

东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金

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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	13
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
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	48
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	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57

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	57
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	57
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	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金	
基金简称	东方红中证竞争力指数	
基金主代码	007657	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 7 月 31 日	
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 额总额	693,645,701.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	东方红中证竞争力指数 A	东方红中证竞争力指数 C
下属分级基金的交 易代码	007657	007658
报告期末下属分级 基金的份额总额	596,758,568.11 份	96,887,133.56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票投资组合。同时为实现对标的指数更好地跟踪，本基金将辅以适当的替代性策略调整组合。本基金力争基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证东方红竞争力指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金是指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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 姓名	李云亮	张燕

负责人	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	证券时报
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)	
	东方红中证竞争力指数 A	东方红中证竞争力指数 C
本期已实现收益	123,751,217.24	19,927,819.81
本期利润	34,388,574.97	5,760,473.64
加权平均基金份额本期利润	0.0526	0.0535
本期加权平均净值利润率	3.50%	3.59%
本期基金份额净值增长率	2.88%	2.68%
3.1.2 期末数据	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	

和指标		
期末可供分配利润	306,922,174.89	48,653,191.92
期末可供分配基金份额利润	0.5143	0.5022
期末基金资产净值	903,680,743.00	145,540,325.48
期末基金份额净值	1.5143	1.5022
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	51.43%	50.22%

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

东方红中证竞争力指数 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	-0.93%	0.84%	-1.66%	0.84%	0.73%	0.00%
过去三个月	5.16%	0.95%	4.11%	0.96%	1.05%	-0.01%
过去六个月	2.88%	1.28%	1.76%	1.28%	1.12%	0.00%
过去一年	30.15%	1.28%	27.39%	1.28%	2.76%	0.00%

自基金合同生效起 至今	51.43%	1.24%	43.64%	1.26%	7.79%	-0.02%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

东方红中证竞争力指数 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	-0.96%	0.84%	-1.66%	0.84%	0.70%	0.00%
过去三个月	5.06%	0.95%	4.11%	0.96%	0.95%	-0.01%
过去六个月	2.68%	1.28%	1.76%	1.28%	0.92%	0.00%
过去一年	29.63%	1.28%	27.39%	1.28%	2.24%	0.00%
自基金合同生效起 至今	50.22%	1.24%	43.64%	1.26%	6.58%	-0.02%

注：本基金的业绩比较基准=中证东方红竞争力指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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_t）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 95\% \times [\text{t 日中证东方红竞争力指数} / (\text{t-1 日中证东方红竞争力指数}) - 1] + 5\% \times (\text{t 日人民币活期存款利率 (税后)} / 365);$$

其中，t=1, 2, 3, ... T, T 表示时间截至日；

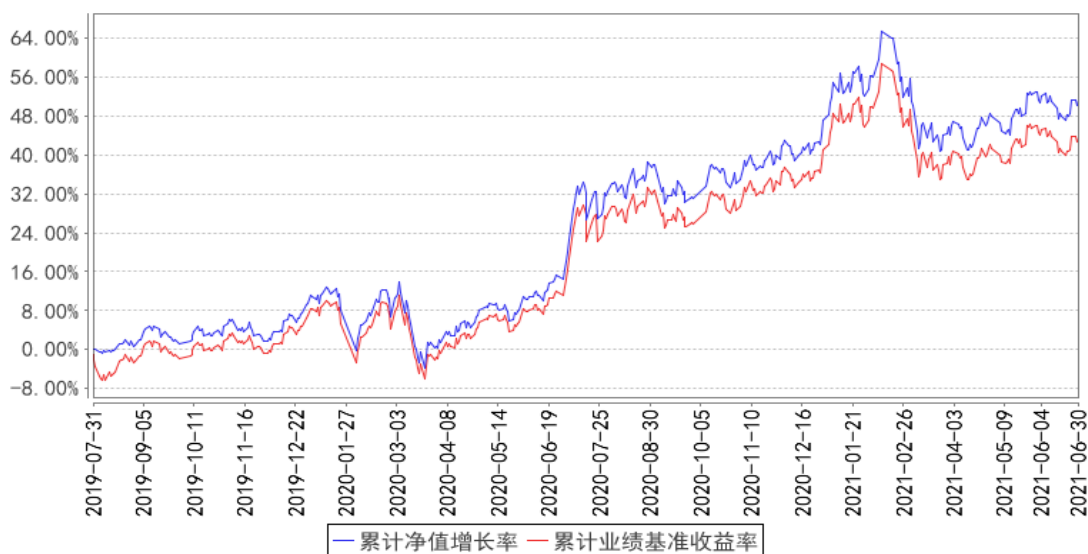
t 日至 T 日的期间收益率（benchmark_{Tt}）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_{Tt} = [\prod_{t=T}^t (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

