

# 东方红价值精选混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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

送出日期：2021 年 8 月 31 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 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 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 主要财务指标和基金净值表现</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         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 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       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 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内容的真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>48</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 48        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 48        |
| 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       | 49        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 52        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 53        |
| 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      | 54        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 54        |
| 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 ..... | 54        |
| 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 .....    | 54        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 54        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 55        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 55        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>57</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 57        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 58        |
| 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 .....      | 58        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>58</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>59</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 59        |
| 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 .....      | 59        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 59        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 59        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 59        |
| 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 .....         | 59        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 59        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 62        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>64</b> |
| 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 .....    | 64        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 64        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>64</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 64        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 64        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 64        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                  |                  |
|---------------------|------------------|------------------|
| 基金名称                | 东方红价值精选混合型证券投资基金 |                  |
| 基金简称                | 东方红价值精选混合        |                  |
| 基金主代码               | 002783           |                  |
| 基金运作方式              | 契约型开放式           |                  |
| 基金合同生效日             | 2016 年 9 月 23 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       |                  |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 849,748,092.95 份 |                  |
| 基金合同存续期             | 不定期              |                  |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 东方红价值精选混合 A      | 东方红价值精选混合 C      |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 002783           | 002784           |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 688,522,515.83 份 | 161,225,577.12 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金以追求绝对收益为目标,在严格控制投资组合风险的前提下,追求资产净值的长期稳健增值。                         |
| 投资策略   | 本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略,在做好风险管理的基础上,运用多样化的投资策略实现基金资产的稳定增值。           |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%                                       |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,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。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人             | 基金托管人                  |
|-------------|------|-------------------|------------------------|
| 名称          |      | 上海东方证券资产管理有限公司    | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李云亮               | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 021-53952828      | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | service@dfham.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 4009200808        | 95555                  |

|       |                           |                      |
|-------|---------------------------|----------------------|
| 传真    | 021-63326381              | 0755-83195201        |
| 注册地址  | 上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 办公地址  | 上海市黄浦区外马路 108 号 7 层-11 层  | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码  | 200010                    | 518040               |
| 法定代表人 | 宋雪枫                       | 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址 | www.dfham.com       |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市黄浦区外马路 108 号 7 层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址             |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |               |
|---------------|-------------------------------------|---------------|
|               | 东方红价值精选混合 A                         | 东方红价值精选混合 C   |
| 本期已实现收益       | 42,026,245.01                       | 10,144,622.14 |
| 本期利润          | 32,526,362.58                       | 6,857,948.84  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0454                              | 0.0386        |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.12%                               | 2.70%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.20%                               | 2.99%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)               |               |
|               | 期末可供分配利润                            | 57,003,035.77 |

|              |                  |                |
|--------------|------------------|----------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3813           | 0.3536         |
| 期末基金资产净值     | 1,016,030,704.91 | 233,222,532.96 |
| 期末基金份额净值     | 1.4757           | 1.4466         |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) |                |
| 基金份额累计净值增长率  | 53.64%           | 50.68%         |

注：1、上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、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）。

### 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

东方红价值精选混合 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      | 0.40%    | 0.22%       | -0.43%     | 0.17%         | 0.83%  | 0.05% |
| 过去三个月      | 2.13%    | 0.25%       | 1.09%      | 0.20%         | 1.04%  | 0.05% |
| 过去六个月      | 3.20%    | 0.36%       | 0.73%      | 0.27%         | 2.47%  | 0.09% |
| 过去一年       | 14.44%   | 0.37%       | 4.84%      | 0.26%         | 9.60%  | 0.11% |
| 过去三年       | 44.70%   | 0.44%       | 13.45%     | 0.26%         | 31.25% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 53.64%   | 0.40%       | 11.97%     | 0.24%         | 41.67% | 0.16% |

东方红价值精选混合 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      | 0.37%    | 0.22%       | -0.43%     | 0.17%         | 0.80%  | 0.05% |
| 过去三个月      | 2.03%    | 0.25%       | 1.09%      | 0.20%         | 0.94%  | 0.05% |
| 过去六个月      | 2.99%    | 0.36%       | 0.73%      | 0.27%         | 2.26%  | 0.09% |
| 过去一年       | 13.98%   | 0.37%       | 4.84%      | 0.26%         | 9.14%  | 0.11% |
| 过去三年       | 42.97%   | 0.44%       | 13.45%     | 0.26%         | 29.52% | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 50.68%   | 0.40%       | 11.97%     | 0.24%         | 38.71% | 0.16% |

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%

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

$$\text{benchmark}_t = 80\% * [\text{t 日中债综合指数} / (\text{t-1 日中债综合指数}) - 1] + 20\% * [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1];$$

期间 T 日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

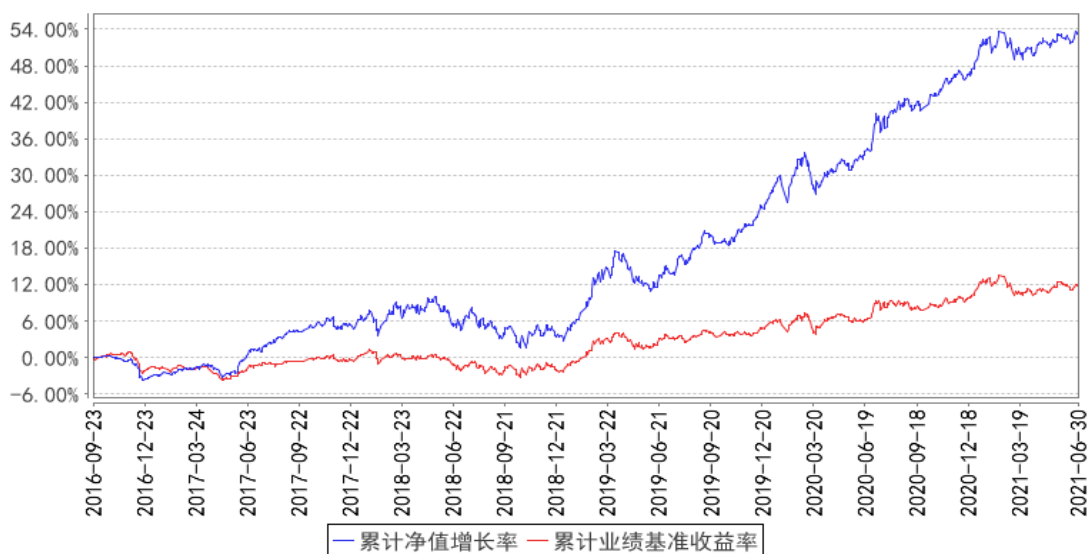
$$\text{benchmark}_T = [\prod (1 + \text{benchmark}_t)] - 1, \text{ 其中 } t=1, 2, 3, \dots, T, T \text{ 表示时间截至日};$$

$\prod (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $(1 + \text{benchmark}_t)$  的数学连乘。

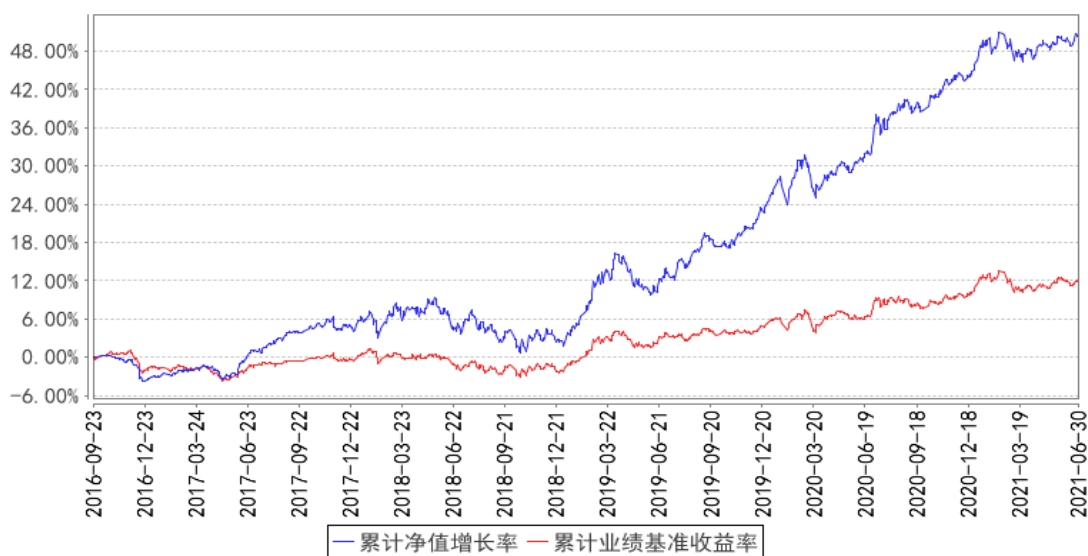


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红价值精选混合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



