

# 东方主题精选混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>51</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	61
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11.8 其他重大事件 .....	69
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>73</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	73
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
13.1 备查文件目录 .....	73
13.2 存放地点 .....	73
13.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方主题精选混合型证券投资基金
基金简称	东方主题精选混合
基金主代码	400032
前端交易代码	400032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 23 日
基金管理人	东方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	853,915,660.72 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入扎实的研究，精选投资主题，把握中国经济成长和改革带来的投资机会，力争实现基金的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资的股票资产占基金资产的比例为 40%-95%，在符合相关法律法规规定和基金合同约定的投资比例限制基础上，本基金采用主题投资策略，通过对我国经济发展过程中出现的主题类投资机会进行挖掘，投资于符合当期经济发展目标且具有可持续发展前景的优秀上市公司，在力争实现基金长期稳定增值的基础上，提高基金投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

注：本基金从 2023 年 8 月 28 日起调整基金费率，相关公告已于 2023 年 8 月 25 日在规定媒介上公告。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李景岩	郭明
	联系电话	010-66295888	(010) 66105799
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95588
传真		010-66578700	(010) 66105798
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100073	100140

法定代表人	崔伟	陈四清
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所或办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区南京东路 61 号四层
注册登记机构	东方基金管理股份有限公司	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-269,130,995.39	-1,197,812,481.68	118,229,550.69
本期利润	-206,289,530.23	-1,383,387,226.99	250,679,959.89
加权平均基金份额本期利润	-0.2250	-1.0011	0.6027
本期加权平均净值利润率	-18.13%	-63.57%	30.90%
本期基金份额净值增长率	-17.93%	-38.43%	51.07%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-158,199,218.02	116,605,486.15	1,606,994,556.83
期末可供分配基金份额利润	-0.1853	0.1186	0.9178
期末基金资产净值	909,850,941.46	1,276,428,244.84	3,692,166,702.59
期末基金	1.0655	1.2983	2.1087

份额净值			
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	6.55%	29.83%	110.87%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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

### 3.2 基金净值表现

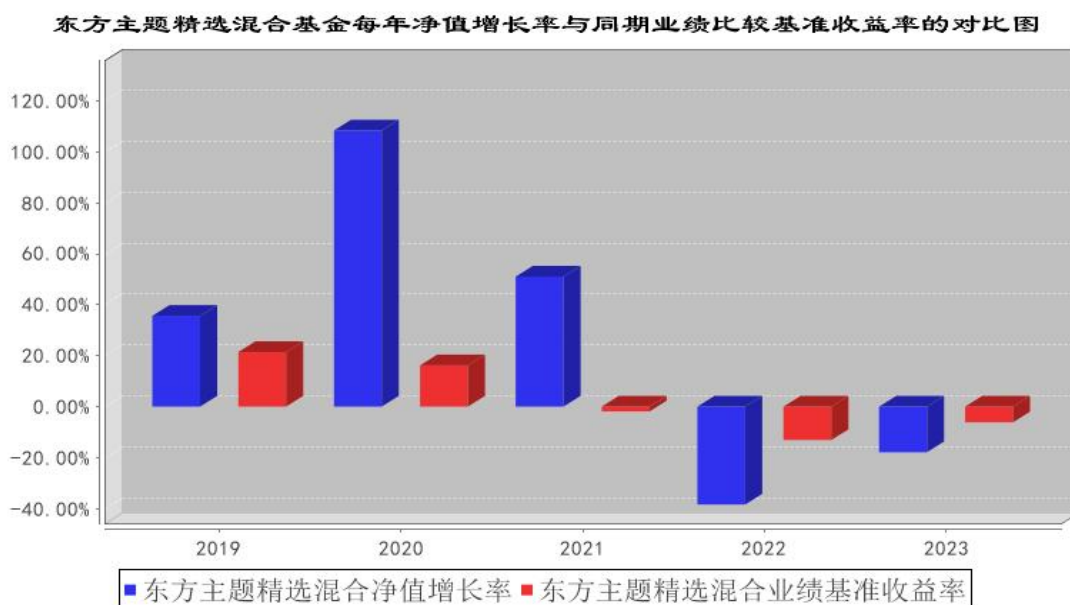
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.47%	1.56%	-3.90%	0.47%	2.43%	1.09%
过去六个月	-18.68%	1.48%	-6.17%	0.50%	-12.51%	0.98%
过去一年	-17.93%	1.49%	-6.17%	0.50%	-11.76%	0.99%
过去三年	-23.66%	1.56%	-20.01%	0.67%	-3.65%	0.89%
过去五年	115.86%	1.60%	12.87%	0.72%	102.99%	0.88%
自基金合同生效起至今	6.55%	1.73%	1.05%	0.83%	5.50%	0.90%

### 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



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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证



监基金字[2004]80号”批复，于2004年6月11日成立。

截至2023年12月31日，本公司注册资本3.3333亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份19200万股，持股比例57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份8100万股，持股比例24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份2700万股，持股比例8.1%；海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持股比例3.37%；海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止2023年12月31日，本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有

期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方中证 500 指数增强型证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周思越	本基金基金经理	2023 年 11 月 13 日	-	14 年	新加坡国立大学经济专业硕士，14 年证券从业经历。曾任长盛基金管理有限公司专户理财部理财经理、东方基金研究部研究员、中信证券股份有限公司资产管理部副总裁（VP）。2017 年 9 月加盟本基金管理人，曾任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理、东方主题精选混合型证券投资基金基金经理。
蒋茜	本基金基金经理、公司总经理助理、权益投资副总监、公募投资决策委员会委员	2019 年 1 月 2 日	2023 年 11 月 13 日	16 年	清华大学工商管理硕士，13 年证券从业经历。曾任 GCW Consulting 高级分析师、中信证券高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司投资总监。2017 年 5 月加盟本基金管理人，曾任研究部总经理、权益投资部总经理、公司总经理助理、权益投资副总监、绝对收益部总经理、公募投资决策委员会委员，东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金经理、东方主题精选混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理、东方创新成长混合型证券投资基金基金经理、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金基金经理、东方匠心优选混合型证券投资基金基金经理。
俞佳莹	本基金基金经理助理	2023 年 04 月 20 日	2023 年 12 月 15 日	7 年	清华大学机械工程专业硕士，7 年证券从业经历。曾任华融证券股份有限公司研究