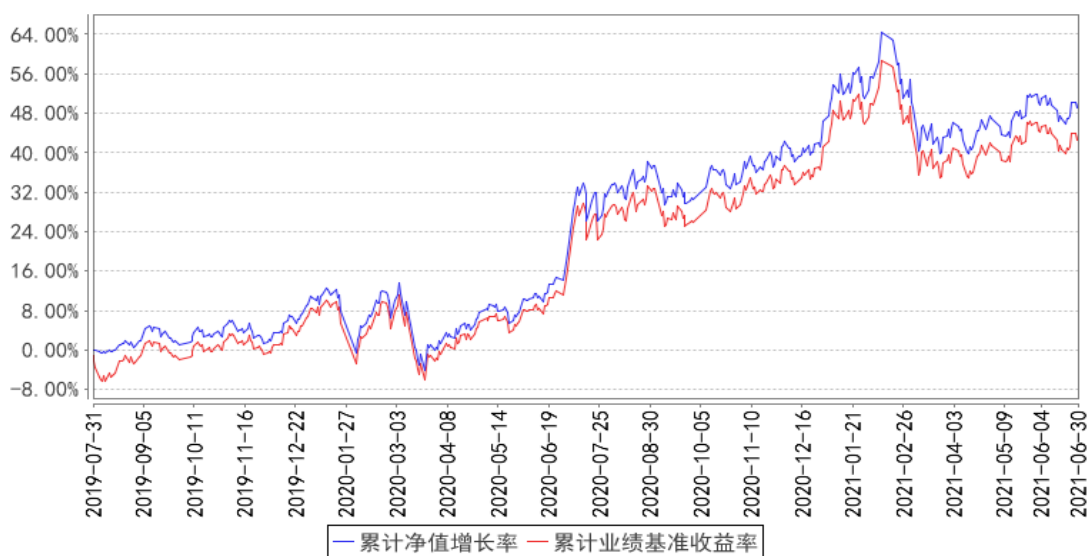
其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=T}^t (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 (1+benchmark_t) 数学连乘

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

东方红中证竞争力指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红中证竞争力指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
徐 习 佳	上海东方证券资产管理有限公司公募指数与多策略部副总经理（主持工作）、基金经理	2019 年 7 月 31 日	-	20 年	上海东方证券资产管理有限公司公募指数与多策略部副总经理（主持工作）、基金经理，2019 年 07 月至今任东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金经理。天普大学金融学博士。曾任联合证券投资银行部投行经理，美国 Towers Watson 资深分析师，兴业全球基金金融工程与专题研究部副总监、基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司研究部副总监、量化投资部总经理、投资主办人。具备证券投资基金从业资格。
戎 逸 洲	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2019 年 11 月 29 日	-	6 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2019 年 11 月至今任东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金经理。福特汉姆大学理学硕士。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化研究员。具备证券投资基金从业资格。

注：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合规守信情况的说明

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

4.3 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

报告期内，今年一季度就地过年抑制了总体经济活跃度，二季度国内宏观经济平稳修复，多项经济指标逐步回归正常区间，国内实际经济增长向好。从对国内经济影响看，虽然疫情发展至今已近 18 个月，但仍未平息，时有反复，依然成为影响中国经济的重要因素。一方面，海外疫情反复导致中国出口业务景气度高，对国内 GDP 形成正面影响；另一方面，疫情的长期存在压制了国内消费，对经济增长形成负面影响。两者交织作用下，A 股市场在经历一季度的两次下跌探底后，二季度在医药和转型升级方面形成共识，走出结构性行情。我们注意到这次结构性行情不是简单的此消彼长、资金搬家，市场中相当多公司均出现温和上涨。以东方红中证竞争力指数基金投资的一篮子高 ROE 公司为例，在 2020 年上半年净值上涨 2.88%，涨幅大于同期沪深 300 的 0.24%。

根据 2021 年 7 月 2 日东方红资管提供的指数估值信息，东方红竞争力指数成分股加权 ROE 为 15.61%，显著高于沪深 300 约 11.87%，创业板指数约 14.93%的水平。以实际权重计算的 PE 水平约为 18 倍，与沪深 300 约 18.2 倍的水平接近，显著低于中证 500 和创业板指约 21.5 和 60.5 的数值（Wind 总市值法）。国际上横向比较 ROE 和 PE 水平，竞争力指数相较德国 DAX（5.52%和 33 倍）和日经 225（9.78%和 20.2 倍）在这两方面继续保持明显优势。而标普 500 的 ROE 水平（约

13.97%) 也继续低于竞争力指数, 而其 PE 估值水平目前约 33.1 倍。

我们密切跟踪的竞争力指数成分股组合在持有期盈利能力上相对于沪深 300 组合的优势目前处在 3%~4% 区间的上沿。结合上面对于竞争力指数在 ROE 和 PE 上的国内外比较, 竞争力指数基金在经历最近的市场调整后仍然是指数投资的优选对象。目前看, 竞争力指数包含的高质量公司在 2021 年剩下时间内的盈利状况更有保障, 而其估值水平作为一个市值较大、行业板块配置均衡的股票组合相对较低, 绝对数量级上也具有相当吸引力。

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 1.5143 元, 份额累计净值为 1.5143 元; C 类份额净值为 1.5022 元, 份额累计净值为 1.5022 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 2.88%, 同期业绩比较基准为 1.76%; C 类份额净值增长率为 2.68%, 同期业绩比较基准为 1.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着疫情防控形势的全面改善, 居民消费稳步恢复, 但居民收入显示 K 型修复特征 (2020 年一季度以来, 全国居民人均可支配收入累计名义同比持续高于中位数的累计同比), 居民整体消费意愿偏弱 (央行城镇储户问卷调查中“更多消费占比”的比例在 2020 年三季度之后连续两个季度下降, 降至 2016 年三季度以来的次低水平, 仅高于 2020 年一季度疫情爆发期的低位水平)。