东方红价值精选混合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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集

证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债

券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金共计 70 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                 | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|--------------------|-----------------|------|--------|--|
|     |                    | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 纪文静 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理 | 2016 年 9 月 23 日 | -    | 14 年   | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2015 年 07 月至今任东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2015 年 07 月至今任东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2015 年 07 月至今任东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理、2015 年 07 月至 2017 年 09 月任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2015 年 10 月至今任东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（原东方红纯债债券型发起式证券投资基金）基金经理、2015 年 11 月至今任东方红收益增强债券型证券投资基金基金经理、2015 年 11 月至今任东方红信用债债券型证券投资基金基金经理、2016 年 05 月至今任东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、2016 年 05 月至 2017 年 08 月任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2016 年 06 月至 2017 年 08 月任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金经理、2016 年 09 月至今任东方红价值精选混合型证券投资基金基金经理、2016 年 11 月至今任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、2017 年 04 月至今任东方红智逸沪港 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至 2018 年 11 月任东方红货币市场基金基金经理。江苏大学经济学硕士。曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理，德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理。具备证券投资基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 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

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

权益方面，上半年市场经历春节后一波大幅回调后震荡上涨，结构性分化较大，上证综指上

半年上涨 3.4%，创业板指上涨 17.22%。分行业来看，有色金融、电力设备及新能源、钢铁、煤炭、化工、汽车等行业出现较为明显的上涨。本产品一方面配置于一些估值水平处于历史低位、股息回报率已经较高的大盘蓝筹公司；另一方面也兼顾了一些成长性行业的优质标的，从中选择一些估值合理的优秀新兴行业公司进行配置。

转债方面，上半年中证转债指数上涨 4.04%。目前转债市场估值分化较大，一些主流品种的转债估值水平已经达到历史高位，整体配置价值有所下降。一些偏债类品种的收益率已经接近甚至高于同等级纯债，具备一定的配置价值。另外在估值合理的品种中精选一些优质个券进行投资。

债券方面，2021 年上半年收益率震荡下行。一季度市场对于全球经济复苏共振的预期较强，叠加资金面的扰动、不断上升的通胀预期，十年国债收益率一度上行至 3.28%。二季度虽然经济指标整体仍然较好、PPI 数据持续创新高，但在地方债供给较少、超预期宽松的资金面推动下，十年国债收益率一度下行至 3.04%。信用债收益率也随之下行，信用利差有所压缩，3 年 AAA 品种从年初的 3.54%下行至 3.41%。本产品在债券配置上精选个券，有效防范信用风险，调整组合久期和杠杆，获取稳定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.4757 元，份额累计净值为 1.5257 元；C 类份额净值为 1.4466 元，份额累计净值为 1.4966 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 3.2%，同期业绩比较基准为 0.73%；C 类份额净值增长率为 2.99%，同期业绩比较基准为 0.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面，展望下半年，地产销售有所回落，出口仍处高位但边际有所放缓，地方债发行节奏提速，基建的表现或好于上半年。货币政策相较上半年有所放松，降准有助于缓解中游制造业企业的压力，经济的韧性或有所持续，流动性仍然维持宽松的环境。市场整体或仍维持震荡的格局，估值分化也可能依然存在。一些长期空间更大的行业估值水平或仍较高，作为未来产业发展的重要方向，这些行业仍是重要的配置标的，但需要关注其波动的加剧。一些传统行业的公司，当前估值较低，公司的盈利能力仍然稳定，具备较好的投资价值。

转债方面，虽然目前整体转债市场估值相对较高，目前转债市场仍在扩容过程中，新券中有一些个券水平仍然处在相对合理的区间，本产品仍然坚持绝对收益的投资思路，结合公司本身的资质以及转债的估值定价水平，精选一些优质转债进行配置。

债券方面，展望未来，市场震荡的中枢较上半年将有所下行。一方面，7 月的降准使得原先对于下半年的货币政策边际转紧的预期有所修正，资金面整体或维持稳定；另一方面，经济边际

走弱的迹象显现，地产销售在各项地产政策作用下开始下滑，制造业 PMI 出现连续下滑。同时需要关注的是，三季度地方债供给放量，基建或较上半年有所好转，降准更多针对经济修复不均衡的问题，政策作用下经济的韧性仍有望延续。货币市场利率在没有进一步宽松政策前继续下行的空间不大，这就抑制了短端利率的下行空间。因此，操作上还是要关注基本面和资金面的预期差交易机会，以及期限利差收窄的可能。同时仍将维持个券精细化操作，寻求稳健的收益，防范信用风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种，并提交估值委员会审议。运营部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

#### 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进行利润分配。

#### 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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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：东方红价值精选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 5,027,891.00           | 8,114,384.19             |
| 结算备付金      |         | 3,703,742.20           | 7,571,865.59             |
| 存出保证金      |         | 54,183.93              | 89,617.13                |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 1,317,481,769.80       | 1,257,249,955.11         |
| 其中：股票投资    |         | 299,738,418.58         | 291,573,385.85           |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 1,017,743,351.22       | 965,676,569.26           |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | -                      | 7,000,000.00             |
| 应收证券清算款    |         | 1,637,819.90           | 500,819.23               |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 12,642,826.45             | 11,578,506.51               |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 348,570.69                | 2,484,156.93                |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 1,340,896,803.97          | 1,294,589,304.69            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2020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       |            | 87,000,000.00             | -                           |
| 应付证券清算款         |            | -                         | 6,805,252.79                |
| 应付赎回款           |            | 3,410,855.53              | 1,716,045.78                |
| 应付管理人报酬         |            | 741,194.30                | 750,569.31                  |
| 应付托管费           |            | 211,769.81                | 214,448.36                  |
| 应付销售服务费         |            | 78,350.16                 | 85,752.45                   |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 37,560.61                 | 61,179.20                   |
| 应交税费            |            | 21,868.61                 | 24,013.76                   |
| 应付利息            |            | -                         | -                           |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 141,967.08                | 174,040.16                  |
| 负债合计            |            | 91,643,566.10             | 9,831,301.81                |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 849,748,092.95            | 901,664,460.01              |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 399,505,144.92            | 383,093,542.87              |
| 所有者权益合计         |            | 1,249,253,237.87          | 1,284,758,002.88            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,340,896,803.97          | 1,294,589,304.69            |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 849,748,092.95 份，其中东方红价值精选混合型证券投资基金 A 类基金份额总额 688,522,515.83 份，基金份额净值 1.4757 元；东方红价值精选混合型证券投资基金 C 类基金份额总额 161,225,577.12 份，基金份额净值 1.4466 元。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目  | 附注号 | 本期                                 | 上年度可比期间                            |
|------|-----|------------------------------------|------------------------------------|
|      |     | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 |
| 一、收入 |     | 46,551,157.07                      | 27,270,838.35                      |



|                        |            |                |                |
|------------------------|------------|----------------|----------------|
| 1. 利息收入                |            | 14,852,521.93  | 6,229,504.38   |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 70,303.32      | 84,876.84      |
| 债券利息收入                 |            | 14,741,522.75  | 6,142,268.64   |
| 资产支持证券利息收入             |            | -              | -              |
| 买入返售金融资产收入             |            | 40,695.86      | 2,358.90       |
| 证券出借利息收入               |            | -              | -              |
| 其他利息收入                 |            | -              | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 44,407,745.82  | 36,471,887.72  |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 38,604,217.27  | 28,221,648.51  |
| 基金投资收益                 | -          | -              | -              |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 3,078,143.66   | 7,246,352.93   |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.13.5 | -              | -              |
| 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   | 2,725,384.89   | 1,003,886.28   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -12,786,555.73 | -15,490,128.29 |
| 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   | 77,445.05      | 59,574.54      |
| 减：二、费用                 |            | 7,166,845.65   | 2,812,068.92   |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 4,499,634.68   | 1,418,615.33   |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,285,609.97   | 405,318.72     |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 504,349.93     | 98,746.96      |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 292,297.82     | 301,307.10     |
| 5. 利息支出                |            | 452,273.83     | 453,841.88     |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 452,273.83     | 453,841.88     |
| 6. 税金及附加               |            | 19,778.81      | 17,367.38      |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 112,900.61     | 116,871.55     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 39,384,311.42  | 24,458,769.43  |
| 减：所得税费用                |            | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 39,384,311.42  | 24,458,769.43  |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                |                  |
|--|--|----------------|------------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 901,664,460.01                             | 383,093,542.87 | 1,284,758,002.88 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -  | 39,384,311.42  | 39,384,311.42    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -51,916,367.06                             | -22,972,709.37 | -74,889,076.43   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 164,714,656.66                             | 72,810,188.91  | 237,524,845.57   |
| 2. 基金赎回款                               | -216,631,023.72                            | -95,782,898.28 | -312,413,922.00  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -  | -              | -                |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 849,748,092.95                             | 399,505,144.92 | 1,249,253,237.87 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                  |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 382,265,818.24                             | 90,684,982.22  | 472,950,800.46   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -  | 24,458,769.43  | 24,458,769.43    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 53,265,906.15                              | 21,228,052.57  | 74,493,958.72    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 216,449,153.24                             | 64,632,026.40  | 281,081,179.64   |

