

东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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 基金管理人及基金托管人	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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51

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	51
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	51
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	东方红优质甄选一年持有混合
基金主代码	009725
基金运作方式	契约型开放式 本基金每份基金份额设置 1 年锁定持有期，由红利再投资而来的基金份额不受锁定持有期的限制。
基金合同生效日	2020 年 7 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	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,383,858,734.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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	本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势，并通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*8%+恒生指数收益率*2%+中债综合指数收益率*90%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李云亮	石立平
	联系电话	021-53952828	010-63639180
	电子邮箱	service@dfham.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4009200808	95595
传真		021-63326381	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7	北京市西城区太平桥大街 25 号、

	层-11 层	甲 25 号中国光大中心
办公地址	上海市黄浦区外马路 108 号 7 层-11 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	200010	100033
法定代表人	宋雪枫	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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)
本期已实现收益	52,874,144.09
本期利润	50,009,151.23
加权平均基金份额本期利润	0.0492
本期加权平均净值利润率	4.71%
本期基金份额净值增长率	4.81%
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	46,446,328.48
期末可供分配基金份额利润	0.0336
期末基金资产净值	1,449,618,135.08
期末基金份额净值	1.0475
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	8.64%

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）。

4、本基金合同于 2020 年 7 月 23 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.20%	0.07%	-0.22%	0.08%	0.42%	-0.01%
过去三个月	1.56%	0.09%	0.74%	0.09%	0.82%	0.00%
过去六个月	4.81%	0.14%	0.81%	0.13%	4.00%	0.01%
自基金合同生效起至今	8.64%	0.14%	1.56%	0.12%	7.08%	0.02%

注：注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率×2%+中债综合指数收益率×90%。

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(benchmarkt)按下列公式计算：

$$\text{benchmarkt} = 90\% \times [\text{t 日中债-综合全价(总值)指数} / (\text{t-1 日中债-综合全价(总值)指数}) - 1] + 8\% \times [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 2\% \times [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1 日恒生指数}) - 1];$$

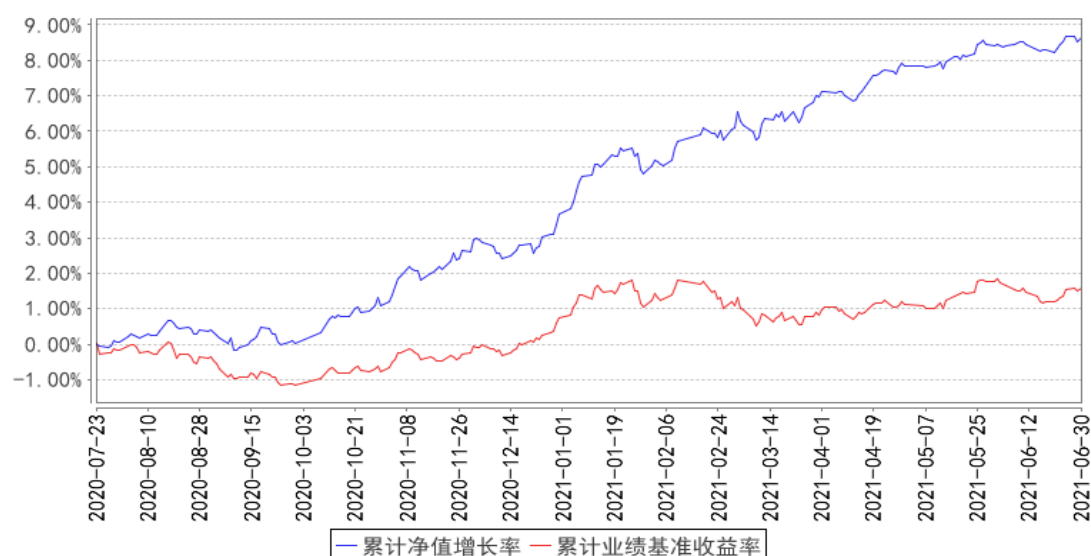
期间 T 日收益率(benchmarkT)按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})] - 1 \text{ 其中, } t=1, 2, 3, \dots, T, T \text{ 表示时间截至日};$$

$\prod (1 + \text{benchmarkt})$ 表示 $(1 + \text{benchmarkt})$ 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

