

# 东方红智华三年持有期混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 08 月 18 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	21
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>49</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	54
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	54
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	54
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
8.12 投资组合报告附注 .....	55
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	56
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	57
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 基金投资策略的改变 .....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
11.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
13.1 备查文件目录 .....	61
13.2 存放地点 .....	62
13.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红智华三年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	东方红智华三年持有混合	
基金主代码	012839	
基金运作方式	契约型开放式、本基金每份基金份额设置 3 年锁定持有期（红利再投资所得份额除外）	
基金合同生效日	2021 年 8 月 18 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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,056,483,831.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方红智华三年持有混合 A	东方红智华三年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	012839	012840
报告期末下属分级基金的份额总额	3,967,586,684.02 份	88,897,147.23 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对宏观经济形势、行业发展趋势和企业基本面的深入研究，挖掘出价格低估、质地优秀的上市公司，在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金在中国经济增长模式转型的大背景下，寻找符合经济发展趋势的行业，积极把握由新型城镇化、人口结构调整、资源环境约束、产业升级、商业模式创新等大趋势带来的投资机会，挖掘重点行业中的优势个股，自下而上精选具有核心竞争优势的企业，分享转型期中国经济增长的成果，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×20%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张锋	李申
	联系电话	021-33315895	021-60637102
	电子邮箱	service@dfham.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4009200808	021-60637111
传真		021-63326381	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200010	100033
法定代表人		宋雪枫	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	上海东方证券资产管理有限公司	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	东方红智华三年持有混合 A	东方红智华三年持有混合 C
本期已实现收益	-91,208,332.53	-2,153,027.16
本期利润	-97,705,551.70	-2,301,372.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0246	-0.0259

本期加权平均 净值利润率	-2.56%	-2.69%
本期基金份额 净值增长率	-2.46%	-2.59%
3.1.2 期末数 据和指标	2021 年末	
期末可供分配 利润	-97,705,551.70	-2,301,372.15
期末可供分配 基金份额利润	-0.0246	-0.0259
期末基金资产 净值	3,869,881,132.32	86,595,775.08
期末基金份额 净值	0.9754	0.9741
3.1.3 累计期 末指标	2021 年末	
基金份额累计 净值增长率	-2.46%	-2.59%

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

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

3、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 2021 年 08 月 18 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满半年。

### 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

东方红智华三年持有混合 A

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.14%	0.88%	-0.23%	0.60%	3.37%	0.28%
自基金合同生效起 至今	-2.46%	0.79%	-0.71%	0.68%	-1.75%	0.11%

东方红智华三年持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.05%	0.88%	-0.23%	0.60%	3.28%	0.28%
自基金合同生效起至今	-2.59%	0.79%	-0.71%	0.68%	-1.88%	0.11%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×20%+中国债券总指数收益率×20%

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

$$\text{benchmarkt} = 60\% * [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 20\% * [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1 日恒生指数}) - 1] + 20\% * [\text{t 日中国债券总指数} / (\text{t-1 日中国债券总指数}) - 1]$$

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

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

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

东方红智华三年持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红智华三年持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