展望 2021 年下半年, 短期内外需不弱, 叠加国内消费与制造业等经济内生动力的增长, 逆周期诉求弱化, 经济具有韧性。但通胀仍然是今年宏观经济面临的主要风险之一。同时鉴于目前居民收入 K 型修复和整体消费意愿偏弱的特征, 对消费复苏的期望不宜过于乐观。出口产业链景气度可能在今年出现中短期内的峰值, 出口可能边际放缓, 进一步影响相关就业人口的消费能力与消费意愿。部分中小企业经营困难, 就业问题不容乐观。

二季度市场风格不断调整选择, 热点在医药、新能源、军工、科技等板块中反复轮动。我们注意到成长类风格因子表现先降后升, 红利类因子和估值因子则出现一定调整, 质量因子表现相对稳健, 总体看与今年以来我们对于大类风格再平衡的判断基本符合。结合宏观经济稳中存变, 央行降准, 楼市政策升级, 我们预计头部企业盈利的稳定性会进一步加强, 而增速则会有所下降。在货币政策相对宽松的环境下, 下半年市场的热点可能更容易汇聚到存在细分行业机会的龙头企业之上。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	64,052,404.02	78,097,387.36
结算备付金		7,300,285.32	9,912,589.92
存出保证金		1,752,060.76	3,274,176.54
交易性金融资产	6.4.7.2	981,061,986.79	1,247,240,564.65
其中：股票投资		977,992,986.79	1,245,445,237.55
基金投资		-	-
债券投资		3,069,000.00	1,795,327.10
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	-	-
应收证券清算款		1,760,501.49	6,144,717.38
应收利息	6.4.7.5	9,123.85	12,193.86
应收股利		-	-
应收申购款		322,530.20	858,957.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,056,258,892.43	1,345,540,586.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,515,880.19	11,145,557.53
应付管理人报酬		436,394.49	557,862.09
应付托管费		43,639.42	55,786.20

应付销售服务费		48,519.38	62,045.18
应付交易费用	6.4.7.7	781,985.10	962,884.78
应交税费		0.09	59,818.97
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	211,405.28	225,240.19
负债合计		7,037,823.95	13,069,194.94
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	693,645,701.67	906,045,568.80
未分配利润	6.4.7.10	355,575,366.81	426,425,823.12
所有者权益合计		1,049,221,068.48	1,332,471,391.92
负债和所有者权益总计		1,056,258,892.43	1,345,540,586.86

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 693,645,701.67 份，其中东方红中证竞争力指数 A 基金份额总额 596,758,568.11 份，基金份额净值 1.5143 人民币。东方红中证竞争力指数 C 基金份额总额 96,887,133.56 份，基金份额净值 1.5022 人民币；

6.2 利润表

会计主体：东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金

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 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		45,650,569.15	76,393,680.46
1. 利息收入		150,631.94	1,757,087.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	150,118.93	168,851.55
债券利息收入		513.01	1,588,235.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		148,919,024.62	174,633,407.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	139,359,975.75	149,477,324.86
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	859,036.30	-64,405.06
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	647,044.66	802,368.93
股利收益	6.4.7.16	8,052,967.91	24,418,118.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-103,529,988.44	-101,912,512.10
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	110,901.03	1,915,697.92
减：二、费用		5,501,520.54	12,740,764.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,844,896.22	5,769,529.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	284,489.57	576,952.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	320,237.73	613,651.81
4. 交易费用	6.4.7.19	1,911,463.59	5,617,437.21
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,330.45	2,888.53
7. 其他费用	6.4.7.20	138,102.98	160,304.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,149,048.61	63,652,915.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,149,048.61	63,652,915.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金

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 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）	906,045,568.80	426,425,823.12	1,332,471,391.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,149,048.61	40,149,048.61
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）	-212,399,867.13	-110,999,504.92	-323,399,372.05
其中：1. 基金申	66,879,102.27	34,014,395.06	100,893,497.33

购款			
2. 基金赎回款	-279,278,969.40	-145,013,899.98	-424,292,869.38
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）	693,645,701.67	355,575,366.81	1,049,221,068.48
项目	上年度可比期间 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）	3,150,312,526.67	296,578,449.48	3,446,890,976.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	63,652,915.70	63,652,915.70
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）	-1,723,789,288.61	-127,865,935.67	-1,851,655,224.28
其中：1. 基金申购款	331,896,102.76	24,545,097.66	356,441,200.42
2. 基金赎回款	-2,055,685,391.37	-152,411,033.33	-2,208,096,424.70
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）	1,426,523,238.06	232,365,429.51	1,658,888,667.57

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

东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）证监许可[2019]1191 号《关于准予东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金注册的批复》核准，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《东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,408,726,357.08 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(2019)第 0435 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 7 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,410,025,078.29 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,298,721.21 份基金份额。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。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,005,850.58 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式不同，将基金份额分为不同的类别。A 类基金份额：在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；C 类基金份额：不收取认购费、申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数的成份股及备选成份股。为更好实现投资目标，本基金可以少量投资于非成份股及存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债券、政府支持债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债、央行票据、中期票据、证券公司发行的短期债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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。基金的投资组合比例为：本

基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证东方红竞争力指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

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》、《东方红中证竞争力指数发起式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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	64,052,404.02
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	64,052,404.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	832,595,867.48	977,992,986.79	145,397,119.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,069,000.00	-
	银行间市场	-	-
	合计	3,069,000.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	835,664,867.48	981,061,986.79	145,397,119.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,863,380.00	-	-	-
其中：股指期货投资	11,863,380.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,863,380.00	-	-	-