东方红优质甄选一年持有混合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



- 注：1、本基金合同于 2020 年 7 月 23 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。
- 2、本基金建仓期 6 个月，即从 2020 年 7 月 23 日起至 2021 年 1 月 22 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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

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		
王 佳 骏	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2020 年 7 月 23 日	-	6 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2019 年 08 月至今任东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至今任东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 02 月至今任东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 03 月至今任东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 07 月至今任 东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 05 月至今任东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。帝国理工学院金融学硕士。曾任国信证券股份有限公司助理分析师，上海东方证券资产管理有限公司投资支持高级经理。具备证券投资基金从业资格。
丁 锐	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2020 年 8 月 27 日	-	8 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2018 年 11 月至今任东方红货币市场基金基金经理、2020 年 07 月至今任东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、2020 年 08 月至今任东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 09 月至今任东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。牛津大学理学硕士。曾任交通银行股份有限公司资产管理业务中心投资经理，交银施罗德基金管理有限公司专户投资部投资经理助理，上海东方证券资产管理有限公司投资经理助理。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

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。

资金方面，上半年资金整体平稳宽松，中间略有起伏，关键时点资金价格冲高后回落。一月份下半月资金价格飙升到近几年高点，隔夜价格一度到 15%以上，六月份最后一周交易所利率大

幅上行，最后一天银行间隔夜价格突破 10%，导致资产收益率与资金成本倒挂，杠杆贡献收益为负，高杠杆组合受冲击较大。整个上半年交易所隔夜在 1.8-2.1% 区间震荡，银行间隔夜价格显著低于交易所，银行间资金成本优势在依然明显。

利率方面，收益率震荡下行。一月份由于资金面收紧，叠加通胀预期影响，债券收益率快速上行至今年高位，进入二月份资金面大幅缓和，跨春节资金价格维持平稳，债券收益率冲高回落。四五月期间，尽管经济数据密集出炉，海外经济尤其美国经济强劲复苏，同时商品也屡创新高，但债市仍不改牛市，在宽松的资金面和资产荒的刺激下，收益率在震荡中缓慢下行。进入六月后，随着过度宽松的资金面开始修复，同时 10 年国债触及 3% 附近的心理关口，在没有重大利多进一步刺激的情况下，利率债月中小幅反弹后，最终月底回落至年初水平。

信用方面，永煤违约的余波仍在，加上华夏幸福和蓝光债券违约，信用风险进一步暴露，市场对房地产企业规避情绪升温，债券配置向高等级和城投债持续集中，期限利差与信用利差均得到压缩。

组合操作上，由于七月份需要打开赎回，杠杆随着组合资产到期不断下降，久期逐渐缩短。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.0475 元，份额累计净值为 1.0855 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.81%，业绩比较基准收益率为 0.81%。

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。货币政策将继续保持较为稳定宽松的状态，从央行的报告及七月份的降准可以看出，央行对于维护资金面稳定的态度。同时资金价格未见大幅下行，短端甚至小幅上行，预计三季度将维持在 2.1-2.3% 窄幅波动的局面。

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，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，值得关注。

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，七月份债券收益率的大幅下行，已经体现了市场对于三季度经济转弱和货币宽松的预期，收益率下探至近几年低点，短期内继续大幅下行的概率不大。预计收益率将在现有位置

小幅震荡。随着地产和城投平台融资政策的收紧，需警惕房地产企业和尾部城投平台的信用风险。

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

报告期内，本基金实施利润分配 2 次，共分配利润 38,173,110.57 元，符合相关法规及基金合同的规定。

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遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信

用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金 2021 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：东方红优质甄选一年持有期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 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	40,172,541.53	2,832,117.63
结算备付金		3,156,692.93	5,340,785.98
存出保证金		36,686.61	86,917.81
交易性金融资产	6.4.7.2	965,669,640.66	1,349,561,471.61
其中：股票投资		145,995,540.25	132,047,392.73
基金投资		-	-
债券投资		819,674,100.41	1,187,514,078.88
资产支持证券投资		-	30,000,000.00
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	351,000,000.00	-
应收证券清算款		-	1,359,431.01
应收利息	6.4.7.5	18,594,929.69	21,414,164.77
应收股利		-	-