|  |                 |                |                 |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款                               | -163,183,247.09 | -43,403,973.83 | -206,587,220.92 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -               | -              | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 435,531,724.39  | 136,371,804.22 | 571,903,528.61  |

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：

张锋

汤琳

陈培

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方红价值精选混合型证券投资基金(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[2016]911号《关于准予东方红价值精选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红价值精选混合型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1,490,054,637.32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(2016)第1191号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红价值精选混合型证券投资基金基金合同》于2016年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,490,143,391.29份基金份额,其中认购资金利息折合88,753.97份基金份额,其中东方红价值精选混合A的基金份额总额为1,243,245,744.36份,包含认购资金利息折合74,146.42份,东方红价值精选混合C的基金份额总额为246,897,646.93份,包含认购资金利息折合14,607.55份。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为招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《东方红价值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及存托凭证(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券)、

债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经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。本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)投资比例为基金资产的 0%-30%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货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%。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率\*80%+沪深 300 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》、《东方红价值精选混合型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、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 2021 年半年度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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 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>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 5,027,891.00           |
| 定期存款           | -                      |
| 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           | -                      |
| 合计             | 5,027,891.00           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                  |                  |
|---------------|------------------------|------------------|------------------|
|               | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票            | 245,558,203.34         | 299,738,418.58   | 54,180,215.24    |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -                | -                |
| 债券            | 交易所市场                  | 869,830,732.32   | 871,716,351.22   |
|               | 银行间市场                  | 146,072,500.00   | 146,027,000.00   |
|               | 合计                     | 1,015,903,232.32 | 1,017,743,351.22 |
| 资产支持证券        | -                      | -                | -                |
| 基金            | -                      | -                | -                |
| 其他            | -                      | -                | -                |
| 合计            | 1,261,461,435.66       | 1,317,481,769.80 | 56,020,334.14    |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|            | 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|-----------------|
| 应收活期存款利息   | 1,201.73        |
| 应收定期存款利息   | -               |
| 应收其他存款利息   | -               |
| 应收结算备付金利息  | 1,666.00        |
| 应收债券利息     | 12,639,926.13   |
| 应收资产支持证券利息 | -               |
| 应收买入返售证券利息 | -               |
| 应收申购款利息    | 8.19            |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -               |
| 应收出借证券利息   | -               |
| 其他         | 24.40           |
| 合计         | 12,642,826.45   |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 37,085.61              |
| 银行间市场应付交易费用 | 475.00                 |
| 合计          | 37,560.61              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 1,680.76               |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 140,286.32             |
| 合计          | 141,967.08             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东方红价值精选混合 A

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 718,423,275.72                        | 718,423,275.72  |
| 本期申购          | 91,502,342.99                         | 91,502,342.99   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -121,403,102.88                       | -121,403,102.88 |
| -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           | 688,522,515.83 | 688,522,515.83 |

东方红价值精选混合 C

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 183,241,184.29                        | 183,241,184.29 |
| 本期申购          | 73,212,313.67                         | 73,212,313.67  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -95,227,920.84                        | -95,227,920.84 |
| -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           | 161,225,577.12                        | 161,225,577.12 |

注：申购含红利再投、转入份额。赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东方红价值精选混合 A

| 项目                     | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末                   | 231,324,566.13 | 77,626,476.69  | 308,951,042.82 |
| 本期利润                   | 42,026,245.01  | -9,499,882.43  | 32,526,362.58  |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | -10,849,283.13 | -3,119,933.19  | -13,969,216.32 |
| 其中：基金申<br>购款           | 32,316,367.91  | 9,395,311.02   | 41,711,678.93  |
| 基金赎<br>回款              | -43,165,651.04 | -12,515,244.21 | -55,680,895.25 |
| 本期已分配利<br>润            | -              | -              | -              |
| 本期末                    | 262,501,528.01 | 65,006,661.07  | 327,508,189.08 |

东方红价值精选混合 C

| 项目                     | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末                   | 54,648,173.89 | 19,494,326.16 | 74,142,500.05 |
| 本期利润                   | 10,144,622.14 | -3,286,673.30 | 6,857,948.84  |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | -7,789,760.26 | -1,213,732.79 | -9,003,493.05 |
| 其中：基金申                 | 23,411,861.95 | 7,686,648.03  | 31,098,509.98 |



|         |                |               |                |
|---------|----------------|---------------|----------------|
| 购款      |                |               |                |
| 基金赎回款   | -31,201,622.21 | -8,900,380.82 | -40,102,003.03 |
| 本期已分配利润 | -              | -             | -              |
| 本期末     | 57,003,035.77  | 14,993,920.07 | 71,996,955.84  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 34,812.05                  |
| 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 | 32,033.44                  |
| 其他        | 3,457.83                   |
| 合计        | 70,303.32                  |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 38,604,217.27              |
| 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               | 38,604,217.27              |

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 110,781,645.73             |
| 减：卖出股票成本总额 | 72,177,428.46              |
| 买卖股票差价收入   | 38,604,217.27              |

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,078,143.66               |
| 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                            | 3,078,143.66               |

#### 6.4.7.13.2 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>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 208,135,050.39             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 199,448,151.02             |
| 减：应收利息总额                | 5,608,755.71               |
| 买卖债券差价收入                | 3,078,143.66               |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：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

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 2,725,384.89               |
| 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            | 2,725,384.89               |

#### 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>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -12,786,555.73             |
| 股票投资       | -16,209,720.54             |
| 债券投资       | 3,423,164.81               |
| 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                     | -12,786,555.73 |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 77,426.98                  |
| 基金转换费收入 | 18.07                      |
| 合计      | 77,445.05                  |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 291,072.82                 |
| 银行间市场交易费用 | 1,225.00                   |
| 合计        | 292,297.82                 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 26,778.95                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行费用    | 8,014.29                   |
| 账户维护费   | 18,600.00                  |
| 合计      | 112,900.61                 |

#### 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

截至财务报表报出日，本基金并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

本基金本报告期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         |
|------------------------|-----------------|
| 上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”） | 基金管理人、基金销售机构    |
| 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    |
| 上海东证期货有限公司（“东证期货”）     | 受东方证券控制的公司      |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）     | 基金销售机构、基金管理人的股东 |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 东方证券  | 112,074,130.34             | 57.29                   | 104,585,479.11                  | 52.06                   |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 东方证券  | 100,869,508.68             | 75.53                   | 294,534,175.10                  | 94.30                   |

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                           | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                           |
|-------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 东方证券  | 4,869,000,000.00           | 99.21                     | 4,107,100,000.00                | 99.52                     |

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 东方证券  | 77,884.20                       | 56.72              | 18,882.06    | 50.91                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 东方证券  | 76,483.90                       | 52.75              | 19,757.81    | 33.89                |

注：1、上述佣金按照市场价格计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

#### 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>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,499,634.68                   | 1,418,615.33                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 527,184.60                     | 711,275.60                          |

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

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

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,285,609.97                          | 405,318.72                                 |