	理	日	日		员、西部证券股份有限公司研究员。2021年加盟本基金管理人，曾任权益研究部高级研究员。曾任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理助理、东方创新成长混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金基金经理助理、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金基金经理助理。
--	---	---	---	--	---

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），制定了公司公平交易管理制度。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易管理制度的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行T分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A股市场跌宕起伏，上半年AI+和中特估引领主题投资，相关板块赚钱效应显著；但二季度末开始，经济压力开始逐步增加，叠加海外资金流出，市场进入调整，尽管稳经济的政策逐步落地缓解了一定压力，整个下半年主要指数还是呈现震荡下行的走势。报告期内，在经过反复的观察和思考后，本产品年末对之前防守的思路做出了调整，因为市场持续的低迷使得许多行业走势反映了投资者过度悲观的预期，这时往往孕育着较好的反攻机会。而新能源板块特别是光伏行业是潜在利空充分Price in的代表，未来随着业绩层面利空的落地会进一步确认下一阶段边际改善的预期，股价大幅下跌后基本面层面的压制因素已经很低，所以基金经理在年末对光伏板块做了重点配置，以期在市场反弹中抓住阻力相对较小的方向。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023年01月01日起至2023年12月31日，本基金净值增长率为-17.93%，业绩比较基准收益率为-6.17%，低于业绩比较基准11.76%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2024，一方面两会前后稳定经济的政策会密集落地，而随着海外加息周期的结束未来国内宏观调控的政策空间也加大；一方面随着抢占科技制高点与安全至上的国家战略的深入贯彻，

对科技制造领域的支持力度也在加强；同时，针对资本市场的制度性改革也在逐步推进，提升上市公司质量与重视投资者权益双管齐下，预期 2024 整体市场环境将显著改善。而一季度在一系列救市政策的支持下，市场在超跌反弹后将进入阶段性的稳态，是一个较好的观察和布局期。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，开展定期和不定期监察，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过定期检查、专项检查等方式，及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：

(1) 开展对公司各项业务的日常监察，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。(2) 根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强基金投资运作的监察力度，完善了基金投资有关控制制度。(3) 进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

(4) 注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及相关会计核算业务细则，本管理人对所管理的基金各项资产进行核算，本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下：

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），估值委员会委员包括公司总经理、分管运营高级管理人员、分管投研高级管理人员、督察长以及运营部负责人、投研部门指定负责人、合规法务部负责人、风险管理部负责人及总办会其他指定人员。估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

##### 1. 委员会主任

负责召集估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由指定的副主任代理其行使召集职责。

##### 2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法及估值模型而最终确认的具体投资品种公允价值与托管行协商一致后，对相应产品进行估值。

④负责编制相应产品持有的投资品种变更估值方法的相关公告，协调相关部门对外发布公告，并根据公告内容协助相关部门做好客户沟通。

⑤负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

### 3. 投研部门

根据现行法律法规及各产品相关法律文件，适时评估各产品持有投资品种的现有估值政策及估值方法是否公允、适当；对估值方法有失公允性时，投研部门必要时可向运营部提交估值方法调整说明，由运营部提请估值委员会召集估值会议进行审议。

### 4. 合规法务部、风险管理部

在日常合规监控及风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会召集估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末，公司已与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

## 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

# § 5 托管人报告

## 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——东方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对东方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2024]第 ZB30187 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方主题精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东方主题精选混合型证券投资基金（以下简称东方主题精选基金）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了东方主题精选基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东方主题精选基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	东方主题精选基金的基金管理人东方基金管理股份有限公司（以下简称基金管理人）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

	<p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人负责评估东方主题精选基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东方主题精选基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方主题精选基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得</p>



	关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	李永江	高慧丽
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号 4 层	
审计报告日期	2024 年 3 月 21 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方主题精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	12,238,411.03	17,717,054.97
结算备付金		6,374,525.94	6,432,457.59
存出保证金		729,084.93	779,376.23
交易性金融资产	7.4.7.2	903,102,081.95	1,252,334,063.88
其中：股票投资		855,860,211.26	1,185,259,983.26
基金投资		-	-
债券投资		47,241,870.69	67,074,080.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
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		-	9,649,881.40
应收股利		-	-
应收申购款		460,445.37	262,831.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		922,904,549.22	1,287,175,665.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,674,028.72	2,941,866.37
应付赎回款		459,568.09	2,430,171.16
应付管理人报酬		905,766.68	1,663,428.42
应付托管费		150,961.11	277,238.04
应付销售服务费		-	-
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	7.4.7.7	3,863,283.16	3,434,716.80
负债合计		13,053,607.76	10,747,420.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	853,915,660.72	983,158,983.46
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	55,935,280.74	293,269,261.38
净资产合计		909,850,941.46	1,276,428,244.84
负债和净资产总计		922,904,549.22	1,287,175,665.63

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0655 元，基金份额总额 853,915,660.72 份。

## 7.2 利润表

会计主体：东方主题精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-187,212,983.10	-1,344,525,001.92
1. 利息收入		238,143.66	447,094.64
其中：存款利息收入	7.4.7.10	237,636.19	447,094.64
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		507.47	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-250,675,206.10	-1,172,222,586.28
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-262,036,371.68	-1,185,700,132.59

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	1,109,936.28	2,277,524.75
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	10,251,229.30	11,200,021.56
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）	7.4.7.17	62,841,465.16	-185,574,745.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	382,614.18	12,825,235.03
<b>减：二、营业总支出</b>		19,076,547.13	38,862,225.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,173,138.79	33,058,975.35
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,695,523.16	5,509,829.11
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	46,625.38
其中：卖出回购金融资产支出		-	46,625.38
6. 信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.20	207,885.18	246,795.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-206,289,530.23	-1,383,387,226.99
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-206,289,530.23	-1,383,387,226.99
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-206,289,530.23	-1,383,387,226.99