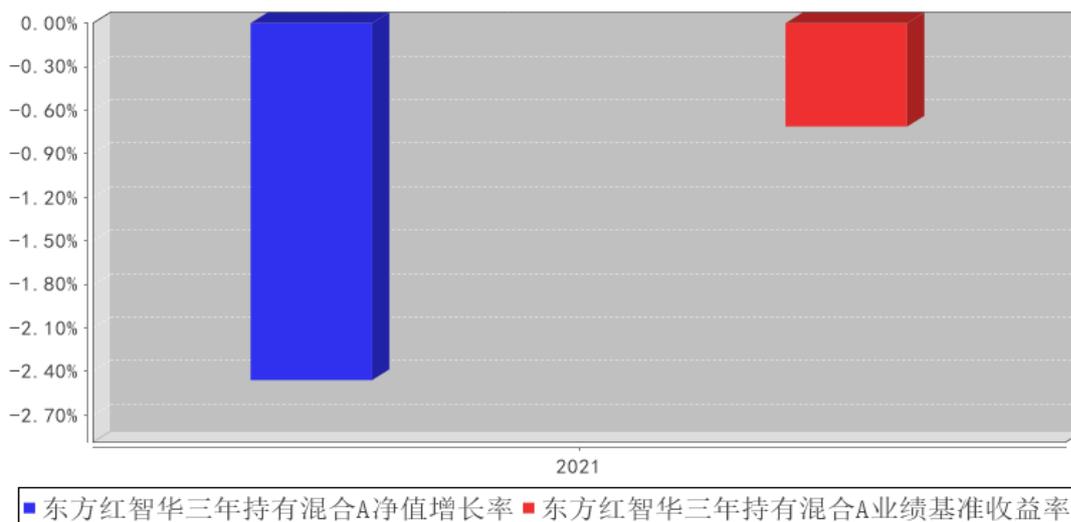


注：1、本基金合同于 2021 年 8 月 18 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

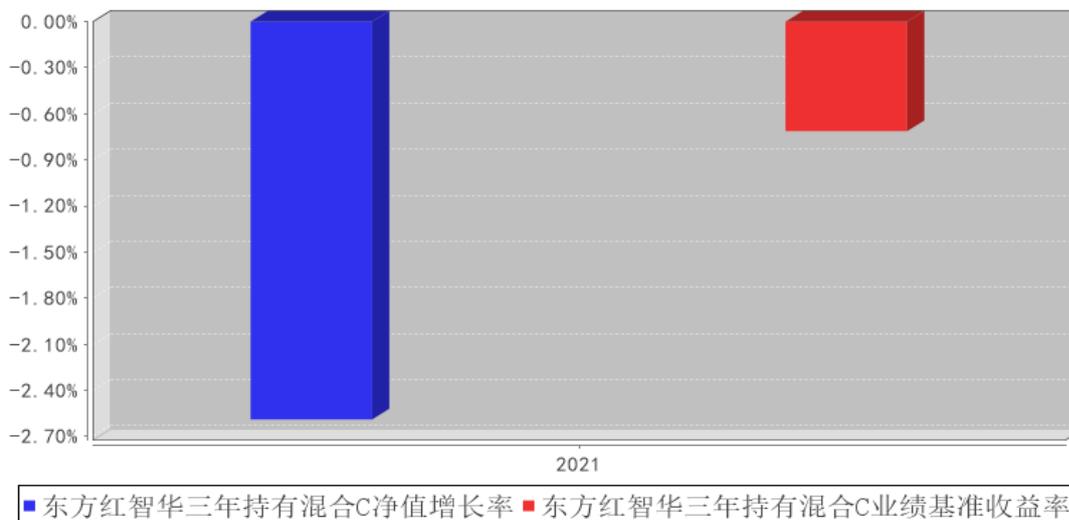
2、本基金建仓期 6 个月，即从 2021 年 8 月 18 日起至 2022 年 2 月 17 日，至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红智华三年持有混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



东方红智华三年持有混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日期为 2021 年 8 月 18 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自基金合同生效以来未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人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 12 月 31 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、

东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红新源三年持有期混合型证券投资基金、东方红新海混合型证券投资基金、东方红智华三年持有期混合型证券投资基金、东方红智选三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿和三年定期开放混合型证券投资基金、东方红启兴三年持有期混合型证券投资基金、东方红中证东方红红利低波动指数证券投资基金共计 78 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		
李响	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2021 年 8 月 18 日	-	13 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2018 年 03 月至今任东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(原东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金)基金经理、2019 年 07 月至 2020 年 11 月任东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金经理、2021 年 08 月至今任东方红智华三年持有期混合型证券投资基金基金经理。复旦大学金融学硕士。曾任东方证券资产管理业务总部研究员，上海东方证券资产管理有限公司行业研究员、投资主办人、权益研究部副总经理（主持工作）、权益研究部总经理。具备证券投资基金从业资格。