应收申购款		103,761,249.38	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,482,391,740.80	1,380,594,888.81
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		-	337,967,827.55
应付证券清算款		31,662,918.70	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		641,731.02	612,190.37
应付托管费		183,351.74	174,911.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	23,024.11	22,723.50
应交税费		63,484.21	98,346.33
应付利息		-	394,501.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	199,095.94	150,000.00
负债合计		32,773,605.72	339,420,501.19
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,383,858,734.65	1,004,555,510.85
未分配利润	6.4.7.10	65,759,400.43	36,618,876.77
所有者权益合计		1,449,618,135.08	1,041,174,387.62
负债和所有者权益总计		1,482,391,740.80	1,380,594,888.81

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0475 元，基金份额总额 1,383,858,734.65 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红优质甄选一年持有期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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		57,371,492.63
1. 利息收入		22,159,767.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	100,590.36

债券利息收入		21,630,861.26
资产支持证券利息收入		165,731.71
买入返售金融资产收入		262,584.51
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		38,076,717.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,043,808.20
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,280,208.85
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
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	752,700.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,864,992.86
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	-
减：二、费用		7,362,341.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,678,051.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,050,871.94
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	190,343.57
5. 利息支出		2,253,526.56
其中：卖出回购金融资产支出		2,253,526.56
6. 税金及附加		63,651.65
7. 其他费用	6.4.7.20	125,895.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		50,009,151.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,009,151.23

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红优质甄选一年持有期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 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）	1,004,555,510.85	36,618,876.77	1,041,174,387.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期	-	50,009,151.23	50,009,151.23

利润)			
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)	379,303,223.80	17,304,483.00	396,607,706.80
其中:1.基金申购款	379,303,223.80	17,304,483.00	396,607,706.80
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-38,173,110.57	-38,173,110.57
五、期末所有者权益(基金净值)	1,383,858,734.65	65,759,400.43	1,449,618,135.08

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

东方红优质甄选一年持有期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[2020]639号《关于准予东方红优质甄选一年持有期混合型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《东方红优质甄选一年持有期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1,004,194,726.39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(2020)第0584号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2020年7月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,004,555,510.85份基金份额,其中认购资金利息折合360,784.46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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金每份

基金份额设置 1 年锁定持有期，由红利再投资而来的基金份额不受锁定持有期的限制。锁定持有期指基金合同生效日(对认购份额而言，下同)、基金份额申购申请日(对申购份额而言，下同)或基金份额转换转入申请日(对转换转入份额而言，下同)起(即锁定持有期起始日)，至基金合同生效日、基金份额申购申请日或基金份额转换转入申请日次 1 年的年度对日前一日(即锁定持有期到期日)止。每份基金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期，自其开放持有期首日起才可以办理赎回及转换转出业务，每份基金份额的开放持有期首日为锁定持有期起始日次 1 年的年度对日，若该年度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红优质甄选一年持有期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或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、公开发行的次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债、证券公司短期公司债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、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%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%—50%);本基金投资同业存单的比例不得超过基金资产的 20%;

本基金每个交易日日终在扣除股指期货和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%，但在本基金认购份额的锁定持有期内，本基金不受前述 5%的限制。本基金认购份额的锁定持有期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述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：沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率×2%+中债综合指数收益率×90%。

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》、《东方红优质甄选一年持有期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[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	40,172,541.53
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	40,172,541.53

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	140,269,494.57	145,995,540.25	5,726,045.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	664,639,123.46	672,823,100.41
	银行间市场	146,482,850.00	146,851,000.00
	合计	811,121,973.46	819,674,100.41
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	951,391,468.03	965,669,640.66	14,278,172.63

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	351,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	351,000,000.00	-

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	6,884.87
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	1,278.45
应收债券利息	18,458,599.62
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	128,147.30
应收申购款利息	4.60
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	14.85
合计	18,594,929.69

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	23,024.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	23,024.11

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	199,095.94
合计	199,095.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,004,555,510.85	1,004,555,510.85
本期申购	379,303,223.80	379,303,223.80
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 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	1,383,858,734.65	1,383,858,734.65

注：根据《东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和《东方红优质甄选一年

持有期混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金每份基金份额设置 1 年锁定持有期（红利再投资所得份额除外），基金份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份基金份额自其开放持有期首日起才能办理赎回及转换转出业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,475,711.28	17,143,165.49	36,618,876.77
本期利润	52,874,144.09	-2,864,992.86	50,009,151.23
本期基金份额交易产生的变动数	12,269,583.68	5,034,899.32	17,304,483.00
其中：基金申购款	12,269,583.68	5,034,899.32	17,304,483.00
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-38,173,110.57	-	-38,173,110.57
本期末	46,446,328.48	19,313,071.95	65,759,400.43

