

东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资
基金
2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本基金于 2022 年 12 月 5 日新增 C 类份额，本报告中本基金 C 类份额的“基金合同生效日”特指 2022 年 12 月 5 日。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红京东大数据混合
基金主代码	001564
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 31 日
报告期末基金份额总额	811,928,984.25 份
投资目标	本基金根据公司大数据分析模型，进行行业配置和个股选择，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金是一只灵活配置的混合型基金，采取主动管理的投资模式。在投资策略上，管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，然后充分利用公司大数据研究平台的优势，通过对京东大数据（包括京东电商的销量、浏览量、点击量、客户评价、客户收藏量等基础数据）的分析研究，挖掘不同行业的敏感

	因子，提取合成不同行业的观察指标，结合管理人的线下研究进行行业配置和个券选择，构建合理的投资组合。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。	
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方红京东大数据混合 A	东方红京东大数据混合 C
下属分级基金的交易代码	001564	017535
报告期末下属分级基金的份额总额	563,224,097.62 份	248,704,886.63 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	东方红京东大数据混合 A	东方红京东大数据混合 C
1. 本期已实现收益	17,374,325.78	7,011,616.38
2. 本期利润	43,869,128.46	19,707,711.47
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0777	0.0773
4. 期末基金资产净值	1,382,884,761.86	605,808,384.86
5. 期末基金份额净值	2.455	2.436

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红京东大数据混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

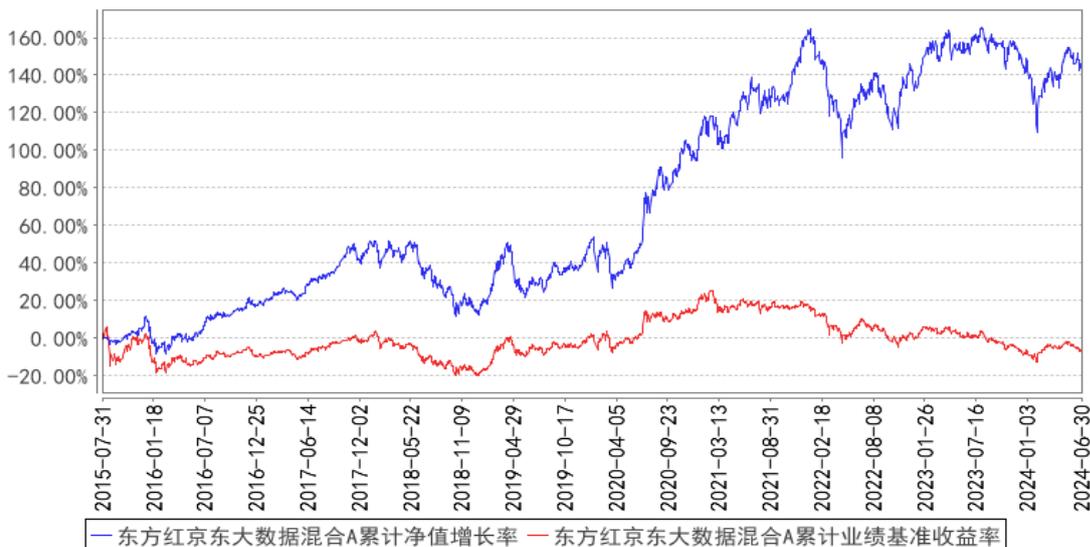
		标准差②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	3.28%	0.92%	-1.97%	0.57%	5.25%	0.35%
过去六个月	-1.41%	1.16%	-0.44%	0.71%	-0.97%	0.45%
过去一年	-4.92%	0.95%	-7.49%	0.65%	2.57%	0.30%
过去三年	3.06%	1.00%	-21.92%	0.72%	24.98%	0.28%
过去五年	90.90%	1.10%	-1.45%	0.79%	92.35%	0.31%
自基金合同 生效起至今	145.50%	1.08%	-6.76%	0.89%	152.26%	0.19%