### 7.3 净资产变动表

会计主体：东方主题精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	983,158,983.46	-	293,269,261.38	1,276,428,244.84
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	983,158,983.46	-	293,269,261.38	1,276,428,244.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-129,243,322.74	-	-237,333,980.64	-366,577,303.38
(一)、综合收益总额	-	-	-206,289,530.23	-206,289,530.23
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-129,243,322.74	-	-31,044,450.41	-160,287,773.15
其中：1. 基金申购款	77,501,663.50	-	24,502,864.99	102,004,528.49
2. 基金赎回款	-206,744,986.24	-	-55,547,315.40	-262,292,301.64
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	853,915,660.72	-	55,935,280.74	909,850,941.46
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	1,750,910,839.80	-	1,941,255,862.79	3,692,166,702.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,750,910,839.80	-	1,941,255,862.79	3,692,166,702.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-767,751,856.34	-	-1,647,986,601.41	-2,415,738,457.75
(一)、综合收益总额	-	-	-1,383,387,226.99	-1,383,387,226.99
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-767,751,856.34	-	-264,599,374.42	-1,032,351,230.76
其中：1. 基金申购款	819,638,919.84	-	671,689,642.62	1,491,328,562.46
2. 基金赎回款	-1,587,390,776.18	-	-936,289,017.04	-2,523,679,793.22
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	983,158,983.46	-	293,269,261.38	1,276,428,244.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘鸿鹏

基金管理人负责人

刘鸿鹏

主管会计工作负责人

王丹丹

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东方主题精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2014 年 12 月 15 日中国证监会《关于准予东方主题精选混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2014]1365 号）和《关于东方主题精选混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（机构部函【2015】274 号）的核准，自 2015 年 2 月 16 日至 2015 年 3 月 18 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,099,469,582.75 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2015]第 01300006 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 3 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,099,609,139.25 份基金单位，其中认购资金利息折合 139,556.50 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和中期报告》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1、金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

#### 2、金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交



易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于月末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1、利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 2、投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

### 3、公允价值变动损益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

### 4、信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

## 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 的年费率逐日计提并确认。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率逐日计提并确认。

(3) 卖出回购金融资产利息支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提并确认。

#### (4) 交易费用

进行股票、债券、同业存单及权证等交易过程中产生的交易费用，在发生时按照确定的金额计入交易费用。

#### (5) 其他费用

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、[2008]1号《关于企业所得税

若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

5、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方

教育费附加。

7、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	12,238,411.03	17,717,054.97
等于：本金	12,238,158.80	17,713,797.34
加：应计利息	252.23	3,257.63
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	12,238,411.03	17,717,054.97

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	813,786,959.19	-	855,860,211.26	42,073,252.07	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	46,563,225.66	641,830.69	47,241,870.69	36,814.34
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	46,563,225.66	641,830.69	47,241,870.69	36,814.34
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	860,350,184.85	641,830.69	903,102,081.95	42,110,066.41
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,205,865,722.05	-	1,185,259,983.26	-20,605,738.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,270,922.62	67,074,080.62	-125,659.96
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,270,922.62	67,074,080.62	-125,659.96
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,271,794,540.01	1,270,922.62	1,252,334,063.88	-20,731,398.75

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	475.81	3,967.02
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	3,526,307.35	3,066,249.78

其中：交易所市场	3,526,307.35	3,066,249.78
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	336,500.00	364,500.00
合计	3,863,283.16	3,434,716.80

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	983,158,983.46	983,158,983.46
本期申购	77,501,663.50	77,501,663.50
本期赎回（以“-”号填列）	-206,744,986.24	-206,744,986.24
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	853,915,660.72	853,915,660.72

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	116,605,486.15	176,663,775.23	293,269,261.38
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	116,605,486.15	176,663,775.23	293,269,261.38
本期利润	-269,130,995.39	62,841,465.16	-206,289,530.23
本期基金份额交易产生的变动数	-5,673,708.78	-25,370,741.63	-31,044,450.41
其中：基金申购款	7,597,369.75	16,905,495.24	24,502,864.99
基金赎回款	-13,271,078.53	-42,276,236.87	-55,547,315.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-158,199,218.02	214,134,498.76	55,935,280.74

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日

活期存款利息收入	143,404.65	279,249.03
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	83,241.21	147,936.79
其他	10,990.33	19,908.82
合计	237,636.19	447,094.64

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-262,036,371.68	-1,185,700,132.59
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-262,036,371.68	-1,185,700,132.59

##### 7.4.7.11.2 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1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	8,135,734,631.43	12,257,235,436.57
减：卖出股票成本总额	8,374,930,768.43	13,406,729,258.70
减：交易费用	22,840,234.68	36,206,310.46
买卖股票差价收入	-262,036,371.68	-1,185,700,132.59

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------



	日	日
债券投资收益——利息收入	1,051,192.58	2,549,084.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	58,743.70	-271,559.55
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	1,109,936.28	2,277,524.75

#### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	153,511,924.16	265,241,203.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	150,839,769.30	260,210,829.54
减：应计利息总额	2,613,411.16	5,301,695.82
减：交易费用	-	237.81
买卖债券差价收入	58,743.70	-271,559.55

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	10,251,229.30	11,200,021.56
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	10,251,229.30	11,200,021.56

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	62,841,465.16	-185,574,745.31
股票投资	62,678,990.86	-185,610,313.75
债券投资	162,474.30	35,568.44
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	62,841,465.16	-185,574,745.31

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	369,572.61	12,733,778.72
基金转换费收入	13,041.57	91,456.31
合计	382,614.18	12,825,235.03

#### 7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
----	--	---

审计费用	62,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	7,885.18	18,770.24
账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他费用	-	24.99
合计	207,885.18	246,795.23

注：其他费用为其他银行间交易费用。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
渤海国际信托股份有限公司	本基金管理人股东
河北国控资本管理有限公司	本基金管理人股东
海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	本基金管理人股东
海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	本基金管理人股东
海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）	本基金管理人股东
东方汇智资产管理有限公司	本基金管理人全资子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)

东北证券股份有限公司	-	-	630,481,278.19	2.67
------------	---	---	----------------	------

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	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 成交总额的比 例 (%)
东北证券股 份有限公司	-	-	25,021,000.00	8.75

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
东北证券股份有 限公司	-	-	30,000,000.00	8.93

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东北证券股份有 限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东北证券股份有 限公司	587,151.25	2.69	-	-

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,173,138.79	33,058,975.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,157,833.62	12,169,772.54
应支付基金管理人的净管理费	9,015,305.17	20,889,202.81

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%（2023年8月28日前为1.50%）年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

③本基金于2023年8月28日，将管理费率自1.50%调整至1.20%，详情请见《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同（2023年8月修订）》。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,695,523.16	5,509,829.11