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	61,097.01
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	39,013.74
其他	479.61
合计	100,590.36

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	25,043,808.20
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	25,043,808.20

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	66,779,948.93
减：卖出股票成本总额	41,736,140.73
买卖股票差价收入	25,043,808.20

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	12,280,208.85
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	12,280,208.85

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	613,279,382.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	573,868,756.56
减：应收利息总额	27,130,417.55
买卖债券差价收入	12,280,208.85

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	30,301,815.00
减：卖出资产支持证券成本总额	30,000,000.00
减：应收利息总额	301,815.00
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

注：本基金本报告期无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	752,700.60
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	752,700.60

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	-2,864,992.86
股票投资	-7,054,803.56
债券投资	4,189,810.70
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	-2,864,992.86

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

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	189,348.57
银行间市场交易费用	995.00
合计	190,343.57

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	-
账户维护费	16,800.00
合计	125,895.94

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

2021 年 7 月 13 日宣告 2021 年度第 2 次分红，向截至 2021 年 7 月 15 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.2100 元。

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
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	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

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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
东方证券	121,518,559.35	100.00

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	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
东方证券	353,906,006.55	100.00

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东方证券	5,080,873,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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（%）
东方证券	86,435.67	100.00	23,024.11	100.00

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
当期发生的基金应支付的管理费	3,678,051.74
其中：支付销售机构的客户维护费	1,457,462.72

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基

金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

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
当期发生的基金应支付的托管费	1,050,871.94

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
光大银行	40,172,541.53	61,097.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大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：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投 资形 式 发放 总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 1 月 8 日	-	2021 年 1 月 8 日	0.1400	14,063,777.97	-	14,063,777.97	-
2	2021 年 4 月 15 日	-	2021 年 4 月 15 日	0.2400	24,109,332.60	-	24,109,332.60	-
合计	-	-	-	0.3800	38,173,110.57	-	38,173,110.57	-

注：本基金于资产负债表日之后、年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项。

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 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	-
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	806	38,147.98	203,079.76	-
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 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
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 15 日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-

		日	月 19 日							
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	-
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	新股锁 定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-

			日							
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	-
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	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

		日	月 30 日							
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	-
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	-
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	-
688117	圣诺生物	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股锁 定	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
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	-
688323	瑞华泰	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 28 日	新股锁 定	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-
688355	明志科技	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 12 日	新股锁 定	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 4 日	新股锁 定	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688613	奥精	2021 年	2021	新股锁	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-

	医疗	5月13日	年11月22日	定						
688661	和林微纳	2021年3月19日	2021年9月29日	新股锁定	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股锁定	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00	-
688689	银河微电	2021年1月15日	2021年7月27日	新股锁定	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-

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17日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	2,910	291,000.00	291,000.00	-

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票，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票，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票数量的 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票，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票不适用《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的各类重大风险，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中国光大银行股份有限公司，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	30,015,000.00	89,805,000.00
A-1 以下	—	—
未评级	8,162,709.90	190,340,000.00
合计	38,177,709.90	280,145,000.00

注：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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	—	30,000,000.00
A-1 以下	—	—
未评级	—	—
合计	—	30,000,000.00

注：评级取自第三方评级机构的债项评级。

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	116,731,000.00	116,719,000.00
合计	116,731,000.00	116,719,000.00

注：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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	501,089,617.50	508,344,250.12
AAA 以下	133,555,773.01	252,251,828.76
未评级	30,120,000.00	30,054,000.00
合计	664,765,390.51	790,650,078.88

注：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

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	-	-
未评级	-	116,719,000.00
合计	-	116,719,000.00

注：评级取自第三方评级机构的债项评级。

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于约定开放日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公司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 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	40,172,541.53	-	-	-	-	-	40,172,541.53
结算备付金	3,156,692.93	-	-	-	-	-	3,156,692.93
存出保证金	36,686.61	-	-	-	-	-	36,686.61
交易性金融资产	191,681,400.00	128,991,121.30	82,571,909.90	406,447,182.40	9,982,486.81	145,995,540.25	965,669,640.66
买入返售金融资产	351,000,000.00	-	-	-	-	-	351,000,000.00