注：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

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

#### 6.4.10.2.3 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |             |            |
|--------------------|--|-------------|------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |             |            |
|                    | 东方红价值精选混合 A                                | 东方红价值精选混合 C | 合计         |
| 东证资管               | —  | 312,355.30  | 312,355.30 |
| 东方证券               | —  | 13,625.76   | 13,625.76  |
| 招商银行               | —  | 98,123.53   | 98,123.53  |
| 合计                 | —  | 424,104.59  | 424,104.59 |
| 获得销售服务费的各关联方名称     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |             |            |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |             |            |
|                    | 东方红价值精选混合 A                                | 东方红价值精选混合 C | 合计         |
| 东方证券               | —  | 5,622.08    | 5,622.08   |
| 上海东方证券资产管理有<br>限公司 | —  | 16,280.10   | 16,280.10  |
| 招商银行               | —  | 75,860.53   | 75,860.53  |

|    |   |           |           |
|----|---|-----------|-----------|
| 合计 | - | 97,762.71 | 97,762.71 |
|----|---|-----------|-----------|

注：本基金 C 类份额的销售服务费率按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

##### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

#### 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

注：本基金本报告期内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。

##### 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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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>2021年1月1日至2021年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6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  | 5,027,891.00               | 34,812.05 | 4,345,033.60                    | 44,952.43 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，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

注：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

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，存出保证金不计息。于2021年6月30日，本基金的结算备付金余额为2,784.66元，无存出保证金余额(2020年12月31日：结算备付金2,774.56元，无存出保证金余额)。于2021年上半年，本基金当期结算备付金利息收入10.04元(2020年同期：10.92元)。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2021年6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       | 可流通日        | 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 |
| 300614               | 百川畅银 | 2021年5月18日  | 2021年11月25日 | 新股锁定   | 9.19  | 40.38  | 329      | 3,023.51  | 13,285.02 | -  |
| 300919               | 中伟股份 | 2020年12月15日 | 2021年7月2日   | 新股锁定   | 24.60 | 163.00 | 610      | 15,006.00 | 99,430.00 | -  |
| 300927               | 江天化学 | 2020年12月29日 | 2021年7月7日   | 新股锁定   | 13.39 | 30.10  | 217      | 2,905.63  | 6,531.70  | -  |
| 300929               | 华骐环保 | 2021年1月12日  | 2021年07月21日 | 新股锁定   | 13.87 | 29.55  | 183      | 2,538.21  | 5,407.65  | -  |

|        |      |            |            |         |       |        |     |           |            |   |
|--------|------|------------|------------|---------|-------|--------|-----|-----------|------------|---|
| 300930 | 屹通新材 | 2021年1月13日 | 2021年7月21日 | 新股锁定    | 13.11 | 24.48  | 322 | 4,221.42  | 7,882.56   | - |
| 300931 | 通用电梯 | 2021年1月13日 | 2021年7月21日 | 新股锁定    | 4.31  | 13.11  | 672 | 2,896.32  | 8,809.92   | - |
| 300937 | 药易购  | 2021年1月20日 | 2021年7月27日 | 新股锁定    | 12.25 | 53.71  | 244 | 2,989.00  | 13,105.24  | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021年2月3日  | 2021年8月10日 | 新股锁定    | 9.79  | 23.01  | 255 | 2,496.45  | 5,867.55   | - |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021年2月3日  | 2021年8月10日 | 新股锁定    | 4.56  | 18.88  | 474 | 2,161.44  | 8,949.12   | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年2月18日 | 2021年8月25日 | 新股锁定    | 13.00 | 27.42  | 216 | 2,808.00  | 5,922.72   | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年6月4日  | 2021年8月25日 | 新股锁定-送股 | -     | 27.42  | 108 | -         | 2,961.36   | - |
| 300950 | 德固特  | 2021年2月24日 | 2021年9月3日  | 新股锁定    | 8.41  | 39.13  | 219 | 1,841.79  | 8,569.47   | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021年3月3日  | 2021年9月13日 | 新股锁定    | 11.72 | 27.08  | 340 | 3,984.80  | 9,207.20   | - |
| 300953 | 震裕科技 | 2021年3月11日 | 2021年9月22日 | 新股锁定    | 28.77 | 99.85  | 240 | 6,904.80  | 23,964.00  | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021年3月16日 | 2021年9月24日 | 新股锁定    | 16.53 | 46.07  | 232 | 3,834.96  | 10,688.24  | - |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021年3月18日 | 2021年9月27日 | 新股锁定    | 47.33 | 251.96 | 853 | 40,372.49 | 214,921.88 | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021年3月18日 | 2021年9月29日 | 新股锁定    | 8.53  | 27.22  | 300 | 2,559.00  | 8,166.00   | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021年3月22日 | 2021年9月29日 | 新股锁定    | 12.08 | 23.06  | 234 | 2,826.72  | 5,396.04   | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021年3月    | 2021年9月    | 新股锁定    | 8.48  | 22.07  | 394 | 3,341.12  | 8,695.58   | - |

|        |      |                 |                  |      |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------|------------------|------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      | 23 日            | 30 日             |      |       |        |       |           |           |   |
| 300962 | 中金辐照 | 2021 年 3 月 29 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 新股锁定 | 3.40  | 16.37  | 576   | 1,958.40  | 9,429.12  | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021 年 3 月 30 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 新股锁定 | 12.13 | 22.49  | 283   | 3,432.79  | 6,364.67  | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021 年 3 月 31 日 | 2021 年 10 月 11 日 | 新股锁定 | 8.24  | 31.54  | 286   | 2,356.64  | 9,020.44  | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021 年 4 月 2 日  | 2021 年 10 月 13 日 | 新股锁定 | 4.54  | 11.54  | 507   | 2,301.78  | 5,850.78  | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021 年 4 月 6 日  | 2021 年 10 月 15 日 | 新股锁定 | 6.87  | 12.07  | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021 年 4 月 7 日  | 2021 年 10 月 15 日 | 新股锁定 | 18.24 | 28.29  | 245   | 4,468.80  | 6,931.05  | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021 年 4 月 8 日  | 2021 年 10 月 19 日 | 新股锁定 | 7.19  | 12.65  | 430   | 3,091.70  | 5,439.50  | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021 年 4 月 8 日  | 2021 年 10 月 15 日 | 新股锁定 | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021 年 4 月 14 日 | 2021 年 10 月 21 日 | 新股锁定 | 5.48  | 13.03  | 492   | 2,696.16  | 6,410.76  | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021 年 4 月 15 日 | 2021 年 10 月 26 日 | 新股锁定 | 8.42  | 13.60  | 593   | 4,993.06  | 8,064.80  | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021 年 4 月 15 日 | 2021 年 10 月 26 日 | 新股锁定 | 33.22 | 87.50  | 925   | 30,728.50 | 80,937.50 | - |

|        |      |            |             |      |       |       |     |          |           |   |
|--------|------|------------|-------------|------|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
|        |      |            | 日           |      |       |       |     |          |           |   |
| 300982 | 苏文电能 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股锁定 | 15.83 | 45.29 | 317 | 5,018.11 | 14,356.93 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021年4月21日 | 2021年10月29日 | 新股锁定 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95  | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021年4月21日 | 2021年11月1日  | 新股锁定 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48  | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021年4月28日 | 2021年11月11日 | 新股锁定 | 6.79  | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81  | - |
| 300991 | 创益通  | 2021年5月12日 | 2021年11月22日 | 新股锁定 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54  | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021年5月17日 | 2021年11月25日 | 新股锁定 | 9.36  | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00  | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021年5月17日 | 2021年11月24日 | 新股锁定 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90  | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年5月17日 | 2021年11月26日 | 新股锁定 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12  | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021年5月26日 | 2021年12月3日  | 新股锁定 | 20.81 | 42.23 | 241 | 5,015.21 | 10,177.43 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021年5月25日 | 2021年12月2日  | 新股锁定 | 6.02  | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32  | - |
| 301002 | 崧盛股份 | 2021年5月27日 | 2021年12月7日  | 新股锁定 | 18.71 | 57.62 | 201 | 3,760.71 | 11,581.62 | - |
| 301004 | 嘉益股份 | 2021年6月18日 | 2021年12月27日 | 新股锁定 | 7.81  | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28  | - |