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财

产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

③本基金于 2023 年 8 月 28 日，将托管费率自 0.25%调整至 0.20%，详情请见《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同（2023 年 8 月修订）》。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间,均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间,均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 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 (%)
东方汇智资产管理 有限公司	2,375,160.83	0.28	2,375,160.83	0.24

注：上述关联方投资本基金时按照基金合同、招募说明书及相关公告约定的费率标准收取相应的手续费。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国工商银行股份有限公司	12,238,411.03	143,404.65	17,717,054.97	279,249.03
--------------	---------------	------------	---------------	------------

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

#### 7.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001378	德冠新材	2023 年 10 月 23 日	6 个月	新股流通受限	31.68	36.39	205	6,494.40	7,459.95	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	57.88	45.30	281	16,264.28	12,729.30	-
301251	威尔高	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股流通受限	28.88	34.64	321	9,270.48	11,119.44	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	50.81	198	7,306.20	10,060.38	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	38.13	28.28	1,206	45,984.78	34,105.68	-
301348	蓝箭电子	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	18.08	44.55	613	11,083.04	27,309.15	-
301362	民	2023	6 个月	新股	51.05	38.51	420	21,441.00	16,174.20	-

	爆光电	年7月27日		流通受限						
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股流通受限	13.39	16.00	1,240	16,603.60	19,840.00	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.55	564	31,403.52	21,178.20	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.36	332	9,754.16	19,707.52	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.38	407	15,449.72	12,364.66	-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	47.58	30.21	598	28,452.84	18,065.58	-
301488	豪恩光电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.04	262	10,422.36	18,088.48	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	67.77	128	5,332.48	8,674.56	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	51.90	185	4,970.95	9,601.50	-
301518	长华	2023年7月	6个月	新股流通	25.75	23.00	385	9,913.75	8,855.00	-



	化学	26 日		受限						
301519	舜禹股份	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股流通受限	20.93	20.20	442	9,251.06	8,928.40	-
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	6 个月	新股流通受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	6 个月	新股流通受限	66.80	59.03	136	9,084.80	8,028.08	-
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股流通受限	7.33	13.67	1,458	10,687.14	19,930.86	-
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.10	23.32	182	4,204.20	4,244.24	-
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	15.32	23.86	226	3,462.32	5,392.36	-
603270	金帝股份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603275	众辰科技	2023 年 8 月 16 日	6 个月	新股流通受限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
688602	康鹏科技	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688648	中邮	2023 年 11	6 个月	新股流通	15.18	24.91	303	4,599.54	7,547.73	-

	科技	月6日		受限						
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	18.86	648	6,804.00	12,221.28	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	79.31	101	10,443.40	8,010.31	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.29	226	8,163.12	7,749.54	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.19	549	23,420.34	26,456.31	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.38	267	7,919.22	9,713.46	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风控部门组成的风险管理组织体系，对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金投资于具有良好信用等级的证券，并在法律法规规定和本基金基金合同约定的基础上，进一步进行分散化投资管理。

除通过上述措施控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、短期融资券、超短期融资券及同业存单等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

#### 7.4.13.3 流动性风险

所谓流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支

付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，保持组合必要的流动性和可变现能力，未发生流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和负债不计息，持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	12,238,411.03	-	-	-	12,238,411.03
结算备付金	6,374,525.94	-	-	-	6,374,525.94
存出保证金	729,084.93	-	-	-	729,084.93
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	855,860,211.26	855,860,211.26

交易性金融资产-债券投资	47,241,870.69	-	-	-	47,241,870.69
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	460,445.37	460,445.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	66,583,892.59	-	-	856,320,656.63	922,904,549.22
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	7,674,028.72	7,674,028.72
应付赎回款	-	-	-	459,568.09	459,568.09
应付管理人报酬	-	-	-	905,766.68	905,766.68
应付托管费	-	-	-	150,961.11	150,961.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	3,863,283.16	3,863,283.16
负债总计	-	-	-	13,053,607.76	13,053,607.76
利率敏感度缺口	66,583,892.59	-	-	843,267,048.87	909,850,941.46
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	17,717,054.97	-	-	-	17,717,054.97
结算备付金	6,432,457.59	-	-	-	6,432,457.59
存出保证金	779,376.23	-	-	-	779,376.23
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-1,185,259,983.26	1,185,259,983.26
交易性金融资产-债券投资	67,074,080.62	-	-	-	67,074,080.62
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	9,649,881.40	9,649,881.40

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	262,831.56	262,831.56
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	92,002,969.41	-	-	1,195,172,696.22	1,287,175,665.63
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,941,866.37	2,941,866.37
应付赎回款	-	-	-	2,430,171.16	2,430,171.16
应付管理人报酬	-	-	-	1,663,428.42	1,663,428.42
应付托管费	-	-	-	277,238.04	277,238.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	3,434,716.80	3,434,716.80
负债总计	-	-	-	10,747,420.79	10,747,420.79
利率敏感度缺口	92,002,969.41	-	-	1,184,425,275.43	1,276,428,244.84

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	-38,333.13	-13,152.05
	市场利率下调 0.25%	38,333.13	13,152.05

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金按照基金合同的约定和法律法规的规定进行投资，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	855,860,211.26	94.07	1,185,259,983.26	92.86
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	47,241,870.69	5.19	67,074,080.62	5.25
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	903,102,081.95	99.26	1,252,334,063.88	98.11

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）



沪深 300 指数上涨 5%	74,726,136.08	39,673,319.95
沪深 300 指数下跌 5%	-74,726,136.08	-39,673,319.95

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	855,401,779.95	1,146,975,010.55
第二层次	47,241,870.69	67,074,080.62
第三层次	458,431.31	38,284,972.71
合计	903,102,081.95	1,252,334,063.88

###### 7.4.14.2.2 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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	38,284,972.71	38,284,972.71
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,263,315.06	1,263,315.06
转出第三层次	-	34,669,871.94	34,669,871.94
当期利得或损失总额	-	-4,419,984.52	-4,419,984.52
其中：计入损益的利得或损失	-	-4,419,984.52	-4,419,984.52
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	458,431.31	458,431.31
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	24,197.78	24,197.78
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,273,506.45	2,273,506.45
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	67,084,301.40	67,084,301.40
转出第三层次	-	32,533,291.52	32,533,291.52
当期利得或损失总额	-	1,460,456.38	1,460,456.38
其中：计入损益的利得或损失	-	1,460,456.38	1,460,456.38
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	38,284,972.71	38,284,972.71
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	5,804,569.39	5,804,569.39