注：注：衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。本报告期末，本基金持有的股指期货具体持仓和损益明细可参考本报告 7.10.1 章节。

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	6,226.41
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	2,611.89
应收债券利息	214.09
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	7.46
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	64.00
合计	9,123.85

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	781,985.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	781,985.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,309.34
应付证券出借违约金	-
预提费用	209,095.94
合计	211,405.28

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东方红中证竞争力指数 A

项目	本期 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	777,831,918.68	777,831,918.68
本期申购	55,010,675.98	55,010,675.98
本期赎回（以“-”号填列）	-236,084,026.55	-236,084,026.55
-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	596,758,568.11	596,758,568.11

东方红中证竞争力指数 C

项目	本期 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	128,213,650.12	128,213,650.12
本期申购	11,868,426.29	11,868,426.29
本期赎回（以“-”号填列）	-43,194,942.85	-43,194,942.85
-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	96,887,133.56	96,887,133.56

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东方红中证竞争力指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	283,419,985.66	83,642,680.06	367,062,665.72
本期利润	123,751,217.24	-89,362,642.27	34,388,574.97
本期基金份额交易产生的变动数	-76,322,149.48	-18,206,916.32	-94,529,065.80
其中：基金申购款	24,181,329.56	3,852,900.54	28,034,230.10
基金赎回款	-100,503,479.04	-22,059,816.86	-122,563,295.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	330,849,053.42	-23,926,878.53	306,922,174.89

东方红中证竞争力指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	45,617,335.44	13,745,821.96	59,363,157.40
本期利润	19,927,819.81	-14,167,346.17	5,760,473.64
本期基金份额交易产生的变动数	-13,080,422.93	-3,390,016.19	-16,470,439.12
其中：基金申购款	4,985,660.49	994,504.47	5,980,164.96
基金赎回款	-18,066,083.42	-4,384,520.66	-22,450,604.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,464,732.32	-3,811,540.40	48,653,191.92

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	124,165.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	24,615.75
其他	1,338.15
合计	150,118.93

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 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	139,359,975.75
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	139,359,975.75

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	822,995,861.26
减：卖出股票成本总额	683,635,885.51
买卖股票差价收入	139,359,975.75

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 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	859,036.30
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	859,036.30

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
----	----

	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	3,000,119.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,140,400.00
减：应收利息总额	683.50
买卖债券差价收入	859,036.30

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	647,044.66

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,052,967.91
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	8,052,967.91

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-102,832,308.44
股票投资	-102,328,981.34
债券投资	-503,327.10
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-697,680.00
权证投资	-
期货投资	-697,680.00
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	-103,529,988.44

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	110,832.01
基金转换费收入	69.02
合计	110,901.03

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,911,463.59
银行间市场交易费用	-
合计	1,911,463.59

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	10,407.04
账户维护费	18,600.00
合计	138,102.98

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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、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、基金销售机构

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	188,416,840.65	5.19

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
东方证券	914,400.00	13.22	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东方证券	137,789.39	5.32	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,844,896.22	5,769,529.42
其中：支付销售机构的客户维护费	917,265.39	1,887,067.77

注：注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	284,489.57	576,952.97

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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。

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 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		
	东方红中证竞争力指数 A	东方红中证竞争力指数 C	合计

东证资管	-	26,878.48	26,878.48
东方证券	-	161,209.95	161,209.95
东证期货	-	1.81	1.81
招商银行	-	49,483.54	49,483.54
合计	-	237,573.78	237,573.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	东方红中证竞争力指数 A	东方红中证竞争力指数 C	合计
东方证券	-	371,464.61	371,464.61
东证期货	-	1.82	1.82
东证资管	-	26,817.17	26,817.17
招商银行	-	77,684.74	77,684.74
合计	-	475,968.34	475,968.34

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 的年费率计提，计算方式如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	东方红中证竞争力指数 A	东方红中证竞争力指数 C
基金合同生效日（2019 年 7 月 31 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	19,777,178.64	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	19,777,178.64	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.3141%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	东方红中证竞争力指数 A	东方红中证竞争力指数 C
基金合同生效日（2019 年 7 月 31 日）持有的基金份额	10,005,850.58	-
报告期初持有的基金份额	10,005,850.58	-
报告期内申购/买入总份额	9,771,328.06	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	19,777,178.64	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.6004%	-

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 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	64,052,404.02	124,165.03	88,118,163.51	129,622.49

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

本基金支付给东证期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2021 年 6 月 30 日，本基金无应付交易手续费余额(2020 年 12 月 31 日：同)。于 2021 年上半年，本基金当期交易手续费支出 2,301.34 元(2020 年同期：2,039.62 元)。

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 2,636,152.88 元，存出保证金余额为 1,609,873.20 元。(2020 年 12 月 31 日：结算备付金 5,212,967.47 元，存出保证金 3,048,786.00 元)。于 2021 年上半年，本基金当期结算备付金利息收入 17,272.35 元(2020 年同期：17,325.68 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	2020	2021	新股锁	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-

	股份	年 12 月 15 日	年 7 月 2 日	定						
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 7 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	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	47.33	251.96	237	11,217.21	59,714.52	-
300958	建工	2021	2021	新股锁	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