|        |      |            |             |       |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-------------|-------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      |            | 日           |       |       |       |       |           |           |   |
| 301007 | 德迈仕  | 2021年6月4日  | 2021年12月16日 | 新股锁定  | 5.29  | 14.44 | 303   | 1,602.87  | 4,375.32  | - |
| 301009 | 可靠股份 | 2021年6月8日  | 2021年12月17日 | 新股锁定  | 12.54 | 27.89 | 801   | 10,044.54 | 22,339.89 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021年6月9日  | 2021年12月20日 | 新股锁定  | 7.83  | 17.61 | 218   | 1,706.94  | 3,838.98  | - |
| 301011 | 华立科技 | 2021年6月9日  | 2021年12月17日 | 新股锁定  | 14.20 | 33.84 | 175   | 2,485.00  | 5,922.00  | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年6月15日 | 2021年12月22日 | 新股锁定  | 8.05  | 24.26 | 170   | 1,368.50  | 4,124.20  | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021年6月22日 | 2021年12月30日 | 新股锁定  | 7.64  | 38.83 | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021年6月23日 | 2021年12月30日 | 新股锁定  | 13.75 | 32.98 | 275   | 3,781.25  | 9,069.50  | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年6月23日 | 2022年1月5日   | 新股锁定  | 8.86  | 8.86  | 555   | 4,917.30  | 4,917.30  | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021年6月23日 | 2021年7月5日   | 新股未上市 | 8.86  | 8.86  | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年6月28日 | 2022年1月6日   | 新股锁定  | 10.64 | 10.64 | 421   | 4,479.44  | 4,479.44  | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日   | 新股未上市 | 10.64 | 10.64 | 3,789 | 40,314.96 | 40,314.96 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日   | 新股未上市 | 9.46  | 9.46  | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |

|        |      |             |             |       |       |        |         |              |              |   |
|--------|------|-------------|-------------|-------|-------|--------|---------|--------------|--------------|---|
| 301021 | 英诺激光 | 2021年6月28日  | 2022年1月6日   | 新股锁定  | 9.46  | 9.46   | 290     | 2,743.40     | 2,743.40     | - |
| 600905 | 三峡能源 | 2021年6月2日   | 2021年12月10日 | 新股锁定  | 2.65  | 5.67   | 907,763 | 2,405,571.95 | 5,147,016.21 | - |
| 605162 | 新中港  | 2021年6月29日  | 2021年7月7日   | 新股未上市 | 6.07  | 6.07   | 1,377   | 8,358.39     | 8,358.39     | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021年6月28日  | 2021年7月6日   | 新股未上市 | 31.56 | 31.56  | 349     | 11,014.44    | 11,014.44    | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021年6月30日  | 2021年7月9日   | 新股未上市 | 21.96 | 21.96  | 2,469   | 54,219.24    | 54,219.24    | - |
| 688195 | 腾景科技 | 2021年3月18日  | 2021年9月27日  | 新股锁定  | 13.60 | 19.87  | 2,693   | 36,624.80    | 53,509.91    | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年6月28日  | 2021年7月7日   | 新股未上市 | 6.42  | 6.42   | 2,693   | 17,289.06    | 17,289.06    | - |
| 688315 | 诺禾致源 | 2021年4月2日   | 2021年10月13日 | 新股锁定  | 12.76 | 39.20  | 3,711   | 47,352.36    | 145,471.20   | - |
| 688350 | 富淼科技 | 2021年1月21日  | 2021年7月28日  | 新股锁定  | 13.58 | 22.44  | 2,552   | 34,656.16    | 57,266.88    | - |
| 688359 | 三孚新科 | 2021年5月14日  | 2021年11月22日 | 新股锁定  | 11.03 | 26.35  | 2,213   | 24,409.39    | 58,312.55    | - |
| 688499 | 利元亨  | 2021年6月23日  | 2021年7月1日   | 新股未上市 | 38.85 | 38.85  | 2,149   | 83,488.65    | 83,488.65    | - |
| 688617 | 惠泰医疗 | 2020年12月30日 | 2021年7月7日   | 新股锁定  | 74.46 | 373.24 | 1,673   | 124,571.58   | 624,430.52   | - |
| 688625 | 呈和科技 | 2021年5月31日  | 2021年12月7日  | 新股锁定  | 16.48 | 42.63  | 2,672   | 44,034.56    | 113,907.36   | - |
| 688662 | 富信   | 2021        | 2021        | 新股锁   | 15.61 | 29.51  | 2,556   | 39,899.16    | 75,427.56    | - |

|                      | 科技       | 年 3 月<br>25 日         | 年 10<br>月 8 日         | 定          |          |            |                  |            |            |    |
|----------------------|----------|-----------------------|-----------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 688669               | 聚石<br>化学 | 2021<br>年 1 月<br>15 日 | 2021<br>年 7 月<br>26 日 | 新股锁<br>定   | 36.65    | 32.39      | 2,681            | 98,258.65  | 86,837.59  | -  |
| 688819               | 天能<br>股份 | 2021<br>年 1 月<br>7 日  | 2021<br>年 7 月<br>19 日 | 新股锁<br>定   | 41.79    | 43.69      | 19,229           | 803,579.91 | 840,115.01 | -  |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |          |                       |                       |            |          |            |                  |            |            |    |
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日             | 可流通<br>日              | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位：<br>张) | 期末<br>成本总额 | 期末估值总额     | 备注 |
| 113050               | 南银<br>转债 | 2021<br>年 6 月<br>17 日 | 2021<br>年 7 月<br>1 日  | 新债未<br>上市  | 100.00   | 100.00     | 3,580            | 358,000.00 | 358,000.00 | -  |

注：1、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。

2、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。

3、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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告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

注：本基金本报告期末无从事银行间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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，基金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 87,000,000.00 元，于 2021 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无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

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案等。

#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，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；在银行间同业市场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评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。



#### 6.4.13.2.1 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<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 50,070,000.00     | 50,025,000.00       |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 57,757,270.00     | 59,385,510.00       |
| 合计     | 107,827,270.00    | 109,410,510.00      |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 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<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 97,125,000.00     | -                   |
| 合计     | 97,125,000.00     | -                   |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.4 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<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 741,858,843.12    | 680,003,509.46      |
| AAA 以下 | 30,317,848.10     | 68,558,539.80       |
| 未评级    | 40,614,390.00     | 107,704,010.00      |
| 合计     | 812,791,081.22    | 856,266,059.26      |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 87,000,000.00 元将在 1 个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约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，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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，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 2021 年 06 月 30 日，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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 2021 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年6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                | 5,027,891.00   | -            | -              | -              | -             | -              | 5,027,891.00     |
| 结算备付金               | 3,703,742.20   | -            | -              | -              | -             | -              | 3,703,742.20     |
| 存出保证金               | 54,183.93      | -            | -              | -              | -             | -              | 54,183.93        |
| 交易性金融资产             | 23,000,900.00  | 8,723,490.00 | 477,532,674.00 | 411,932,374.00 | 96,553,913.22 | 299,738,418.58 | 1,317,481,769.80 |
| 应收利息                | -              | -            | -              | -              | -             | 12,642,826.45  | 12,642,826.45    |
| 应收申购款               | 112,088.06     | -            | -              | -              | -             | 236,482.63     | 348,570.69       |
| 应收证券清算款             | -              | -            | -              | -              | -             | 1,637,819.90   | 1,637,819.90     |
| 资产总计                | 31,898,805.19  | 8,723,490.00 | 477,532,674.00 | 411,932,374.00 | 96,553,913.22 | 314,255,547.56 | 1,340,896,803.97 |
| 负债                  |                |              |                |                |               |                |                  |
| 应付赎回款               | -              | -            | -              | -              | -             | 3,410,855.53   | 3,410,855.53     |
| 应付管理人报酬             | -              | -            | -              | -              | -             | 741,194.30     | 741,194.30       |
| 应付托管费               | -              | -            | -              | -              | -             | 211,769.81     | 211,769.81       |
| 卖出回购金融资产款           | 87,000,000.00  | -            | -              | -              | -             | -              | 87,000,000.00    |
| 应付销售服务费             | -              | -            | -              | -              | -             | 78,350.16      | 78,350.16        |
| 应付交易费用              | -              | -            | -              | -              | -             | 37,560.61      | 37,560.61        |
| 应交税费                | -              | -            | -              | -              | -             | 21,868.61      | 21,868.61        |
| 其他负债                | -              | -            | -              | -              | -             | 141,967.08     | 141,967.08       |
| 负债总计                | 87,000,000.00  | -            | -              | -              | -             | 4,643,566.10   | 91,643,566.10    |
| 利率敏感度缺口             | -55,101,194.81 | 8,723,490.00 | 477,532,674.00 | 411,932,374.00 | 96,553,913.22 | 309,611,981.46 | 1,249,253,237.87 |
| 上年度末<br>2020年12月31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                | 8,114,384.19   | -            | -              | -              | -             | -              | 8,114,384.19     |
| 结算备付金               | 7,571,865.59   | -            | -              | -              | -             | -              | 7,571,865.59     |
| 存出保证金               | 89,617.13      | -            | -              | -              | -             | -              | 89,617.13        |
| 交易性金融资              | 20,387,166.    | 1,799,280    | 271,205,153    | 513,978,       | 158,306,1     | 291,573,3      | 1,257,249,       |