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	458,431.31	平均价格 亚式期权模型	预期年化波动率	14.76%-81.42%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	38,284,972.71	平均价格 亚式期权模型	预期年化波动率	21.11%-85.20%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	855,860,211.26	92.74
	其中：股票	855,860,211.26	92.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	47,241,870.69	5.12
	其中：债券	47,241,870.69	5.12
	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	18,612,936.97	2.02
8	其他各项资产	1,189,530.30	0.13
9	合计	922,904,549.22	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	658,815,767.26	72.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	39,770.86	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,466.62	0.00
J	金融业	196,961,278.12	21.65
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,928.40	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	855,860,211.26	94.07

### 8.2.2 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通过港股通投资的股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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）	占基金资产净值比例（%）
1	688556	高测股份	1,458,883	56,881,848.17	6.25
2	301266	宇邦新材	997,002	55,204,000.74	6.07
3	001269	欧晶科技	918,880	49,114,136.00	5.40
4	688390	固德威	375,000	48,967,500.00	5.38
5	300763	锦浪科技	652,000	45,574,800.00	5.01

6	688032	禾迈股份	168,725	45,555,750.00	5.01
7	688063	派能科技	428,800	45,452,800.00	5.00
8	300274	阳光电源	516,904	45,275,621.36	4.98
9	600030	中信证券	2,222,200	45,266,214.00	4.98
10	688503	聚和材料	827,707	44,365,095.20	4.88
11	688348	昱能科技	352,229	43,105,785.02	4.74
12	300724	捷佳伟创	522,200	38,648,022.00	4.25
13	601995	中金公司	888,800	33,818,840.00	3.72
14	605117	德业股份	388,821	32,622,081.90	3.59
15	300059	东方财富	2,222,228	31,200,081.12	3.43
16	300033	同花顺	166,600	26,134,542.00	2.87
17	002518	科士达	888,800	24,530,880.00	2.70
18	601865	福莱特	888,800	23,730,960.00	2.61
19	300827	上能电气	700,029	21,182,877.54	2.33
20	688598	金博股份	300,001	20,970,069.90	2.30
21	600109	国金证券	2,222,200	20,177,576.00	2.22
22	600519	贵州茅台	9,999	17,258,274.00	1.90
23	601066	中信建投	666,600	15,771,756.00	1.73
24	601688	华泰证券	1,111,100	15,499,845.00	1.70
25	600999	招商证券	666,600	9,092,424.00	1.00
26	301291	明阳电气	1,206	34,105.68	0.00
27	301348	蓝箭电子	613	27,309.15	0.00
28	688702	盛科通信	549	26,456.31	0.00
29	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
30	301371	敷尔佳	564	21,178.20	0.00
31	301558	三态股份	1,458	19,930.86	0.00
32	301370	国科恒泰	1,240	19,840.00	0.00
33	301421	波长光电	332	19,707.52	0.00
34	301488	豪恩汽电	262	18,088.48	0.00
35	301468	博盈特焊	598	18,065.58	0.00
36	301362	民爆光电	420	16,174.20	0.00
37	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
38	301210	金杨股份	281	12,729.30	0.00
39	301456	盘古智能	407	12,364.66	0.00
40	688653	康希通信	648	12,221.28	0.00
41	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
42	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
43	301251	威尔高	321	11,119.44	0.00
44	301261	恒工精密	198	10,060.38	0.00
45	688716	中研股份	267	9,713.46	0.00
46	301517	陕西华达	185	9,601.50	0.00
47	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
48	301519	舜禹股份	442	8,928.40	0.00

49	301518	长华化学	385	8,855.00	0.00
50	301489	思泉新材	128	8,674.56	0.00
51	301548	崇德科技	136	8,028.08	0.00
52	688657	浩辰软件	101	8,010.31	0.00
53	688671	碧兴物联	226	7,749.54	0.00
54	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
55	688648	中邮科技	303	7,547.73	0.00
56	001378	德冠新材	205	7,459.95	0.00
57	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
58	603119	浙江荣泰	226	5,392.36	0.00
59	603075	热威股份	182	4,244.24	0.00
60	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300002	神州泰岳	104,653,105.68	8.20
2	600529	山东药玻	101,622,992.27	7.96
3	000625	长安汽车	99,608,403.68	7.80
4	300418	昆仑万维	96,480,423.44	7.56
5	600435	北方导航	92,223,724.67	7.23
6	002517	恺英网络	90,119,143.57	7.06
7	300033	同花顺	89,337,823.00	7.00
8	002555	三七互娱	85,931,455.69	6.73
9	600030	中信证券	85,793,493.22	6.72
10	300059	东方财富	85,666,182.31	6.71
11	002230	科大讯飞	80,856,309.00	6.33
12	300058	蓝色光标	77,757,937.02	6.09
13	002558	巨人网络	75,951,106.90	5.95
14	601689	拓普集团	66,173,163.62	5.18
15	300558	贝达药业	66,085,368.80	5.18
16	002156	通富微电	64,665,649.99	5.07
17	601360	三六零	63,059,425.10	4.94
18	603444	吉比特	59,237,517.20	4.64
19	002605	姚记科技	57,598,254.12	4.51
20	002123	梦网科技	57,201,451.81	4.48
21	002624	完美世界	55,477,098.45	4.35
22	002607	中公教育	54,328,375.67	4.26
23	603222	济民医疗	54,251,393.07	4.25
24	002415	海康威视	53,775,924.53	4.21
25	600988	赤峰黄金	53,190,886.12	4.17
26	688556	高测股份	53,094,916.24	4.16