应收利息	-	-	-	-	-	18,594,929.69	18,594,929.69
应收申购款	-	-	-	-	-	103,761,249.38	103,761,249.38
资产总计	586,047,321.07	128,991,121.30	82,571,909.90	406,447,182.40	9,982,486.81	268,351,719.32	1,482,391,740.80
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	641,731.02	641,731.02
应付托管费	-	-	-	-	-	183,351.74	183,351.74
应付证券清算款	-	-	-	-	-	31,662,918.70	31,662,918.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	23,024.11	23,024.11
应交税费	-	-	-	-	-	63,484.21	63,484.21
其他负债	-	-	-	-	-	199,095.94	199,095.94
负债总计	-	-	-	-	-	32,773,605.72	32,773,605.72
利率敏感度缺口	586,047,321.07	128,991,121.30	82,571,909.90	406,447,182.40	9,982,486.81	235,578,113.60	1,449,618,135.08
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	2,832,117.63	-	-	-	-	-	2,832,117.63
结算备付金	5,340,785.98	-	-	-	-	-	5,340,785.98
存出保证金	86,917.81	-	-	-	-	-	86,917.81
交易性金融资产	51,852,565.00	156,063,100.00	560,268,400.00	430,998,114.60	18,331,899.28	132,047,392.73	1,349,561,471.61
应收利息	-	-	-	-	-	21,414,164.77	21,414,164.77
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,359,431.01	1,359,431.01
资产总计	60,112,386.42	156,063,100.00	560,268,400.00	430,998,114.60	18,331,899.28	154,820,988.51	1,380,594,888.81
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	612,190.37	612,190.37
应付托管费	-	-	-	-	-	174,911.54	174,911.54
卖出回购金融	337,967,827	-	-	-	-	-	337,967,827

资产款	.55						7.55
应付交易费用	-	-	-	-	-	22,723.50	22,723.50
应付利息	-	-	-	-	-	394,501.90	394,501.90
应交税费	-	-	-	-	-	98,346.33	98,346.33
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	337,967,827.55	-	-	-	-	1,452,673.64	339,420,501.19
利率敏感度缺口	-277,855,441.13	156,063,100.00	560,268,400.00	430,998,114.60	18,331,899.28	153,368,314.87	1,041,174,387.62

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	2,888,649.09	4,290,982.27
	2. 市场利率上升 25 个基点	-2,865,490.62	-4,255,535.06

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	145,995,540.25	10.07	132,047,392.73	12.68
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	145,995,540.25	10.07	132,047,392.73	12.68

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%	5,431,965.28	6,016,380.94
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-5,431,965.28	-6,016,380.94

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 167,161,773.80 元，属于第二层次的余额为 798,507,866.86 元，无第三层次（2020 年 12 月 31 日：第一层次 159,758,340.99 元，第二层次 1,159,803,130.62 元，属于第三层次的余额为 30,000,000.00 元。）。

(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

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具为 0 元（2020 年 12 月 31 日：30,000,000.00 元）。本基金本期净转出第三层次的金额为 30,000,000.00 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为 0 元。

(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。

(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	145,995,540.25	9.85

	其中：股票	145,995,540.25	9.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	819,674,100.41	55.29
	其中：债券	819,674,100.41	55.29
	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	351,000,000.00	23.68
	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	43,329,234.46	2.92
8	其他各项资产	122,392,865.68	8.26
9	合计	1,482,391,740.80	100.00

注：1、本基金本报告期末无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	7,466,400.00	0.52
C	制造业	78,235,404.56	5.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,941,198.39	0.41
E	建筑业	4,606,096.93	0.32
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	7,914,718.00	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,132,608.64	0.29
J	金融业	21,603,347.10	1.49
K	房地产业	7,529,941.44	0.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,598,226.33	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,923,791.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	2,936,940.00	0.20
S	综合	-	-