	修复	年 3 月 18 日	年 9 月 29 日	定							
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	276	1,896.12	3,331.32	-	
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	219	6,193.32	25,340.49	-	
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	2021 年 10	新股锁 定	33.22	87.50	370	12,291.40	32,375.00	-	

		15 日	月 26 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	2021 年 12	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-

		18 日	月 27 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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	富信科技	2021年3月25日	2021年10月8日	新股锁定	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688669	聚石化学	2021年1月15日	2021年7月26日	新股锁定	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-
688819	天能股份	2021年1月7日	2021年7月19日	新股锁定	41.79	43.69	7,450	311,335.50	325,490.50	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	30,030	3,003,000.00	3,003,000.00	-
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	新债未上市	100.00	100.00	660	66,000.00	66,000.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监

高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

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

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

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

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市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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股份有限公司，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

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

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无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

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	1,795,327.10
未评级	-	-
合计	-	1,795,327.10

注：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无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无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 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30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	64,052,404.02	-	-	-	-	-	64,052,404.02
结算备付金	7,300,285.32	-	-	-	-	-	7,300,285.32
存出保证金	1,752,060.76	-	-	-	-	-	1,752,060.76
交易性金融资产	-	-	-	-	3,069,000.00	977,992,986.79	981,061,986.79
应收利息	-	-	-	-	-	9,123.85	9,123.85
应收申购款	14,732.67	-	-	-	-	307,797.53	322,530.20
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,760,501.49	1,760,501.49
资产总计	73,119,482.77	-	-	-	3,069,000.00	980,070,409.66	1,056,258,892.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,515,880.19	5,515,880.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	436,394.49	436,394.49
应付托管费	-	-	-	-	-	43,639.42	43,639.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	48,519.38	48,519.38

应付交易费用	-	-	-	-	-	781,985.10	781,985.10
应交税费	-	-	-	-	-	0.09	0.09
其他负债	-	-	-	-	-	211,405.28	211,405.28
负债总计	-	-	-	-	-	7,037,823.95	7,037,823.95
利率敏感度缺口	73,119,482.77	-	-	-	3,069,000.00	973,032,585.71	1,049,221,068.48
上年度末 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	78,097,387.36	-	-	-	-	-	78,097,387.36
结算备付金	9,912,589.92	-	-	-	-	-	9,912,589.92
存出保证金	225,390.54	-	-	-	-	3,048,786.00	3,274,176.54
交易性金融资产	-	-	-	-	1,795,327.10	1,245,445,237.55	1,247,240,564.65
应收利息	-	-	-	-	-	12,193.86	12,193.86
应收申购款	97,736.70	-	-	-	-	761,220.45	858,957.15
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,144,717.38	6,144,717.38
资产总计	88,333,104.52	-	-	-	1,795,327.10	1,255,412,155.24	1,345,540,586.86
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,145,557.53	11,145,557.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	557,862.09	557,862.09
应付托管费	-	-	-	-	-	55,786.20	55,786.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	62,045.18	62,045.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	962,884.78	962,884.78
应交税费	-	-	-	-	-	59,818.97	59,818.97
其他负债	-	-	-	-	-	225,240.19	225,240.19
负债总计	-	-	-	-	-	13,069,194.94	13,069,194.94
利率敏感度缺口	88,333,104.52	-	-	-	1,795,327.10	1,242,342,155.24	1,332,471,155.24

口	52			.10	,960.30	391.92
---	----	--	--	-----	---------	--------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 个基点	43,711.27	24,980.68
	2. 市场利率上升 25 个基点	-42,990.14	-24,576.71

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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其他价格风险管理。

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 2021年6月30日		上年度末 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	977,992,986.79	93.21	1,245,445,237.55	93.47

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	977,992,986.79	93.21	1,245,445,237.55	93.47

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%	49,335,757.02	63,947,737.18
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-49,335,757.02	-63,947,737.18

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他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 978,818,867.29 元，属于第二层次的余额为 2,243,119.50 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 1,245,026,575.36 元，第二层次 2,213,989.29 元，无第三层次)。

(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	977,992,986.79	92.59
	其中：股票	977,992,986.79	92.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,069,000.00	0.29
	其中：债券	3,069,000.00	0.29
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	71,352,689.34	6.76
8	其他各项资产	3,844,216.30	0.36
9	合计	1,056,258,892.43	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 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	22,555,641.60	2.15
C	制造业	551,914,265.60	52.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,841,454.12	1.32
E	建筑业	11,610,897.00	1.11
F	批发和零售业	2,495,205.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	26,001,913.00	2.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,252,807.56	2.31
J	金融业	231,399,702.72	22.05
K	房地产业	22,702,640.00	2.16
L	租赁和商务服务业	19,250,578.00	1.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,903,727.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,201,414.00	0.78
Q	卫生和社会工作	34,721,661.37	3.31
R	文化、体育和娱乐业	3,622,080.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	975,473,986.97	92.97

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00

B	采矿业	-	-
C	制造业	2,014,310.52	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	279,580.90	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,247.24	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	145,471.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	35,742.75	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	2,518,999.82	0.24

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	21,506	44,231,390.20	4.22
2	600809	山西汾酒	81,413	36,473,024.00	3.48
3	002142	宁波银行	741,154	28,882,771.38	2.75
4	600036	招商银行	488,700	26,482,653.00	2.52
5	601166	兴业银行	1,169,000	24,022,950.00	2.29
6	601336	新华保险	486,613	22,340,402.83	2.13
7	002475	立讯精密	466,774	21,471,604.00	2.05
8	601318	中国平安	331,500	21,308,820.00	2.03
9	600779	水井坊	168,500	21,289,975.00	2.03