|          |               |              |                |                |                |                |                  |
|----------|---------------|--------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 产        | 00            | .00          | .00            | 818.00         | 52.26          | 85.85          | 955.11           |
| 买入返售金融资产 | 7,000,000.00  | -            | -              | -              | -              | -              | 7,000,000.00     |
| 应收利息     | -             | -            | -              | -              | -              | 11,578,506.51  | 11,578,506.51    |
| 应收申购款    | 122,604.92    | -            | -              | -              | -              | 2,361,552.01   | 2,484,156.93     |
| 应收证券清算款  | -             | -            | -              | -              | -              | 500,819.23     | 500,819.23       |
| 资产总计     | 43,285,637.83 | 1,799,280.00 | 271,205,153.00 | 513,978,818.00 | 158,306,152.26 | 306,014,263.60 | 1,294,589,304.69 |
| 负债       |               |              |                |                |                |                |                  |
| 应付赎回款    | -             | -            | -              | -              | -              | 1,716,045.78   | 1,716,045.78     |
| 应付管理人报酬  | -             | -            | -              | -              | -              | 750,569.31     | 750,569.31       |
| 应付托管费    | -             | -            | -              | -              | -              | 214,448.36     | 214,448.36       |
| 应付证券清算款  | -             | -            | -              | -              | -              | 6,805,252.79   | 6,805,252.79     |
| 应付销售服务费  | -             | -            | -              | -              | -              | 85,752.45      | 85,752.45        |
| 应付交易费用   | -             | -            | -              | -              | -              | 61,179.20      | 61,179.20        |
| 应交税费     | -             | -            | -              | -              | -              | 24,013.76      | 24,013.76        |
| 其他负债     | -             | -            | -              | -              | -              | 174,040.16     | 174,040.16       |
| 负债总计     | -             | -            | -              | -              | -              | 9,831,301.81   | 9,831,301.81     |
| 利率敏感度缺口  | 43,285,637.83 | 1,799,280.00 | 271,205,153.00 | 513,978,818.00 | 158,306,152.26 | 296,182,961.79 | 1,284,758,002.88 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

|           |                             |                   |  |
|-----------|-----------------------------|-------------------|--|
| 假设        | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变          |                   |  |
| 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（2021年6月30日）             | 上年度末（2020年12月31日） |  |

|    |                     |               |               |
|----|---------------------|---------------|---------------|
| 分析 | 1. 市场利率下降 25<br>个基点 | 5,097,293.72  | 6,724,496.74  |
|    | 2. 市场利率上升 25<br>个基点 | -5,039,924.02 | -6,630,047.62 |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇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

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，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其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 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>2021年6月30日 |               | 上年度末<br>2020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  | 299,738,418.58    | 23.99         | 291,573,385.85      | 22.69         |
| 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            | 299,738,418.58    | 23.99         | 291,573,385.85      | 22.69         |

#### 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 |                             |                        |
|----|-------------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 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（2021 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 1. 沪深 300 指数上升 5%       | 15,695,358.08               | 14,896,339.98          |
|    | 2. 沪深 300 指数下降 5%       | -15,695,358.08              | -14,896,339.98         |

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 398,971,458.75 元，属于第二层次的余额为 918,510,311.05 元，无属于第三层次的余额。（2020 年 12 月 31 日：第一层次 174,346,658.28 元，第二层次 441,855,285.14 元，无属于第三层次的余额）。

##### (ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)除公允价值外，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              | 299,738,418.58   | 22.35         |
|    | 其中：股票             | 299,738,418.58   | 22.35         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,017,743,351.22 | 75.90         |
|    | 其中：债券             | 1,017,743,351.22 | 75.90         |
|    | 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      | 8,731,633.20     | 0.65          |
| 8  | 其他各项资产            | 14,683,400.97    | 1.10          |
| 9  | 合计                | 1,340,896,803.97 | 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。

### 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

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         | 11,290.28      | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 7,143,468.00   | 0.57         |
| C  | 制造业              | 210,752,634.39 | 16.87        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,160,036.60   | 0.41         |
| E  | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 95,577.58      | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,881,696.00   | 0.31         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 30,477.64      | 0.00         |
| J  | 金融业              | 61,612,083.75  | 4.93         |
| K  | 房地产业             | 10,835,873.44  | 0.87         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 145,471.20     | 0.01         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 44,438.33      | 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               | 299,738,418.58 | 23.99        |

### 7.2.2 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。

### 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）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 600887 | 伊利股份 | 490,037 | 18,048,062.71 | 1.44         |
| 2  | 002415 | 海康威视 | 263,683 | 17,007,553.50 | 1.36         |
| 3  | 002475 | 立讯精密 | 366,110 | 16,841,060.00 | 1.35         |
| 4  | 300122 | 智飞生物 | 79,900  | 14,919,727.00 | 1.19         |
| 5  | 300750 | 宁德时代 | 24,600  | 13,156,080.00 | 1.05         |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 634,600 | 13,041,030.00 | 1.04         |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 166,005 | 11,847,776.85 | 0.95         |
| 8  | 601688 | 华泰证券 | 741,100 | 11,709,380.00 | 0.94         |
| 9  | 002142 | 宁波银行 | 288,545 | 11,244,598.65 | 0.90         |
| 10 | 600031 | 三一重工 | 385,700 | 11,212,299.00 | 0.90         |
| 11 | 002304 | 洋河股份 | 52,300  | 10,836,560.00 | 0.87         |