东方红京东大数据混合 C

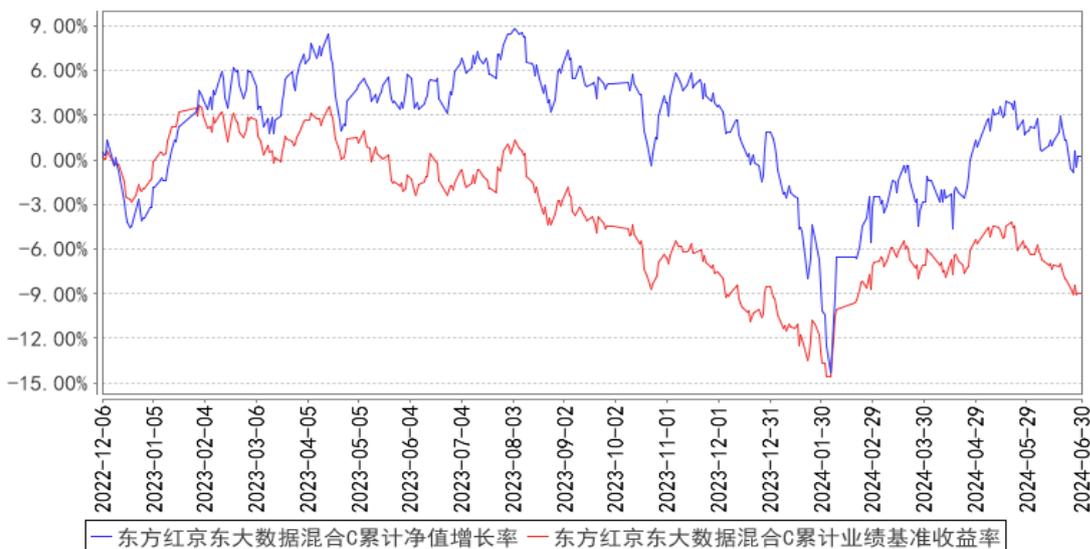
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.18%	0.92%	-1.97%	0.57%	5.15%	0.35%
过去六个月	-1.62%	1.17%	-0.44%	0.71%	-1.18%	0.46%
过去一年	-5.40%	0.95%	-7.49%	0.65%	2.09%	0.30%
自基金合同 生效起至今	0.25%	0.89%	-8.94%	0.61%	9.19%	0.28%

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

东方红京东大数据混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红京东大数据混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周云	上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资一部总经理	2015年9月14日	-	15年	上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资一部总经理、基金经理，2015年09月至今任东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2015年09月至今任东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2016年06

	理、基金经理			<p>月至 2018 年 08 月任东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017 年 04 月至 2019 年 11 月任东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2018 年 01 月至 2019 年 11 月任东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2022 年 05 月至今任东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2022 年 07 月至今任东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2023 年 05 月至今任东方红智华三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2023 年 08 月至今任东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2024 年 02 月至今任东方红智享三年持有期混合型证券投资基金基金经理。清华大学生物学博士。曾任东方证券资产管理业务总部研究员，上海东方证券资产管理有限公司行业研究员、投资主办人。具备证券投资基金从业资格。</p>
--	--------	--	--	---

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流

程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，A 股市场在经历了 2、3 月份的快速反弹之后，整体维持在 3000 点左右横盘震荡的格局。整个季度，各类指数均有所下跌，其中上证 50 指数下跌 0.83%，沪深 300 指数下跌 2.14%，中证 500 指数下跌 6.50%，创业板指下跌 7.41%，中证 1000 指数下跌 10.02%。风格方面，依然维持大盘优于小盘，红利优于成长的局面。行业层面，各板块表现分化严重，公用事业、银行、煤炭、电子、交运表现较好，传媒、商贸零售、社服、计算机、食品饮料等板块跌幅较大。本产品风格和行业配置相对均衡。