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。公司旗下投资组合的交易执行过程和投资决策过程相互分离，公司的交易实行集中交易制度，各投资组合的所有证券交易活动均须通过交易部集中统一完成。公司建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析，校验公平交易执行情况。对于同向交易，风险管理部侧重于对公司管理的不同产品（包含了公募产品、私募产品）的整体收益率差异、投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差按两两组合进行显著性检验，并根据显著性检验结果，对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录，通过逐笔检查或抽样分析的方法，分析相应交易行为的公平性。对于反向交易，原则上禁止组合间的日内反向交易，完全按照有关指数构成比例进行投资的投资组合除外。如有投资策略或流动性等特殊需要的，需由投资经理提供投资依据，经投资决策委员会审慎审批后留档备查。本年度未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2021 年资本市场的表现体现了疫情对全球经济持续反复影响下带来的艰难复杂的外部环境以及内部转型调整带来的跌宕起伏。从市场的主要指数全年表现来看，沪深 300 下跌 5.2%，上证

指数上涨 4.8%，恒生指数下跌 14.1%，虽显稳健但实则结构表现差异极端。2021 年整体为相对复杂的一年。市场的结构性体现了冰火两重天，一方面在疫情的扰动下，全球流动性充裕但全球供应链遇到了前所未有的挑战，国内疫情控制有效使得中国的世界制造中心的优势发挥得淋漓尽致，出口成为拉动经济增长的主要驱动因素。但国内经济受到疫情管控及出行减少的影响，消费服务行业持续受到重创。另一方面，能源结构调整及共同富裕的大背景下，产业结构发生了翻天覆地的变化。在碳中和底层政治基础的前提下，以新能源汽车、光伏为代表的清洁能源大发展带来波澜壮阔的产业链发展热潮，同时传统高耗能行业节能减排背景下产能和需求的错配对能源价格形成影响和扰动。疫情后期流动性充裕背景下及能源结构转型带来的上游大宗原材料价格大幅上涨对中游制造业形成了较大的压力，地产景气度下行带来的经济影响加剧了中游的压力。第三，在共同富裕背景下，对垄断行业的政策变化成为贯穿全年的主线，全年恒生科技指数下跌 32.7%，美国中概股下跌 47.8%。

2021 年基金运作层面，对宏观经济下行的预期体现的不够充分。在房地产行业对经济下行压力的预期判断显得不够充分。在持仓选股上用中长期视角，看中企业的竞争力及复杂外部环境下企业壁垒的持续扩大，但在外部环境加速下行的背景下，未能抵抗住下行周期的行业贝塔。

但管理人相信投资仍然要坚持长期视角，坚持深度研究，用企业的竞争力化解短期市场的不确定性及波动。将更加努力完善自上而下的知识结构，在复杂的外部环境下砥砺前行。

#### 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 0.9754 元，份额累计净值为 0.9754 元；C 类份额净值为 0.9741 元，份额累计净值为 0.9741 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-2.46%，同期业绩比较基准收益率为-0.71%；C 类份额净值增长率为-2.59%，同期业绩比较基准收益率为-0.71%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年的宏观基调为稳增长，在此背景下能源结构变化的大方向并未发生变化，但节奏预计会有所变化。同时，传统基建的适度提前及新基建的加大力度降为稳增长提供支持。疫情的扰动在 2022 年仍然是影响经济的主要因素之一，海外经济扩张政策随着疫情放开而接近尾声，使得海外的政策目标进入信用收缩阶段，但国内疫情的反复仍然对国内经济带来压力。同时，大宗商品的价格走势仍然是经济的最大不确定因素。相信 2022 年政策效果逐渐落地的过程中，整体经济将体现为前低后高。上游的通胀压力能否顺利传导将成为不同板块及经济走势的重要因素。

管理人坚信国运，虽然这几年复杂的外部环境和疫情对很多行业带来了很大的挑战和扰动。但我们仍然坚信和认可经济转型的短期痛苦将为长期的持续繁荣奠定更坚实的基础。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司日常监察稽核工作主要由合规稽核部和风险管理部根据职责分工开展，2021 年开展了如下主要工作：