27	688282	理工导航	52,692,566.22	4.13
28	688416	恒烁股份	51,969,139.41	4.07
29	301026	浩通科技	51,641,691.43	4.05
30	300413	芒果超媒	51,284,861.70	4.02
31	002368	太极股份	50,582,974.00	3.96
32	002878	元隆雅图	50,499,710.00	3.96
33	300770	新媒股份	50,438,830.69	3.95
34	601456	国联证券	49,747,941.49	3.90
35	002648	卫星化学	49,337,314.59	3.87
36	300475	香农芯创	49,314,557.00	3.86
37	001309	德明利	48,698,861.80	3.82
38	601688	华泰证券	48,042,992.00	3.76
39	601066	中信建投	47,740,197.00	3.74
40	300451	创业慧康	47,626,494.67	3.73
41	601881	中国银河	47,495,340.30	3.72
42	600999	招商证券	47,006,335.00	3.68
43	688158	优刻得	46,994,959.98	3.68
44	600837	海通证券	46,908,119.00	3.67
45	601995	中金公司	46,850,892.37	3.67
46	300339	润和软件	46,816,945.36	3.67
47	601211	国泰君安	46,657,714.00	3.66
48	301308	江波龙	46,624,147.00	3.65
49	300364	中文在线	46,490,788.17	3.64
50	300846	首都在线	46,264,010.26	3.62
51	002409	雅克科技	45,870,085.00	3.59
52	600584	长电科技	45,854,504.00	3.59
53	002920	德赛西威	45,354,538.22	3.55
54	300474	景嘉微	43,703,739.46	3.42
55	001269	欧晶科技	43,463,874.12	3.41
56	600109	国金证券	43,440,884.00	3.40
57	301266	宇邦新材	43,117,467.88	3.38
58	688348	昱能科技	43,109,953.40	3.38
59	688063	派能科技	42,884,961.70	3.36
60	688503	聚和材料	42,627,803.08	3.34
61	300274	阳光电源	42,405,116.17	3.32
62	002371	北方华创	42,385,137.95	3.32
63	002602	世纪华通	42,160,391.40	3.30
64	300763	锦浪科技	41,951,752.92	3.29
65	601816	京沪高铁	41,514,807.00	3.25
66	688390	固德威	41,468,611.81	3.25
67	603105	芯能科技	40,966,156.00	3.21
68	000829	天音控股	40,581,169.90	3.18
69	603986	兆易创新	40,549,794.00	3.18

70	688032	禾迈股份	39,847,431.75	3.12
71	603893	瑞芯微	39,839,478.00	3.12
72	300494	盛天网络	39,595,436.40	3.10
73	300113	顺网科技	39,135,272.79	3.07
74	300299	富春股份	38,836,930.43	3.04
75	002777	久远银海	38,205,913.59	2.99
76	300212	易华录	37,847,739.59	2.97
77	603496	恒为科技	37,482,278.15	2.94
78	600212	绿能慧充	37,079,060.00	2.90
79	000999	华润三九	37,005,219.44	2.90
80	688143	长盈通	36,608,147.66	2.87
81	000568	泸州老窖	36,354,602.00	2.85
82	688410	山外山	36,286,703.32	2.84
83	002015	协鑫能科	35,375,358.00	2.77
84	600418	江淮汽车	35,355,301.28	2.77
85	002852	道道全	35,325,713.22	2.77
86	300724	捷佳伟创	35,154,014.00	2.75
87	600556	天下秀	35,006,001.00	2.74
88	688582	芯动联科	34,495,457.94	2.70
89	601099	太平洋	34,477,180.00	2.70
90	300766	每日互动	34,313,819.08	2.69
91	002085	万丰奥威	34,280,744.00	2.69
92	600498	烽火通信	34,086,634.90	2.67
93	600566	济川药业	34,005,752.72	2.66
94	000021	深科技	33,418,042.71	2.62
95	300769	德方纳米	33,222,239.18	2.60
96	300458	全志科技	32,864,654.18	2.57
97	000682	东方电子	32,573,943.00	2.55
98	300551	古鳌科技	32,312,579.00	2.53
99	603160	汇顶科技	32,003,137.00	2.51
100	000166	申万宏源	31,842,640.40	2.49
101	300114	中航电测	31,813,898.00	2.49
102	002603	以岭药业	31,493,414.46	2.47
103	600228	返利科技	31,358,511.99	2.46
104	603966	法兰泰克	30,664,734.00	2.40
105	002645	华宏科技	30,659,128.00	2.40
106	301052	果麦文化	30,655,450.00	2.40
107	688122	西部超导	30,479,389.64	2.39
108	002919	名臣健康	30,408,332.00	2.38
109	000100	TCL 科技	30,065,915.00	2.36
110	300223	北京君正	30,056,588.84	2.35
111	688981	中芯国际	29,680,128.21	2.33
112	300803	指南针	29,604,632.48	2.32



113	600262	北方股份	29,546,669.28	2.31
114	605117	德业股份	29,253,417.95	2.29
115	600519	贵州茅台	28,428,281.98	2.23
116	688111	金山办公	28,420,042.24	2.23
117	002424	贵州百灵	28,231,191.50	2.21
118	300203	聚光科技	28,096,272.00	2.20
119	601555	东吴证券	27,934,632.31	2.19
120	688041	海光信息	27,888,203.04	2.18
121	300383	光环新网	27,887,643.00	2.18
122	600958	东方证券	27,811,430.66	2.18
123	002529	海源复材	27,798,875.00	2.18
124	600426	华鲁恒升	27,472,596.31	2.15
125	605168	三人行	27,390,518.00	2.15
126	300672	国科微	27,127,378.38	2.13
127	601377	兴业证券	27,028,178.70	2.12
128	002990	盛视科技	26,871,716.20	2.11
129	002174	游族网络	25,909,033.00	2.03
130	301087	可孚医疗	25,825,454.20	2.02
131	002008	大族激光	25,621,764.32	2.01

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超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	300418	昆仑万维	114,312,355.00	8.96
2	600212	绿能慧充	111,728,451.27	8.75
3	300002	神州泰岳	106,008,563.36	8.31
4	000625	长安汽车	103,808,202.36	8.13
5	002368	太极股份	92,772,692.05	7.27
6	600435	北方导航	92,556,417.90	7.25
7	002517	恺英网络	88,302,735.42	6.92
8	600529	山东药玻	87,942,468.34	6.89
9	002558	巨人网络	83,338,118.90	6.53
10	002230	科大讯飞	82,625,545.32	6.47
11	002605	姚记科技	76,256,271.13	5.97
12	300058	蓝色光标	75,185,774.14	5.89
13	603105	芯能科技	73,724,919.72	5.78
14	002555	三七互娱	70,729,216.06	5.54
15	688111	金山办公	69,833,980.14	5.47
16	002156	通富微电	66,992,260.25	5.25
17	601689	拓普集团	65,284,090.12	5.11