|    |        |       |         |               |      |
|----|--------|-------|---------|---------------|------|
| 12 | 000002 | 万 科 A | 455,000 | 10,833,550.00 | 0.87 |
| 13 | 600741 | 华域汽车  | 406,508 | 10,678,965.16 | 0.85 |
| 14 | 600926 | 杭州银行  | 716,800 | 10,572,800.00 | 0.85 |
| 15 | 600745 | 闻泰科技  | 102,315 | 9,914,323.50  | 0.79 |
| 16 | 601318 | 中国平安  | 136,350 | 8,764,578.00  | 0.70 |
| 17 | 600426 | 华鲁恒升  | 277,550 | 8,590,172.50  | 0.69 |
| 18 | 601012 | 隆基股份  | 90,300  | 8,022,252.00  | 0.64 |
| 19 | 601899 | 紫金矿业  | 737,200 | 7,143,468.00  | 0.57 |
| 20 | 002444 | 巨星科技  | 200,666 | 6,838,697.28  | 0.55 |
| 21 | 601233 | 桐昆股份  | 276,900 | 6,670,521.00  | 0.53 |
| 22 | 002311 | 海大集团  | 80,400  | 6,560,640.00  | 0.53 |
| 23 | 600030 | 中信证券  | 250,400 | 6,244,976.00  | 0.50 |
| 24 | 002459 | 晶澳科技  | 109,800 | 5,380,200.00  | 0.43 |
| 25 | 600905 | 三峡能源  | 907,763 | 5,147,016.21  | 0.41 |
| 26 | 688390 | 固德威   | 14,516  | 4,848,344.00  | 0.39 |
| 27 | 002925 | 盈趣科技  | 122,910 | 4,782,428.10  | 0.38 |
| 28 | 600309 | 万华化学  | 40,900  | 4,450,738.00  | 0.36 |
| 29 | 600346 | 恒力石化  | 153,759 | 4,034,636.16  | 0.32 |
| 30 | 600029 | 南方航空  | 644,800 | 3,881,696.00  | 0.31 |
| 31 | 600019 | 宝钢股份  | 494,200 | 3,775,688.00  | 0.30 |
| 32 | 002271 | 东方雨虹  | 66,026  | 3,652,558.32  | 0.29 |
| 33 | 600176 | 中国巨石  | 205,168 | 3,182,155.68  | 0.25 |
| 34 | 688696 | 极米科技  | 1,252   | 1,041,664.00  | 0.08 |
| 35 | 300979 | 华利集团  | 9,246   | 1,028,699.40  | 0.08 |
| 36 | 688819 | 天能股份  | 19,229  | 840,115.01    | 0.07 |
| 37 | 688617 | 惠泰医疗  | 1,673   | 624,430.52    | 0.05 |
| 38 | 300896 | 爱美客   | 623     | 491,472.24    | 0.04 |
| 39 | 300957 | 贝泰妮   | 853     | 214,921.88    | 0.02 |
| 40 | 605499 | 东鹏饮料  | 632     | 158,505.60    | 0.01 |
| 41 | 688315 | 诺禾致源  | 3,711   | 145,471.20    | 0.01 |
| 42 | 688625 | 呈和科技  | 2,672   | 113,907.36    | 0.01 |
| 43 | 300919 | 中伟股份  | 610     | 99,430.00     | 0.01 |
| 44 | 688669 | 聚石化学  | 2,681   | 86,837.59     | 0.01 |
| 45 | 688499 | 利元亨   | 2,149   | 83,488.65     | 0.01 |
| 46 | 688662 | 富信科技  | 2,556   | 75,427.56     | 0.01 |
| 47 | 688359 | 三孚新科  | 2,213   | 58,312.55     | 0.00 |
| 48 | 688350 | 富淼科技  | 2,552   | 57,266.88     | 0.00 |
| 49 | 688087 | 英科再生  | 2,469   | 54,219.24     | 0.00 |
| 50 | 688195 | 腾景科技  | 2,693   | 53,509.91     | 0.00 |
| 51 | 301017 | 漱玉平民  | 5,550   | 49,173.00     | 0.00 |
| 52 | 301020 | 密封科技  | 4,210   | 44,794.40     | 0.00 |
| 53 | 300973 | 立高食品  | 360     | 41,655.60     | 0.00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 54 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 55 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 56 | 300953 | 震裕科技 | 240   | 23,964.00 | 0.00 |
| 57 | 001207 | 联科科技 | 682   | 22,581.02 | 0.00 |
| 58 | 301009 | 可靠股份 | 801   | 22,339.89 | 0.00 |
| 59 | 301015 | 百洋医药 | 462   | 17,939.46 | 0.00 |
| 60 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 61 | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 62 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 63 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 64 | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 65 | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 66 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 67 | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62 | 0.00 |
| 68 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 69 | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 70 | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 71 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 72 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 73 | 301016 | 雷尔伟  | 275   | 9,069.50  | 0.00 |
| 74 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 75 | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 76 | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 77 | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 78 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 79 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 80 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 81 | 300958 | 建工修复 | 300   | 8,166.00  | 0.00 |
| 82 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 83 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |
| 84 | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80  | 0.00 |
| 85 | 300993 | 玉马遮阳 | 410   | 7,908.90  | 0.00 |
| 86 | 300930 | 屹通新材 | 322   | 7,882.56  | 0.00 |
| 87 | 300985 | 致远新能 | 295   | 7,318.95  | 0.00 |
| 88 | 300971 | 博亚精工 | 245   | 6,931.05  | 0.00 |
| 89 | 301004 | 嘉益股份 | 312   | 6,845.28  | 0.00 |
| 90 | 300991 | 创益通  | 254   | 6,733.54  | 0.00 |
| 91 | 300927 | 江天化学 | 217   | 6,531.70  | 0.00 |
| 92 | 300975 | 商络电子 | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 93 | 300963 | 中洲特材 | 283   | 6,364.67  | 0.00 |
| 94 | 301011 | 华立科技 | 175   | 5,922.00  | 0.00 |
| 95 | 300943 | 春晖智控 | 255   | 5,867.55  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 96  | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 97  | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 98  | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 99  | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 100 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 101 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 102 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 103 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 104 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 105 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 106 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |
| 107 | 300917 | 特发服务 | 84  | 2,323.44 | 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  | 600887 | 伊利股份 | 13,833,480.56 | 1.08           |
| 2  | 002475 | 立讯精密 | 12,773,672.70 | 0.99           |
| 3  | 601233 | 桐昆股份 | 6,905,599.00  | 0.54           |
| 4  | 002444 | 巨星科技 | 6,861,442.52  | 0.53           |
| 5  | 002311 | 海大集团 | 6,541,023.00  | 0.51           |
| 6  | 601012 | 隆基股份 | 6,517,400.00  | 0.51           |
| 7  | 600030 | 中信证券 | 6,453,071.00  | 0.50           |
| 8  | 688390 | 固德威  | 4,072,178.53  | 0.32           |
| 9  | 600029 | 南方航空 | 4,026,368.00  | 0.31           |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 4,019,571.00  | 0.31           |
| 11 | 600019 | 宝钢股份 | 3,910,768.00  | 0.30           |
| 12 | 002459 | 晶澳科技 | 3,871,187.00  | 0.30           |
| 13 | 300750 | 宁德时代 | 3,770,023.00  | 0.29           |
| 14 | 600905 | 三峡能源 | 3,436,527.95  | 0.27           |
| 15 | 300122 | 智飞生物 | 1,283,944.00  | 0.10           |
| 16 | 688819 | 天能股份 | 803,579.91    | 0.06           |
| 17 | 300957 | 贝泰妮  | 403,393.59    | 0.03           |
| 18 | 688425 | 铁建重工 | 388,259.34    | 0.03           |
| 19 | 300979 | 华利集团 | 307,152.12    | 0.02           |
| 20 | 688083 | 中望软件 | 276,468.50    | 0.02           |

注：“本期累计买入金额”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  | 300450 | 先导智能  | 9,750,044.44 | 0.76           |
| 2  | 000725 | 京东方 A | 7,455,240.00 | 0.58           |
| 3  | 600690 | 海尔智家  | 7,179,656.88 | 0.56           |
| 4  | 601166 | 兴业银行  | 5,547,725.23 | 0.43           |
| 5  | 300750 | 宁德时代  | 5,257,636.00 | 0.41           |
| 6  | 601318 | 中国平安  | 5,159,997.28 | 0.40           |
| 7  | 000333 | 美的集团  | 5,147,229.00 | 0.40           |
| 8  | 600426 | 华鲁恒升  | 5,144,050.50 | 0.40           |
| 9  | 002271 | 东方雨虹  | 4,642,559.00 | 0.36           |
| 10 | 300271 | 华宇软件  | 4,552,594.27 | 0.35           |
| 11 | 000002 | 万科 A  | 4,551,652.00 | 0.35           |
| 12 | 600926 | 杭州银行  | 4,253,395.00 | 0.33           |
| 13 | 300315 | 掌趣科技  | 2,665,008.00 | 0.21           |
| 14 | 300122 | 智飞生物  | 2,563,646.00 | 0.20           |
| 15 | 600031 | 三一重工  | 2,563,599.00 | 0.20           |
| 16 | 600346 | 恒力石化  | 2,547,483.00 | 0.20           |
| 17 | 300633 | 开立医疗  | 2,367,922.00 | 0.18           |
| 18 | 000997 | 新大陆   | 2,216,868.00 | 0.17           |
| 19 | 600905 | 三峡能源  | 1,690,721.25 | 0.13           |
| 20 | 300957 | 贝泰妮   | 1,355,324.49 | 0.11           |

注：“本期累计卖出金额”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 | 96,552,181.73  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 110,781,645.73 |

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

#### 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      | 66,635,270.00  | 5.33         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 478,260,390.00 | 38.28        |
|    | 其中：政策性金融债 | 31,736,390.00  | 2.54         |
| 4  | 企业债券      | 245,427,500.00 | 19.65        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 6  | 中期票据      | -                | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | 130,295,191.22   | 10.43 |
| 8  | 同业存单      | 97,125,000.00    | 7.77  |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 1,017,743,351.22 | 81.47 |

### 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  | 136827    | 16 国网 02      | 500,000 | 50,070,000.00 | 4.01         |
| 1  | 163829    | 20 光证 S1      | 500,000 | 50,070,000.00 | 4.01         |
| 2  | 112110162 | 21 兴业银行 CD162 | 500,000 | 48,570,000.00 | 3.89         |
| 3  | 112103027 | 21 农业银行 CD027 | 500,000 | 48,555,000.00 | 3.89         |
| 4  | 175038    | 20 中证 18      | 400,000 | 40,248,000.00 | 3.22         |
| 5  | 175053    | 20 平证 06      | 400,000 | 40,040,000.00 | 3.21         |

### 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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金对国债期货的投资以套期保值，回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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