经济方面，上半年，海外补库周期开启，带动出口超预期增长；内需政策定调更加积极，但是受房地产影响，表现相对低迷。展望下半年，受地缘政治影响，外部不确定性加大，在此背景下，国内的财政和货币政策依然有足够的发力空间，下半年很可能内需的边际变化优于外需的边际变化。市场方面，经过年初的压力测试，市场低点很可能已经探明，资本市场改革和政策支持为市场创造了更为友好的投资环境，市场下跌空间大概率是有限的。综上，我会结合自上而下的宏观判断和自下而上的公司分析，构建一个稳健均衡的组合，努力为持有人创造更多收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 2.455 元，份额累计净值为 2.455 元；C 类份额净值为 2.436 元，份额累计净值为 2.436 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 3.28%，同期业绩比较基准收益率为-1.97%；C 类份额净值增长率为 3.18%，同期业绩比较基准收益率为-1.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,448,291,653.28	66.00
	其中：股票	1,448,291,653.28	66.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	143,929,752.39	6.56
	其中：债券	143,929,752.39	6.56
	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	179,796,000.00	8.19
	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	421,506,294.24	19.21
8	其他资产	900,861.15	0.04
9	合计	2,194,424,561.06	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	9,591,008.00	0.48
C	制造业	1,012,256,566.79	50.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	97,296,195.00	4.89
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	62,966,484.00	3.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	129,754,898.38	6.52
J	金融业	64,625,038.60	3.25
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,608,010.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	7,454,654.46	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	52,630,831.05	2.65
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	8,107,967.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	1,448,291,653.28	72.83

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600820	隧道股份	14,297,900	93,365,287.00	4.69
2	002475	立讯精密	2,066,785	81,245,318.35	4.09
3	600585	海螺水泥	2,929,106	69,097,610.54	3.47
4	605376	博迁新材	3,020,000	68,161,400.00	3.43
5	300037	新宙邦	2,216,700	63,308,952.00	3.18
6	601333	广深铁路	19,434,100	62,966,484.00	3.17
7	688677	海泰新光	1,490,600	58,476,238.00	2.94
8	000035	中国天楹	11,618,285	52,630,831.05	2.65
9	689009	九号公司	1,420,000	51,820,200.00	2.61
10	688692	达梦数据	224,208	50,307,791.04	2.53

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	143,929,752.39	7.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	143,929,752.39	7.24

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127052	西子转债	410,061	46,342,734.97	2.33
2	123142	申昊转债	423,464	38,395,538.89	1.93
3	110081	闻泰转债	200,000	19,820,449.32	1.00

4	113677	华懋转债	100,000	10,820,068.49	0.54
5	113638	台 21 转债	90,000	10,088,395.89	0.51

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	123,506.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	777,354.41
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	900,861.15

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127052	西子转债	46,342,734.97	2.33
2	123142	申昊转债	38,395,538.89	1.93
3	110081	闻泰转债	19,820,449.32	1.00
4	113677	华懋转债	10,820,068.49	0.54
5	113638	台 21 转债	10,088,395.89	0.51
6	127024	盈峰转债	6,399,945.21	0.32
7	123158	宙邦转债	6,254,306.16	0.31
8	128132	交建转债	3,726,084.38	0.19
9	123197	光力转债	2,082,229.08	0.10

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	689009	九号公司	5,071,500.00	0.26	大宗交易取得并带有限售期

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红京东大数据混合 A	东方红京东大数据混合 C
报告期期初基金份额总额	562,389,893.48	272,882,514.37
报告期期间基金总申购份额	54,174,594.53	14,240,981.60
减：报告期期间基金总赎回份额	53,340,390.39	38,418,609.34
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	563,224,097.62	248,704,886.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	东方红京东大数据混合 A	东方红京东大数据混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,006,300.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,006,300.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.78	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，本基金管理人不存在申购、赎回或交易本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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

上海东方证券资产管理有限公司

2024 年 7 月 19 日