18	001269	欧晶科技	64,939,992.54	5.09
19	002777	久远银海	63,349,427.70	4.96
20	603613	国联股份	62,982,969.30	4.93
21	300558	贝达药业	62,563,837.29	4.90
22	001309	德明利	60,651,821.00	4.75
23	002865	钧达股份	59,833,158.34	4.69
24	688282	理工导航	58,670,247.29	4.60
25	300033	同花顺	58,646,931.00	4.59
26	688410	山外山	57,736,924.90	4.52
27	688416	恒烁股份	55,104,618.42	4.32
28	688143	长盈通	54,819,125.15	4.29
29	301308	江波龙	54,511,319.03	4.27
30	601360	三六零	53,180,441.26	4.17
31	002624	完美世界	51,659,675.30	4.05
32	300475	香农芯创	51,030,414.00	4.00
33	300413	芒果超媒	50,715,969.36	3.97
34	002415	海康威视	50,310,516.62	3.94
35	002311	海大集团	50,054,790.32	3.92
36	002607	中公教育	49,450,686.73	3.87
37	600584	长电科技	48,774,953.00	3.82
38	601369	陕鼓动力	47,477,468.48	3.72
39	300474	景嘉微	47,253,827.95	3.70
40	600988	赤峰黄金	46,898,875.34	3.67
41	002123	梦网科技	46,808,939.10	3.67
42	300059	东方财富	46,526,260.94	3.65
43	002878	元隆雅图	45,486,770.05	3.56
44	601211	国泰君安	45,216,809.00	3.54
45	688121	卓然股份	44,927,500.27	3.52
46	000999	华润三九	44,610,052.28	3.49
47	601816	京沪高铁	44,550,101.00	3.49
48	603222	济民医疗	43,737,164.75	3.43
49	600837	海通证券	43,623,575.30	3.42
50	300770	新媒股份	43,330,318.66	3.39
51	601456	国联证券	43,329,298.85	3.39
52	300451	创业慧康	43,191,130.80	3.38
53	601881	中国银河	42,554,276.69	3.33
54	002409	雅克科技	42,144,031.00	3.30
55	603444	吉比特	41,881,019.80	3.28
56	603496	恒为科技	41,818,135.00	3.28
57	301026	浩通科技	40,776,031.90	3.19
58	002920	德赛西威	40,622,520.52	3.18
59	300339	润和软件	39,939,440.74	3.13
60	002648	卫星化学	39,892,294.91	3.13

61	000829	天音控股	39,833,077.40	3.12
62	688033	天宜上佳	39,644,609.53	3.11
63	002371	北方华创	39,632,225.31	3.10
64	300212	易华录	39,451,084.00	3.09
65	300458	全志科技	39,288,223.20	3.08
66	002602	世纪华通	39,023,941.00	3.06
67	002085	万丰奥威	38,808,230.00	3.04
68	300494	盛天网络	38,539,622.20	3.02
69	300364	中文在线	38,514,732.00	3.02
70	603986	兆易创新	38,371,213.49	3.01
71	688665	四方光电	36,434,081.61	2.85
72	300113	顺网科技	36,117,040.80	2.83
73	300846	首都在线	35,864,587.00	2.81
74	600999	招商证券	35,255,887.00	2.76
75	688582	芯动联科	34,525,827.25	2.70
76	002852	道道全	34,373,930.22	2.69
77	600498	烽火通信	33,719,942.24	2.64
78	600566	济川药业	33,656,895.40	2.64
79	600353	旭光电子	33,496,370.67	2.62
80	600556	天下秀	32,917,647.00	2.58
81	600418	江淮汽车	32,884,900.90	2.58
82	300766	每日互动	32,804,701.44	2.57
83	301099	雅创电子	32,590,742.44	2.55
84	600030	中信证券	32,326,017.20	2.53
85	688687	凯因科技	32,207,109.42	2.52
86	688158	优刻得	32,081,951.72	2.51
87	603893	瑞芯微	31,909,031.20	2.50
88	603160	汇顶科技	31,788,377.00	2.49
89	300551	古鳌科技	31,743,916.00	2.49
90	000682	东方电子	31,452,737.93	2.46
91	601099	太平洋	31,379,987.94	2.46
92	300114	中航电测	30,819,306.16	2.41
93	000166	申万宏源	30,707,009.20	2.41
94	300181	佐力药业	30,705,393.52	2.41
95	603979	金诚信	30,700,995.36	2.41
96	002015	协鑫能科	30,273,840.50	2.37
97	002603	以岭药业	30,214,414.00	2.37
98	300299	富春股份	30,018,634.12	2.35
99	600426	华鲁恒升	29,866,095.00	2.34
100	603966	法兰泰克	29,707,193.20	2.33
101	300271	华宇软件	29,589,207.00	2.32
102	000100	TCL 科技	29,516,319.00	2.31
103	000021	深科技	29,402,376.16	2.30

104	600262	北方股份	29,251,729.00	2.29
105	603308	应流股份	29,172,084.40	2.29
106	603416	信捷电气	28,977,321.00	2.27
107	688122	西部超导	28,920,921.51	2.27
108	000568	泸州老窖	28,857,563.90	2.26
109	600703	三安光电	28,806,491.32	2.26
110	300769	德方纳米	28,756,221.20	2.25
111	688981	中芯国际	28,746,282.81	2.25
112	300566	激智科技	28,435,203.60	2.23
113	601886	江河集团	28,342,782.00	2.22
114	301266	宇邦新材	28,083,634.00	2.20
115	300803	指南针	28,017,239.00	2.19
116	601066	中信建投	27,430,342.00	2.15
117	300751	迈为股份	27,276,851.56	2.14
118	300598	诚迈科技	27,145,864.05	2.13
119	601688	华泰证券	27,108,926.00	2.12
120	603000	人民网	26,974,201.25	2.11
121	002990	盛视科技	26,893,892.52	2.11
122	688041	海光信息	26,770,395.34	2.10
123	002424	贵州百灵	26,541,063.75	2.08
124	301052	果麦文化	26,521,681.63	2.08
125	300031	宝通科技	26,027,538.67	2.04
126	601555	东吴证券	25,812,262.50	2.02
127	600958	东方证券	25,799,806.16	2.02
128	002529	海源复材	25,764,448.00	2.02
129	603212	赛伍技术	25,670,610.00	2.01
130	603896	寿仙谷	25,536,224.75	2.00