10	600132	重庆啤酒	106,704	21,122,056.80	2.01
11	603501	韦尔股份	63,400	20,414,800.00	1.95
12	000651	格力电器	385,468	20,082,882.80	1.91
13	002415	海康威视	292,499	18,866,185.50	1.80
14	601888	中国中免	53,900	16,175,390.00	1.54
15	300015	爱尔眼科	226,447	16,073,208.06	1.53
16	002311	海大集团	190,817	15,570,667.20	1.48
17	300122	智飞生物	74,400	13,892,712.00	1.32
18	603712	七一二	367,500	13,266,750.00	1.26
19	601838	成都银行	1,037,200	13,110,208.00	1.25
20	600436	片仔癀	28,900	12,955,870.00	1.23
21	600763	通策医疗	31,300	12,864,300.00	1.23
22	601939	建设银行	1,927,900	12,820,535.00	1.22
23	601919	中远海控	407,300	12,438,942.00	1.19
24	601009	南京银行	1,169,702	12,305,265.04	1.17
25	600985	淮北矿业	974,000	11,892,540.00	1.13
26	300059	东方财富	324,140	10,628,550.60	1.01
27	601012	隆基股份	118,588	10,535,357.92	1.00
28	000895	双汇发展	326,339	10,377,580.20	0.99
29	002916	深南电路	89,100	9,901,683.00	0.94
30	600276	恒瑞医药	143,580	9,759,132.60	0.93
31	002032	苏泊尔	146,000	9,313,340.00	0.89
32	603288	海天味业	71,640	9,237,978.00	0.88
33	300124	汇川技术	123,583	9,177,273.58	0.87
34	600030	中信证券	348,200	8,684,108.00	0.83
35	300014	亿纬锂能	82,100	8,532,653.00	0.81
36	600999	招商证券	447,906	8,519,172.12	0.81
37	000166	申万宏源	1,809,560	8,468,740.80	0.81
38	002736	国信证券	778,262	8,366,316.50	0.80
39	601100	恒立液压	96,004	8,248,663.68	0.79
40	600588	用友网络	247,300	8,225,198.00	0.78
41	600018	上港集团	1,721,700	8,212,509.00	0.78
42	002607	中公教育	392,600	8,201,414.00	0.78
43	601899	紫金矿业	839,600	8,135,724.00	0.78
44	600900	长江电力	389,500	8,039,280.00	0.77
45	600660	福耀玻璃	143,600	8,020,060.00	0.76
46	000661	长春高新	20,554	7,954,398.00	0.76
47	300595	欧普康视	71,940	7,449,387.00	0.71
48	601668	中国建筑	1,596,500	7,423,725.00	0.71
49	000338	潍柴动力	401,400	7,173,018.00	0.68
50	601688	华泰证券	450,400	7,116,320.00	0.68
51	600048	保利地产	572,600	6,894,104.00	0.66

52	603260	合盛硅业	89,400	6,875,754.00	0.66
53	002841	视源股份	54,900	6,823,521.00	0.65
54	000002	万科A	284,200	6,766,802.00	0.64
55	600183	生益科技	288,900	6,763,149.00	0.64
56	002925	盈趣科技	172,500	6,711,975.00	0.64
57	600406	国电南瑞	281,620	6,544,848.80	0.62
58	603882	金域医学	36,203	5,784,153.31	0.55
59	600585	海螺水泥	138,805	5,697,945.25	0.54
60	600031	三一重工	193,003	5,610,597.21	0.53
61	600845	宝信软件	109,311	5,563,929.90	0.53
62	603868	飞科电器	131,700	5,539,302.00	0.53
63	600309	万华化学	47,100	5,125,422.00	0.49
64	600563	法拉电子	31,900	5,051,684.00	0.48
65	603605	珀莱雅	24,300	4,780,053.00	0.46
66	300316	晶盛机电	92,200	4,656,100.00	0.44
67	300529	健帆生物	52,500	4,533,900.00	0.43
68	601799	星宇股份	19,308	4,358,201.76	0.42
69	600346	恒力石化	164,800	4,324,352.00	0.41
70	300033	同花顺	38,226	4,311,128.28	0.41
71	000977	浪潮信息	152,200	4,281,386.00	0.41
72	601108	财通证券	407,900	4,278,871.00	0.41
73	300482	万孚生物	65,950	4,266,305.50	0.41
74	000776	广发证券	276,107	4,180,259.98	0.40
75	600061	国投资本	490,331	4,162,910.19	0.40
76	002507	涪陵榨菜	109,800	4,135,068.00	0.39
77	603638	艾迪精密	94,660	4,058,074.20	0.39
78	600760	中航沈飞	65,260	3,935,178.00	0.38
79	300357	我武生物	60,800	3,898,496.00	0.37
80	300618	寒锐钴业	48,600	3,831,624.00	0.37
81	002463	沪电股份	242,900	3,757,663.00	0.36
82	601877	正泰电器	112,000	3,738,560.00	0.36
83	300413	芒果超媒	52,800	3,622,080.00	0.35
84	002690	美亚光电	64,400	3,590,944.00	0.34
85	600233	圆通速递	358,300	3,586,583.00	0.34
86	600383	金地集团	349,200	3,575,808.00	0.34
87	000656	金科股份	612,000	3,543,480.00	0.34
88	600741	华域汽车	134,600	3,535,942.00	0.34
89	603228	景旺电子	131,505	3,445,431.00	0.33
90	002179	中航光电	42,170	3,332,273.40	0.32
91	002372	伟星新材	154,900	3,201,783.00	0.31
92	603444	吉比特	5,957	3,157,210.00	0.30
93	002027	分众传媒	326,800	3,075,188.00	0.29