	合计	145,995,540.25	10.07
--	----	----------------	-------

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	002415	海康威视	141,200	9,107,400.00	0.63
2	601088	中国神华	382,500	7,466,400.00	0.52
3	600741	华域汽车	271,780	7,139,660.60	0.49
4	000002	万 科 A	253,400	6,033,454.00	0.42
5	300122	智飞生物	28,900	5,396,497.00	0.37
6	002142	宁波银行	135,200	5,268,744.00	0.36
7	600887	伊利股份	142,600	5,251,958.00	0.36
8	000001	平安银行	226,300	5,118,906.00	0.35
9	601398	工商银行	985,700	5,096,069.00	0.35
10	600377	宁沪高速	498,400	4,864,384.00	0.34
11	601186	中国铁建	618,000	4,591,740.00	0.32
12	300482	万孚生物	69,680	4,507,599.20	0.31
13	002832	比音勒芬	168,700	4,317,033.00	0.30
14	002304	洋河股份	20,500	4,247,600.00	0.29
15	600031	三一重工	142,600	4,145,382.00	0.29
16	002008	大族激光	100,000	4,039,000.00	0.28
17	000333	美的集团	50,200	3,582,774.00	0.25
18	601318	中国平安	51,900	3,336,132.00	0.23
19	600011	华能国际	768,300	3,242,226.00	0.22
20	002925	盈趣科技	81,770	3,181,670.70	0.22
21	600183	生益科技	134,900	3,158,009.00	0.22
22	600029	南方航空	506,700	3,050,334.00	0.21
23	002739	万达电影	186,000	2,936,940.00	0.20
24	603882	金域医学	18,300	2,923,791.00	0.20
25	002475	立讯精密	60,600	2,787,600.00	0.19
26	002736	国信证券	255,700	2,748,775.00	0.19
27	600027	华电国际	780,800	2,685,952.00	0.19
28	600323	瀚蓝环境	117,200	2,553,788.00	0.18
29	002078	太阳纸业	185,300	2,473,755.00	0.17
30	002493	荣盛石化	122,550	2,116,438.50	0.15
31	002065	东华软件	265,200	2,103,036.00	0.15
32	600585	海螺水泥	49,700	2,040,185.00	0.14
33	000997	新 大 陆	120,500	1,999,095.00	0.14

34	600426	华鲁恒升	61,508	1,903,672.60	0.13
35	600745	闻泰科技	17,500	1,695,750.00	0.12
36	601238	广汽集团	115,800	1,499,610.00	0.10
37	600048	保利地产	124,100	1,494,164.00	0.10
38	000725	京东方 A	208,500	1,301,040.00	0.09
39	601012	隆基股份	13,580	1,206,447.20	0.08
40	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.07
41	300957	贝泰妮	806	203,079.76	0.01
42	688136	科兴制药	4,981	184,695.48	0.01
43	688345	博力威	2,332	171,518.60	0.01
44	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.01
45	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
46	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.01
47	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.01
48	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
49	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
50	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
51	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.00
52	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.00
53	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
54	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
55	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
56	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
57	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
58	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
59	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.00
60	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
61	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
62	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
63	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
64	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
65	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
66	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
67	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
68	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
69	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
70	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
71	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
72	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
73	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
74	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
75	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00

76	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
77	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
78	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
79	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
80	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
81	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
82	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
83	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
84	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
85	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
86	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
87	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
88	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
89	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
90	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
91	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
92	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
93	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
94	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
95	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
96	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
97	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
98	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
99	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
100	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
101	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
102	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
103	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
104	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
105	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
106	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
107	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
108	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
109	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
110	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
111	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
112	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	300122	智飞生物	5,247,428.00	0.50
2	601398	工商银行	5,190,753.00	0.50
3	600377	宁沪高速	4,549,696.00	0.44
4	002415	海康威视	4,408,928.06	0.42
5	002304	洋河股份	4,141,469.00	0.40
6	603882	金域医学	2,891,516.00	0.28
7	600741	华域汽车	2,770,888.00	0.27
8	600031	三一重工	2,566,179.71	0.25
9	300482	万孚生物	2,559,186.00	0.25
10	002475	立讯精密	2,473,821.00	0.24
11	002044	美年健康	2,045,983.00	0.20
12	002065	东华软件	1,999,307.00	0.19
13	600887	伊利股份	1,448,334.00	0.14
14	002008	大族激光	1,446,170.00	0.14
15	600011	华能国际	999,734.00	0.10
16	000786	北新建材	999,285.00	0.10
17	600323	瀚蓝环境	999,114.00	0.10
18	002078	太阳纸业	999,051.00	0.10
19	601088	中国神华	998,890.00	0.10
20	002142	宁波银行	998,669.00	0.10