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,982,852,005.57
卖出股票收入（成交）总额	8,135,734,631.43

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，

卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	47,241,870.69	5.19
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	47,241,870.69	5.19

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019703	23 国债 10	444,000	45,030,358.36	4.95
2	019709	23 国债 16	22,000	2,211,512.33	0.24

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金所持有的中信证券（600030）公司因未依法履行职责以及未及时披露重大事项等违规行为多次被中国证监会、深圳证监局、上海证券交易所出具监管函、警示函并约见谈话，上述处罚不

会对正常经营造成影响。

本基金所持有的聚合材料（688503）公司因未依法履行职责被上海证券交易所下发监管工作函，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有的派能科技（688063）因参股公司未依法履行其他职责被中国证监会上海监管局出具警示函，上述处罚不会对正常经营造成影响。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

（1）研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

（2）投资决策委员会定期召开会议，讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

（3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

（4）交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

（5）投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资中信证券主要基于以下原因：看好公司凭借全面领先的业务能力在行业中的竞争优势，风控指标优化措施有望为公司进一步扩表和 ROE 提升打开空间。

本基金投资聚合材料主要基于以下原因：经过多年发展，公司已经构筑了品类丰富、迭代迅速的产品体系，能够满足市场主流的各种高效太阳能电池对正面银浆产品的需求。除正面银浆外，公司也在积极开发其他非光伏领域用电子浆料和胶粘剂，覆盖射频、片式元器件、电致变色玻璃、LTCC、光伏、动力储能、消费电子等领域。

本基金投资派能科技主要基于以下原因：公司作为户储赛道龙头，随海外库存逐步消化完毕，2024 年需求有望逐步回暖。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

## 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	729,084.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	460,445.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,189,530.30

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
51,638	16,536.58	76,142,814.21	8.92	777,772,846.51	91.08

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,358,249.16	0.16

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 3 月 23 日) 基金份额总额	1,099,609,139.25
----------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	983,158,983.46
本报告期基金总申购份额	77,501,663.50
减：本报告期基金总赎回份额	206,744,986.24
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	853,915,660.72

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，无涉及基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 62,000.00 元；截至 2023 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供 9 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

#### 11.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	



			(%)		(%)	
国海证券股份有限公司	2	3,354,592,634.48	20.83	3,134,755.94	21.20	-
首创证券股份有限公司	2	2,556,906,864.18	15.88	2,394,912.95	16.20	-
华安证券股份有限公司	2	1,899,605,978.27	11.80	1,777,857.08	12.03	-
东兴证券股份有限公司	1	1,484,396,715.51	9.22	1,389,373.56	9.40	-
招商证券股份有限公司	1	1,402,001,309.50	8.71	1,317,748.79	8.91	-
天风证券股份有限公司	2	1,042,005,954.90	6.47	975,468.47	6.60	-
国泰君安证券股份有限公司	2	961,652,062.87	5.97	900,771.49	6.09	-
浙商证券股份有限公司	2	894,050,879.53	5.55	836,782.15	5.66	-
恒泰证券股份有限公司	2	814,559,226.21	5.06	758,597.37	5.13	-
华鑫证券有限责任公司	2	456,268,946.34	2.83	198,435.22	1.34	-
信达证券股份有限公司	2	404,639,888.65	2.51	376,844.29	2.55	-
财通证券股份有限公司	2	377,950,187.72	2.35	357,504.40	2.42	-
中国国际金融股份有限公司	1	297,522,498.31	1.85	217,578.92	1.47	-
长江证券股份有限公司	2	158,137,639.56	0.98	147,273.20	1.00	-

国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

（3）本报告期内，本基金新增国泰君安证券股份有限公司和财通证券股份有限公司上海、深圳交易席位各一个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国海证券股份有限公司	3,990,160.00	2.33	-	-	-	-
首创证券股份有限公司	15,896,430.00	9.28	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	2,596,048.00	1.52	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	52,864,295.00	30.87	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	80,011,614.00	46.72	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	2,698,893.00	1.58	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	6,898,892.00	4.03	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	6,296,358.00	3.68	-	-	-	-
华鑫证	-	-	-	-	-	-

券有限 责任公 司						
信达证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
财通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国投证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
------	--	--	--	--	--	--

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方主题精选混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 19 日
2	关于增加和合期货有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 10 日
3	关于增加平安银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 24 日
4	关于增加泛华普益基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 2 日
5	关于增加深圳新华信通基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 9 日
6	关于增加渤海证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 28 日
7	东方主题精选混合型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 29 日
8	东方主题精选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 22 日
9	东方主题精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 5 日
10	东方主题精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 1 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 5 日

11	关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司行 E 通平台费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
12	关于增加华西证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
13	关于增加平安银行股份有限公司行 E 通平台为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
14	关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 30 日
15	关于增加杭州银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 13 日
16	东方主题精选混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 21 日
17	关于增加九州证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 1 日
18	关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 1 日
19	关于增加海通证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 19 日
20	关于增加宁波银行股份有限公司为公	证券时报、证券日报、	2023 年 8 月 24 日

	司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
21	关于增加海通证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 24 日
22	东方主题精选混合型证券投资基金托管协议（2023 年 8 月修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
23	东方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
24	东方主题精选混合型证券投资基金基金合同（2023 年 8 月修订）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 25 日
25	东方主题精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 2 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
26	关于增加国金证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
27	东方主题精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
28	东方主题精选混合型证券投资基金 2023 年中期报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 31 日
29	东方基金管理股份有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 1 日
30	关于增加甬兴证券有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 14 日

31	关于增加麦高证券有限责任公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 19 日
32	关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司邮你同赢平台为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 24 日
33	东方主题精选混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 25 日
34	关于增加长江证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 30 日
35	东方基金管理股份有限公司关于恢复乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 3 日
36	东方主题精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 11 日
37	东方主题精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 14 日
38	东方主题精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 3 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 14 日
39	关于增加德邦证券股份有限公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 16 日
40	东方基金管理股份有限公司关于公司旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司转换费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 16 日
41	关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司申购费率	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券	2023 年 11 月 24 日



	优惠活动的公告	报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
42	关于旗下部分基金参与东兴证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 11 月 28 日
43	关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 12 月 12 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 一、《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方主题精选混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）查阅。

东方基金管理股份有限公司

2024 年 3 月 30 日