94	600886	国投电力	304,200	2,923,362.00	0.28
95	600039	四川路桥	441,200	2,766,324.00	0.26
96	002901	大博医疗	37,300	2,718,797.00	0.26
97	002064	华峰化学	183,400	2,604,280.00	0.25
98	002030	达安基因	121,920	2,589,580.80	0.25
99	603737	三棵树	14,580	2,566,080.00	0.24
100	600486	扬农化工	22,700	2,537,179.00	0.24
101	000975	银泰黄金	265,760	2,527,377.60	0.24
102	600729	重庆百货	90,900	2,495,205.00	0.24
103	002056	横店东磁	189,581	2,464,553.00	0.23
104	601633	长城汽车	56,000	2,441,040.00	0.23
105	600426	华鲁恒升	78,780	2,438,241.00	0.23
106	600143	金发科技	111,500	2,325,890.00	0.22
107	600764	中国海防	80,400	2,275,320.00	0.22
108	000708	中信特钢	107,400	2,238,216.00	0.21
109	600271	航天信息	171,100	2,229,433.00	0.21
110	300463	迈克生物	51,500	2,167,635.00	0.21
111	600675	中华企业	614,200	1,922,446.00	0.18
112	300474	景嘉微	19,600	1,919,232.00	0.18
113	601000	唐山港	731,900	1,763,879.00	0.17
114	603833	欧派家居	12,200	1,731,912.00	0.17
115	000547	航天发展	84,500	1,594,515.00	0.15
116	603568	伟明环保	68,600	1,566,138.00	0.15
117	000581	威孚高科	73,200	1,524,756.00	0.15
118	000932	华菱钢铁	225,600	1,488,960.00	0.14
119	601139	深圳燃气	221,902	1,455,677.12	0.14
120	000690	宝新能源	278,500	1,423,135.00	0.14
121	002081	金螳螂	179,400	1,420,848.00	0.14
122	600901	江苏租赁	271,100	1,409,720.00	0.13
123	000967	盈峰环境	194,700	1,337,589.00	0.13
124	600801	华新水泥	74,600	1,310,722.00	0.12
125	002595	豪迈科技	49,000	1,308,300.00	0.12
126	600273	嘉化能源	136,300	1,185,810.00	0.11
127	603899	晨光文具	11,300	955,528.00	0.09
128	300418	昆仑万维	46,497	761,620.86	0.07
129	000717	韶钢松山	125,400	575,586.00	0.05
130	601003	柳钢股份	91,100	537,490.00	0.05
131	600507	方大特钢	75,200	509,856.00	0.05
132	002867	周大生	25,100	496,227.00	0.05

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.06
2	688819	天能股份	7,450	325,490.50	0.03
3	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.02
4	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.01
5	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.01
6	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
7	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.01
8	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.01
9	300957	贝泰妮	237	59,714.52	0.01
10	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.01
11	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.01
12	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
13	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.01
14	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
15	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
16	300979	华利集团	370	32,375.00	0.00
17	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
18	300973	立高食品	219	25,340.49	0.00
19	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
20	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
21	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
22	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
23	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
24	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
25	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
26	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
27	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
28	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
29	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
30	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
31	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
32	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
33	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
34	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
35	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
36	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
37	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
38	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
39	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
40	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
41	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
42	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00

43	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
44	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
45	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
46	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
47	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
48	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
49	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
50	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
51	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
52	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
53	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
54	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
55	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
56	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
57	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
58	300968	格林精密	276	3,331.32	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	600809	山西汾酒	37,116,976.68	2.79
2	601166	兴业银行	29,663,207.00	2.23
3	601318	中国平安	25,673,802.00	1.93
4	600779	水井坊	18,657,239.00	1.40
5	603501	韦尔股份	17,615,222.00	1.32
6	601939	建设银行	14,807,773.00	1.11
7	601838	成都银行	14,797,304.00	1.11
8	600985	淮北矿业	13,040,252.87	0.98
9	603712	七一二	12,294,148.00	0.92
10	002032	苏泊尔	12,051,569.00	0.90
11	600763	通策医疗	11,626,460.00	0.87
12	601899	紫金矿业	10,721,994.00	0.80
13	000651	格力电器	10,480,234.00	0.79
14	002607	中公教育	9,912,910.17	0.74
15	600018	上港集团	9,107,421.00	0.68
16	600588	用友网络	8,808,376.00	0.66
17	601919	中远海控	8,416,877.00	0.63
18	002475	立讯精密	8,332,965.00	0.63
19	300014	亿纬锂能	7,841,545.00	0.59
20	002916	深南电路	7,771,185.40	0.58