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	600036	招商银行	7,018,100.00	0.67
2	002415	海康威视	3,606,700.00	0.35
3	002493	荣盛石化	3,129,333.00	0.30
4	002142	宁波银行	2,679,934.00	0.26
5	000858	五粮液	2,450,976.00	0.24
6	000001	平安银行	2,286,543.80	0.22
7	601966	玲珑轮胎	2,252,394.04	0.22
8	601233	桐昆股份	2,236,687.80	0.21
9	601628	中国人寿	2,079,664.80	0.20
10	002044	美年健康	1,606,287.00	0.15
11	002832	比音勒芬	1,560,642.00	0.15
12	300315	掌趣科技	1,540,665.00	0.15
13	002078	太阳纸业	1,419,958.00	0.14
14	688819	天能股份	1,383,622.20	0.13
15	300957	贝泰妮	1,247,472.78	0.12
16	600438	通威股份	1,197,846.00	0.12
17	688425	铁建重工	1,105,589.80	0.11

18	601088	中国神华	1,040,520.00	0.10
19	600741	华域汽车	1,040,219.00	0.10
20	600031	三一重工	1,034,308.00	0.10

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	62,739,091.81
卖出股票收入（成交）总额	66,779,948.93

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	8,162,709.90	0.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	161,009,000.00	11.11
	其中：政策性金融债	30,120,000.00	2.08
4	企业债券	408,733,721.30	28.20
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	125,037,669.21	8.63
8	同业存单	116,731,000.00	8.05
9	其他	-	-
10	合计	819,674,100.41	56.54

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	163420	20 光明 01	700,000	69,433,000.00	4.79
2	112005056	20 建设银行 CD056	700,000	68,096,000.00	4.70
3	163910	20 中证 16	600,000	60,426,000.00	4.17
4	149189	20 大悦 01	500,000	50,475,000.00	3.48
5	112003067	20 农业银行 CD067	500,000	48,635,000.00	3.36

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持有股指期货。

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，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，以期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

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

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 20 农业银行 CD067（代码：112003067 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；因发生重要信息系统突发事件未报告、制卡数据违规明文留存等 6 项违法违规行为，于 2021 年 1 月 19 日被银保监会罚款

420 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

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	36,686.61
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	18,594,929.69
5	应收申购款	103,761,249.38
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	122,392,865.68

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	132015	18 中油 EB	40,900,000.00	2.82
2	132009	17 中油 EB	39,610,326.00	2.73
3	132008	17 山高 EB	10,462,000.00	0.72
4	132011	17 浙报 EB	10,120,350.00	0.70
5	110045	海澜转债	6,697,800.00	0.46
6	113024	核建转债	5,123,500.00	0.35
7	128138	侨银转债	3,771,692.50	0.26
8	127020	中金转债	3,291,000.00	0.23
9	123056	雪榕转债	2,068,800.00	0.14
10	128123	国光转债	1,721,489.21	0.12
11	128071	合兴转债	72,406.40	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

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 (%)
16,378	84,494.98	-	-	1,383,858,734.65	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	22,023.62	0.00

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 7 月 23 日) 基金份额总额	1,004,555,510.85
本报告期期初基金份额总额	1,004,555,510.85
本报告期基金总申购份额	379,303,223.80
减：本报告期基金总赎回份额	-
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	1,383,858,734.65

§ 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	3	121,518,559.35	100.00%	86,435.67	100.00%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

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：本基金本报告期租用券商交易单元无变更。

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	353,906,006.55	100.00%	5,080,873,000.00	100.00%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

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	东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 1 月 6 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	上海证券报、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	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 1 月 11 日
4	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2021 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 1 月 15 日
5	东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 1 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	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 2 月 22 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	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 3 月 13 日
8	东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金 2020 年年度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 3 月 31 日
9	东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 4 月 13 日

10	东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 4 月 22 日
11	东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金开放申购及转换转入业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 4 月 29 日
12	上海东方证券资产管理有限公司关于基金经理休假期间由他人代为履职的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 5 月 6 日
13	关于东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资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	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 6 月 10 日
14	关于东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金在网上直销平台开通定期定额投资业务并开展费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 6 月 10 日
15	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	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 6 月 22 日
16	东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021 年第 1 号）	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 6 月 29 日
17	东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 6 月 29 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、中国证监会准予注册东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；

- 4、东方红优质甄选一年持有期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。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 8 月 31 日