在合规管理履职方面：（1）切实履行日常合规管理职责，包括合规审查、合规宣导、合规培训、合规报告、合规咨询、合规检查/稽核、监管沟通与配合；（2）持续加强员工执业行为管理，包括持续督促和指导员工及时完成投资申报工作，进一步完善即时通讯工具管控，进一步加强合规监测工作，以及建立员工手机下单行为合规检查机制；（3）提升反洗钱工作有效性，牵头修订反洗钱内控制度及操作规程，按时完成各类反洗钱工作报告及报表，推动反洗钱系统改造升级；（4）稳步跟进各类法律事务；（5）深入开展合规专题研究。

在风险管理履职方面：（1）切实履行日常风险管理职责，做到事前、事中、事后风险管理，按时完成内外部各类定期风控报告及数据报送；（2）深入梳理内部风控规则及操作流程，针对各类业务的内部风险控制措施积极进行梳理，牵头讨论确定具体方案并推进落实；（3）流程方面，为提高工作效率，对信息披露流程、债券交易偏离度审批、系统参数变更申请等流程进行了优化。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P00729 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方红智华三年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东方红智华三年持有期混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了东方红智华三年持有期混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东方红智华三年持有期混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括东方红智华三年持有期混合型证券投资基金 2021 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估东方红智华三年持有期混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算东方红智华三年持有期混合型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督东方红智华三年持有期混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报</p>

	<p>风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东方红智华三年持有期混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方红智华三年持有期混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	史曼   何淑婷
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2021 年 03 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方红智华三年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	277,417,618.13
结算备付金		6,160,505.69
存出保证金		792,187.63
交易性金融资产	7.4.7.2	3,667,465,948.55

其中：股票投资		3,667,465,948.55
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		11,820,878.24
应收利息	7.4.7.5	28,699.05
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		3,963,685,837.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		175.86
应付赎回款		-
应付管理人报酬		5,033,225.37
应付托管费		838,870.89
应付销售服务费		25,708.45
应付交易费用	7.4.7.7	1,204,949.32
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	106,000.00
负债合计		7,208,929.89
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	4,056,483,831.25
未分配利润	7.4.7.10	-100,006,923.85
所有者权益合计		3,956,476,907.40
负债和所有者权益总计		3,963,685,837.29

注：1、本基金合同生效日为 2021 年 08 月 18 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 08 月 18 日起至 2021 年 12 月 31 日止。报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 4,056,483,831.25 份，其中东方红智华三年持有混合 A 基金份额总额 3,967,586,684.02 份，基金份额净值 0.9754 元。东方红智华三年持有混合 C 基金份额总额 88,897,147.23 份，基金份额净值 0.9741 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间，无上年度末可比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红智华三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 8 月 18 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		-64,678,654.30
1. 利息收入		3,493,003.58
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,286,835.66
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		206,167.92
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-61,526,093.72
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-61,874,646.83
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	348,553.11
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-6,645,564.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
减：二、费用		35,328,269.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	21,641,157.87
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,606,859.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	110,591.89
4. 交易费用	7.4.7.19	9,857,454.29
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	112,205.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-100,006,923.85
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-100,006,923.85
-------------------	--	-----------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红智华三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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）	4,056,483,831.25	-	4,056,483,831.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-100,006,923.85	-100,006,923.85
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,056,483,831.25	-100,006,923.85	3,956,476,907.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

东方红智华三年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人上海东方

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》、《东方红智华三年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2021]1595号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据认购、申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为4,056,483,831.25份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第00427号验资报告。基金合同于2021年8月18日正式生效。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《东方红智华三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票及存托凭证(含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、可分离交易可转换债券的纯债部分、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、股票期权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)。本基金可根据法律法规和基金合同的约定,参与融资融券业务中的融资业务。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:本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例不低于基金资产的60%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%);本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权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%。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×60%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)×20%+中国债券总指数收益率×20%。

本基金的财务报表于2022年3月29日已经本基金的基金管理人批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露

