 91 | 001380 | 华纬科技 | 170 | 5,232.60 | 0.00 |
| 92 | 603125 | 常青科技 | 160 | 3,924.80 | 0.00 |
| 93 | 001328 | 登康口腔 | 145 | 3,696.05 | 0.00 |
| 94 | 001360 | 南矿集团 | 177 | 2,631.99 | 0.00 |
| 95 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 96 | 001367 | 海森药业 | 55  | 2,171.40 | 0.00 |
| 97 | 603172 | 万丰股份 | 122 | 1,967.86 | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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  | 002371 | 北方华创 | 118,493,851.47 | 5.89            |
| 2  | 300567 | 精测电子 | 118,334,491.89 | 5.88            |
| 3  | 688012 | 中微公司 | 111,399,888.57 | 5.54            |
| 4  | 688072 | 拓荆科技 | 105,619,040.86 | 5.25            |
| 5  | 688120 | 华海清科 | 103,517,440.86 | 5.15            |
| 6  | 688037 | 芯源微  | 103,507,388.63 | 5.15            |
| 7  | 300604 | 长川科技 | 97,991,440.41  | 4.87            |
| 8  | 688082 | 盛美上海 | 79,965,509.75  | 3.98            |
| 9  | 300782 | 卓胜微  | 71,041,796.39  | 3.53            |
| 10 | 002409 | 雅克科技 | 70,822,823.29  | 3.52            |
| 11 | 688200 | 华峰测控 | 62,871,268.55  | 3.13            |
| 12 | 300666 | 江丰电子 | 62,643,484.82  | 3.11            |
| 13 | 603690 | 至纯科技 | 61,031,944.29  | 3.03            |



|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 14 | 002436 | 兴森科技 | 53,858,066.00 | 2.68 |
| 15 | 300260 | 新莱应材 | 52,227,192.28 | 2.60 |
| 16 | 688126 | 沪硅产业 | 52,192,328.62 | 2.59 |
| 17 | 688019 | 安集科技 | 51,823,183.68 | 2.58 |
| 18 | 600537 | 亿晶光电 | 49,869,912.10 | 2.48 |
| 19 | 300316 | 晶盛机电 | 44,223,181.00 | 2.20 |
| 20 | 002459 | 晶澳科技 | 40,529,539.60 | 2.01 |

注：“买入”包括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。“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 300274 | 阳光电源 | 83,422,304.70 | 4.15            |
| 2  | 600732 | 爱旭股份 | 81,754,893.27 | 4.06            |
| 3  | 688223 | 晶科能源 | 78,384,234.41 | 3.90            |
| 4  | 002459 | 晶澳科技 | 76,434,710.46 | 3.80            |
| 5  | 300014 | 亿纬锂能 | 73,916,345.20 | 3.67            |
| 6  | 300693 | 盛弘股份 | 72,830,830.23 | 3.62            |
| 7  | 688599 | 天合光能 | 63,771,292.56 | 3.17            |
| 8  | 688390 | 固德威  | 63,420,884.91 | 3.15            |
| 9  | 002518 | 科士达  | 62,783,700.00 | 3.12            |
| 10 | 300118 | 东方日升 | 61,797,916.40 | 3.07            |
| 11 | 002056 | 横店东磁 | 61,263,958.01 | 3.05            |
| 12 | 300438 | 鹏辉能源 | 60,119,923.08 | 2.99            |
| 13 | 002335 | 科华数据 | 58,257,203.08 | 2.90            |
| 14 | 688063 | 派能科技 | 56,634,363.03 | 2.82            |
| 15 | 002865 | 钧达股份 | 56,344,971.54 | 2.80            |
| 16 | 300724 | 捷佳伟创 | 53,495,220.94 | 2.66            |
| 17 | 300393 | 中来股份 | 51,512,401.85 | 2.56            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 18 | 300763 | 锦浪科技 | 51,283,282.00 | 2.55 |
| 19 | 605117 | 德业股份 | 51,096,994.47 | 2.54 |
| 20 | 300068 | 南都电源 | 49,992,086.17 | 2.49 |
| 21 | 002837 | 英维克  | 48,576,319.81 | 2.41 |
| 22 | 688303 | 大全能源 | 47,305,468.86 | 2.35 |
| 23 | 000049 | 德赛电池 | 44,686,352.50 | 2.22 |
| 24 | 300316 | 晶盛机电 | 40,655,442.34 | 2.02 |