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	600036	招商银行	53,469,822.50	4.01
2	600519	贵州茅台	52,262,834.32	3.92
3	601601	中国太保	46,466,670.10	3.49
4	600132	重庆啤酒	34,266,300.85	2.57
5	002142	宁波银行	33,480,108.11	2.51
6	002352	顺丰控股	26,532,044.93	1.99
7	000333	美的集团	25,606,638.71	1.92
8	601799	星宇股份	21,131,299.80	1.59
9	603799	华友钴业	20,578,852.20	1.54
10	601009	南京银行	19,518,810.32	1.46
11	002128	露天煤业	18,708,508.72	1.40
12	300628	亿联网络	16,174,449.84	1.21
13	601997	贵阳银行	14,449,251.00	1.08
14	002714	牧原股份	14,386,255.00	1.08
15	000002	万科 A	10,943,355.68	0.82
16	300408	三环集团	10,623,053.83	0.80
17	300059	东方财富	9,518,338.78	0.71
18	600048	保利地产	9,051,950.40	0.68
19	002236	大华股份	8,729,215.70	0.66
20	600346	恒力石化	8,332,504.10	0.63

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	518,512,616.09
卖出股票收入（成交）总额	822,995,861.26

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	3,069,000.00	0.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,069,000.00	0.29

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	113050	南银转债	30,030	3,003,000.00	0.29
2	123117	健帆转债	660	66,000.00	0.01

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2109	IF2109	6	9,299,520.00	487,080.00	-
IF2112	IF2112	2	3,084,120.00	33,180.00	-
公允价值变动总额合计（元）					520,260.00
股指期货投资本期收益（元）					647,044.66
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-697,680.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

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：根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

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

本基金持有的招商银行（代码：600036）的发行主体招商银行股份有限公司因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等行于 2021 年 5 月 17 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 7170 万元。

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。

本基金持有的兴业银行（代码：601166）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，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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	1,752,060.76
2	应收证券清算款	1,760,501.49
3	应收股利	-
4	应收利息	9,123.85
5	应收申购款	322,530.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,844,216.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688617	惠泰医疗	624,430.52	0.06	新股锁定
2	688819	天能股份	325,490.50	0.03	新股锁定
3	688315	诺禾致源	145,471.20	0.01	新股锁定
4	688625	呈和科技	113,907.36	0.01	新股锁定
5	301015	百洋医药	17,939.46	0.00	新股锁定

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	19,144	31,172.09	43,187,120.18	7.24	553,571,447.93	92.76

方红中证竞争力指数 A						
东方红中证竞争力指数 C	3,115	31,103.41	200,011.90	0.21	96,687,121.66	99.79
合计	22,259	31,162.48	43,387,132.08	6.25	650,258,569.59	93.75

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	东方红中证竞争力指数 A	2,886,321.31	0.48
	东方红中证竞争力指数 C	642,108.33	0.66
	合计	3,528,429.64	0.51

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，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）。

8.3 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	东方红中证竞争力指数 A	>100
	东方红中证竞争力指数 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红中证竞争力指数 A	0
	东方红中证竞争力指数 C	0~10
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,005,850.58	1.44	10,005,850.58	1.44	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,005,850.58	1.44	10,005,850.58	1.44	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红中证竞争力指数 A	东方红中证竞争力指数 C
基金合同生效日 (2019 年 7 月 31 日) 基金份额总额	3,771,863,623.02	638,161,455.27
本报告期期初基金份额总额	777,831,918.68	128,213,650.12
本报告期基金总申购份额	55,010,675.98	11,868,426.29
减：本报告期基金总赎回份额	236,084,026.55	43,194,942.85
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	596,758,568.11	96,887,133.56
-------------	----------------	---------------

§ 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	
华菁证券	2	734,994,965.21	55.00%	522,802.22	55.00%	-
中信建投证券	2	358,714,036.83	26.84%	255,154.80	26.84%	-
广发证券	4	92,340,009.75	6.91%	65,681.41	6.91%	-
长江证券	2	77,105,249.90	5.77%	54,845.56	5.77%	-

海通证券	2	50,730,800.69	3.80%	36,084.92	3.80%	-
中信证券	2	18,023,662.69	1.35%	12,820.27	1.35%	-
招商证券	1	4,454,842.98	0.33%	3,168.71	0.33%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	5	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	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	-	-	-	-	-
中泰证券	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：新增开源证券交易单元 1 个，国金证券交易单元 1 个，国信证券交易单元 1 个，兴业证券交易单元 1 个，华创证券交易单元 1 个。

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
华菁证券	1,912,471.00	27.65%	-	-	-	-
中信建投证券	1,087,648.80	15.72%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	3,003,000.00	43.41%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	914,400.00	13.22%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

汇丰前海	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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住所变更的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 1 月 8 日
2	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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 1 月 11 日
3	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司开通定期定额投资业务的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 1 月 19 日
4	东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 1 月 22 日
5	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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 2 月 22 日
6	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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 3 月 2 日
7	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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 3 月 13 日
8	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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 3 月 29 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金修改基金合同的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 3 月 30 日
10	东方红中证竞争力指数发起式证券投资	证券时报、中国证监会	2021 年 3 月 30 日

	资基金(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	
11	东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金招募说明书(更新)(2021年第1号)	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年3月30日
12	东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金合同	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年3月30日
13	东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金2020年年度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年3月31日
14	关于东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金增加珠海盈米基金销售有限公司为代理销售机构的公告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年4月8日
15	东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金2021年第1季度报告	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年4月22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	证券时报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年6月22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：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

7、中国证监会要求的其他文件。

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。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 8 月 31 日