本基金持有的兴业银行（代码：601166）、21 兴业银行 CD162（代码：112110162 IB）的发行主体兴业银行股份有限公司因同业投资用途不合规等七项违法违规行为，于 2020 年 8 月 31 日被中国银保监会福建监管局没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元；因资金营运中心 2017 年 7 月至 2019 年 6 月间黄金租赁业务严重违反审慎经营规则于 2020 年 8 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款人民币 50 万元；因为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定等五项违法违规行为于 2020 年 9 月 4 日受到中国人民银行福州中心支行的警告处分，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处罚款 13,824,431.23 元。

本基金持有的宁波银行（代码：002142）的发行主体宁波银行股份有限公司因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位于 2020 年 10 月 16 日被宁波银保监局处以罚款人民币 30 万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分；因代理销售保险不规范于 2021 年 6 月 10 日被宁波银保监局处以罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

本基金持有的浦发转债（代码：110059 SH）的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司因 2016 年 5 月至 2019 年 1 月未按规定开展代销业务，于 2021 年 4 月 23 日被上海银保监局责令改正，并处罚款共计 760 万元。

本基金持有的 21 农业银行 CD027（代码：112103027 IB）发行主体中国农业银行股份有限公司因收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住

房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费），于 2020 年 12 月 7 日被银保监会处没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元。

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

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

### 7.12.2 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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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   | 54,183.93     |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,637,819.90  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 12,642,826.45 |
| 5  | 应收申购款   | 348,570.69    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 14,683,400.97 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------------|---------------|
| 1  | 110059 | 浦发转债     | 30,729,000.00 | 2.46          |
| 2  | 128129 | 青农转债     | 19,234,479.42 | 1.54          |
| 3  | 132015 | 18 中油 EB | 13,292,500.00 | 1.06          |
| 4  | 113037 | 紫银转债     | 8,254,631.70  | 0.66          |
| 5  | 132007 | 16 凤凰 EB | 4,768,338.00  | 0.38          |
| 6  | 128130 | 景兴转债     | 4,523,600.00  | 0.36          |
| 7  | 127020 | 中金转债     | 4,388,000.00  | 0.35          |
| 8  | 110073 | 国投转债     | 4,308,400.00  | 0.34          |
| 9  | 110047 | 山鹰转债     | 4,083,450.00  | 0.33          |
| 10 | 113024 | 核建转债     | 3,074,100.00  | 0.25          |
| 11 | 132011 | 17 浙报 EB | 2,814,000.00  | 0.23          |



|    |        |          |              |      |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 12 | 113033 | 利群转债     | 2,004,000.00 | 0.16 |
| 13 | 132017 | 19 新钢 EB | 1,745,566.00 | 0.14 |
| 14 | 128120 | 联诚转债     | 1,048,800.00 | 0.08 |
| 15 | 132022 | 20 广版 EB | 120,324.00   | 0.01 |
| 16 | 127027 | 靖远转债     | 1,000.40     | 0.00 |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中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，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。

## § 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（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（%） |
| 东方红价值精选混合 A | 2,427    | 283,692.84 | 511,072,863.11 | 74.23     | 177,449,652.72 | 25.77     |
| 东方红价值精选混合   | 1,194    | 135,029.80 | 104,084,286.17 | 64.56     | 57,141,290.95  | 35.44     |

|    |       |            |                |       |                |       |
|----|-------|------------|----------------|-------|----------------|-------|
| C  |       |            |                |       |                |       |
| 合计 | 3,621 | 234,672.22 | 615,157,149.28 | 72.39 | 234,590,943.67 | 27.61 |

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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（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 | 东方红价值精选混合 A | 768,067.65 | 0.11        |
|                  | 东方红价值精选混合 C | 49,438.51  | 0.03        |
|                  | 合计          | 817,506.16 | 0.10        |

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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 | 东方红价值精选混合 A | 0                 |
|                                | 东方红价值精选混合 C | 0                 |
|                                | 合计          | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 东方红价值精选混合 A | 0                 |
|                                | 东方红价值精选混合 C | 0                 |
|                                | 合计          | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                | 东方红价值精选混合 A      | 东方红价值精选混合 C    |
|-----------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>(2016年9月23日)<br>基金份额总额 | 1,243,245,744.36 | 246,897,646.93 |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 718,423,275.72   | 183,241,184.29 |

|                          |                |                |
|--------------------------|----------------|----------------|
| 本报告期基金总申购份额              | 91,502,342.99  | 73,212,313.67  |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 121,403,102.88 | 95,227,920.84  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额             | 688,522,515.83 | 161,225,577.12 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

### 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

自 2021 年 3 月 12 日起，饶刚不再担任本基金管理人副总经理职务。

本报告期内本基金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

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

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内本基金未发生改聘会计师事务所的情形。

### 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

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 |    |
|      |        |      |              |           |            |    |

|      |   |                |        |           |        |   |
|------|---|----------------|--------|-----------|--------|---|
| 东方证券 | 5 | 112,074,130.34 | 57.29% | 77,884.20 | 56.72% | - |
| 国金证券 | 2 | 60,427,244.34  | 30.89% | 42,982.41 | 31.30% | - |
| 申万宏源 | 1 | 17,381,864.12  | 8.89%  | 12,363.71 | 9.00%  | - |
| 广发证券 | 4 | 5,738,135.24   | 2.93%  | 4,081.50  | 2.97%  | - |
| 安信证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 长江证券 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 川财证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 东吴证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 方正证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 高华证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 光大证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 国盛证券 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 国泰君安 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 国信证券 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 海通证券 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 宏信证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 华创证券 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 华金证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 华泰证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 华菁证券 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 汇丰前海 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 开源证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 民生证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 天风证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 西部证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 西南证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 兴业证券 | 2 | -              | -      | -         | -      | - |
| 银河证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |
| 招商证券 | 1 | -              | -      | -         | -      | - |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 中金公司       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证<br>券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）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

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本报告期内本基金租用交易单元的变更情况：新增兴业证券 1 个、开源证券 1 个、国金证券 1 个、国信证券 1 个交易单元。

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 |              |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 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 |
| 东方证券 | 100,869,508.68 | 75.53%       | 4,869,000,000.00 | 99.21%         | -    | -            |
| 国金证券 | 32,685,332.47  | 24.47%       | 39,000,000.00    | 0.79%          | -    | -            |
| 申万宏源 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 川财证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 方正证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 高华证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 光大证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券       | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安       | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券       | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华菁证券       | - | - | - | - | - | - |
| 汇丰前海       | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券       | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券       | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券       | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券       | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券       | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券       | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券       | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | - | - | - | - | - | - |

### 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  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构并开通定投业务的公告 | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 1 月 5 日  |
| 2  | 上海东方证券资产管理有限公司关于住所变更的公告                | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 1 月 8 日  |
| 3  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金在直销平台开展费率优惠活动的公告   | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 1 月 11 日 |
| 4  | 东方红价值精选混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告        | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 1 月 22 日 |
| 5  | 东方红价值精选混合型证券投资基金                       | 证券日报、中国证监会              | 2021 年 2 月 9 日  |

|    |   |                         |                 |
|----|---|-------------------------|-----------------|
|    | (A/C 类份额)基金产品资料概要更新   | 基金电子披露网站、公司官网           |                 |
| 6  | 东方红价值精选混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2021 年第 1 号)                        | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 2 月 9 日  |
| 7  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告         | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 2 月 22 日 |
| 8  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为代理销售机构并开通部分基金定期定额投资业务的公告 | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 3 月 1 日  |
| 9  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在直销平台开通转换业务并开展费率优惠活动的公告                 | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 3 月 2 日  |
| 10 | 上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                                   | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 3 月 13 日 |
| 11 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在招商银行股份有限公司降低定期定额投资业务起点金额的公告            | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 3 月 29 日 |
| 12 | 东方红价值精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告                                   | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 3 月 31 日 |
| 13 | 东方红价值精选混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告                               | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 14 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代理销售机构的公告                | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 6 月 17 日 |
| 15 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加交通银行股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告           | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 6 月 18 日 |
| 16 | 关于上海东方证券资产管理有限公司直销中心变更汇款账户的公告                                 | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 6 月 22 日 |
| 17 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告           | 证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网 | 2021 年 6 月 30 日 |

注：上述公告中，基金合同、招募说明书、基金产品资料概要(更新)、定期报告、上市交易公告

书仅在规定网站披露，规定报刊仅披露相关提示性公告。

## § 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

注：本基金本报告期内无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、中国证监会批准设立东方红价值精选混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红价值精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红价值精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红价值精选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。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

### 12.3 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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 8 月 31 日