注：“卖出”包括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。“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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 | 1,901,802,215.64 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,944,575,096.71 |

注：本项“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。

### 7.5 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      | 98,055,987.40 | 5.89         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债(可交换债) | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 98,055,987.40 | 5.89         |

### 7.6 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  | 019694 | 23国债01 | 569,000 | 57,531,387.34 | 3.45         |
| 2  | 019638 | 20国债09 | 228,000 | 23,334,325.81 | 1.40         |
| 3  | 019688 | 22国债23 | 170,000 | 17,190,274.25 | 1.03         |

注：截止至报告期末，本基金仅持有上述债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未参与股指期货投资，报告期末无股指期货持仓。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名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。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.12.3 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 | -          |
| 2 | 应收清算款 | -          |
| 3 | 应收股利  | -          |
| 4 | 应收利息  | -          |
| 5 | 应收申购款 | 529,941.89 |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 529,941.89 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 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情况。

#### 7.12.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 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<br>(户) | 户均持有的基金份<br>额 | 持有人结构         |            |                  |            |
|--------------------------|--------------|---------------|---------------|------------|------------------|------------|
|                          |              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者            |            |
|                          |              |               | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 东方阿<br>尔法产<br>业先锋<br>混合A | 33,589       | 63,071.05     | 19,281,761.61 | 0.91%      | 2,099,211,708.21 | 99.09%     |
| 东方阿<br>尔法产<br>业先锋        | 31,524       | 23,028.53     | 3,107,134.82  | 0.43%      | 722,844,375.98   | 99.57%     |

|     |        |           |               |       |                  |        |
|-----|--------|-----------|---------------|-------|------------------|--------|
| 混合C |        |           |               |       |                  |        |
| 合计  | 65,113 | 43,684.75 | 22,388,896.43 | 0.79% | 2,822,056,084.19 | 99.21% |

注：本基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属不同类别的基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

### 8.2 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<br>(份) | 占基金总份额比例 |
|--------------------------|--------------|---------------|----------|
| 基金管理人所有<br>从业人员持有本<br>基金 | 东方阿尔法产业先锋混合A | 10,945,006.60 | 0.52%    |
|                          | 东方阿尔法产业先锋混合C | 2,637,265.81  | 0.36%    |
|                          | 合计           | 13,582,272.41 | 0.48%    |

注：基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属不同类别基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                   | 份额级别         | 持有基金份额总量的数量区<br>间（万份） |
|--------------------------------------|--------------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、<br>基金投资和部门负<br>责人持有本开放式基金 | 东方阿尔法产业先锋混合A | >100                  |
|                                      | 东方阿尔法产业先锋混合C | >100                  |
|                                      | 合计           | >100                  |
| 本基金基金经理持有本<br>开放式基金                  | 东方阿尔法产业先锋混合A | 50~100                |
|                                      | 东方阿尔法产业先锋混合C | -                     |
|                                      | 合计           | 50~100                |

### 8.4 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<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额总数       | 发起份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份额<br>承诺持有<br>期限        |
|---------------|--------------|----------------------|--------------|----------------------|---------------------------|
| 基金管理人固<br>有资金 | 5,000,225.04 | 0.18%                | 5,000,225.04 | 0.18%                | 自合同生<br>效之日起<br>不少于3<br>年 |

|             |               |       |               |       |               |
|-------------|---------------|-------|---------------|-------|---------------|
| 基金管理人高级管理人员 | 5,001,418.75  | 0.18% | 5,001,418.75  | 0.18% | 自合同生效之日起不少于3年 |
| 基金经理等人员     | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -             |
| 基金管理人股东     | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -             |
| 其他          | 0.00          | 0.00% | 0.00          | 0.00% | -             |
| 合计          | 10,001,643.79 | 0.35% | 10,001,643.79 | 0.35% | -             |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 东方阿尔法产业先锋混合A     | 东方阿尔法产业先锋混合C   |
|----------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2021年07月21日)基金份额总额 | 2,430,634,085.33 | 572,539,680.63 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 2,199,439,375.62 | 694,203,910.49 |
| 本报告期基金总申购份额                | 99,194,457.87    | 218,950,282.99 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 180,140,363.67   | 187,202,682.68 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 2,118,493,469.82 | 725,951,510.80 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内无改聘会计师事务所的事项。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 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 |    |
| 安信证券     | 2      | 939,116,895.70   | 25.00%       | 880,407.00   | 24.92%     | -  |
| 中信建投证券   | 2      | 1,761,056,480.89 | 46.89%       | 1,632,594.73 | 46.37%     | -  |
| 中信证券(山东) | 3      | 1,055,833,839.08 | 28.11%       | 1,014,579.99 | 28.71%     | -  |

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。本报告期内本基金与证券经纪商不存在关联方关系。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
  - 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；
  - 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；
  - 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下T+0估值的时效性要求。
- 3、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定证券经营机构，然后基金管理人、基金托管人和证券经纪商签订证券经纪服务协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称     | 债券交易          |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|----------|---------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|          | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 安信证券     | 7,876,019.72  | 8.24%        | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中信建投证券   | 6,322,737.66  | 6.61%        | -                | -              | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券(山东) | 81,383,201.77 | 85.14%       | 2,793,467,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

注：该表格中的债券成交金额是按全价计算的金额。

### 10.8 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  | 东方阿尔法基金管理有限公司旗下全部基金2022年4季度报告提示性公告 | 证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报    | 2023-01-18 |
| 2  | 东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金2022年第四季度报告   | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-18 |



|    |   |  |            |
|----|---|--|------------|
| 3  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告           | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报、证券日报            | 2023-02-10 |
| 4  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告           | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、证券日报       | 2023-02-14 |
| 5  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告 | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-02-22 |
| 6  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构的公告     | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-02-23 |
| 7  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加华西证券股份有限公司为销售机构的公告     | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-02-24 |
| 8  | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加东北证券股份有限公司为销售机构的公告     | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-03-20 |
| 9  | 东方阿尔法基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告             | 证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报                          | 2023-03-29 |
| 10 | 东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金2022年年度报告              | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站                       | 2023-03-29 |
| 11 | 东方阿尔法基金管理有限公司旗下全部基金2023年1季度报告提示性公告          | 证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报                          | 2023-04-21 |
| 12 | 东方阿尔法产业先锋混合型                                | 基金管理人的官方网站、中                                   | 2023-04-21 |

|    |   |  |            |
|----|---|--|------------|
|    | 发起式证券投资基金2023年第1季度报告                    | 中国证监会基金电子披露网站                                  |            |
| 13 | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加海通证券股份有限公司为销售机构的公告 | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-05-11 |
| 14 | 东方阿尔法基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示            | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-06-08 |
| 15 | 东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加光大证券股份有限公司为销售机构的公告 | 基金管理人的官方网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报 | 2023-06-09 |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准的东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《东方阿尔法产业先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书》（含更新）；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东方阿尔法基金管理有限公司，客户服务电话：400-930-6677（免长途话费）。
- 3、投资者可通过中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund/>）和基金管理人网站（<https://www.dfa66.com>）查阅本报告书。

东方阿尔法基金管理有限公司  
二〇二三年八月二十八日