方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

##### 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入

当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的可观察资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值

技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### - 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。

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

##### - 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

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

#### - 公允价值变动收益

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产款支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配;

2) 收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金分红或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4) 本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权,由于本基金各类基金份额收取销售服务费情况不同,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同;

5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非

货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3%的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资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, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不计缴企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股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。基金通过港股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) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	277,417,618.13
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	277,417,618.13

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,674,111,512.71	3,667,465,948.55	-6,645,564.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,674,111,512.71	3,667,465,948.55	-6,645,564.16

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

##### 7.4.7.4 买入返售金融资产

###### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	24,806.04
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	3,532.58
应收债券利息	-
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	360.43
合计	28,699.05

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,204,949.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,204,949.32

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	106,000.00
合计	106,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东方红智华三年持有混合 A

项目	本期
----	----

	2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,967,586,684.02	3,967,586,684.02
本期申购	-	-
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	3,967,586,684.02	3,967,586,684.02

东方红智华三年持有混合 C

项目	本期 2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	88,897,147.23	88,897,147.23
本期申购	-	-
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	88,897,147.23	88,897,147.23

注：本基金(A类)合同生效日为2021年8月18日。本基金(A类)在募集期间有效净认购资金共计3,966,782,329.84元，折合基金份额3,966,782,329.84份，产生的利息收入804,354.18元，折合基金份额804,354.18份，划入基金份额持有人账户。本基金(C类)合同生效日为2021年8月18日。本基金(C类)在募集期间有效净认购资金共计88,881,876.97元，折合基金份额88,881,876.97份，产生的利息收入15,270.26元，折合基金份额15,270.26份，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东方红智华三年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-91,208,332.53	-6,497,219.17	-97,705,551.70
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申	-	-	-

购款			
基金赎回款			
本期已分配利润			
本期末	-91,208,332.53	-6,497,219.17	-97,705,551.70

东方红智华三年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日			
本期利润	-2,153,027.16	-148,344.99	-2,301,372.15
本期基金份额交易产生的变动数			
其中：基金申购款			
基金赎回款			
本期已分配利润			
本期末	-2,153,027.16	-148,344.99	-2,301,372.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	1,324,844.57
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	1,951,103.11
其他	10,887.98
合计	3,286,835.66

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-61,874,646.83
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	-61,874,646.83

#### 7.4.7.12.2 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8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,930,774,106.57
减：卖出股票成本总额	1,992,648,753.40
买卖股票差价收入	-61,874,646.83

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	348,553.11
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	348,553.11

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-6,645,564.16
股票投资	-6,645,564.16

债券投资	-
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	-6,645,564.16

#### 7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	9,857,454.29
银行间市场交易费用	-
合计	9,857,454.29

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	56,000.00
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	6,205.84
合计	112,205.84

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
东方证券	5,389,995,210.50	71.37

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东方证券	1,329,600,000.00	100.00

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
东方证券	3,924,390.88	71.18	593,344.77	49.24

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,641,157.87
其中：支付销售机构的客户维护费	9,481,374.51

注：1、支付基金管理人东证资管基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,606,859.66

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期

方名称	2021 年 8 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红智华三年持有混 合 A	东方红智华三年持有混 合 C	合计
东方证券	-	1,070.10	1,070.10
东证资管	-	20,321.30	20,321.30
中国建设银行	-	15,600.75	15,600.75
合计	-	36,992.15	36,992.15

注：根据基金合同的规定，东方红智华三年持有混合 A 不收取销售服务费，东方红智华三年持有混合 C 的销售服务费按基金前一日的资产净值×0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：东方红智华三年持有混合 C 的日销售服务费=前一日东方红智华三年持有混合 C 资产净值×0.35%÷当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

注：本基金本报告期内无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。

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

注：本基金本报告期内无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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年8月18日（基金合同生效日）至2021年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	277,417,618.13	1,324,844.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，存出保证金不计息。于2021年12月31日，本基金的结算备付金余额为1,786,552.59元，无存出保证金余额。于2021年08月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日，本基金当期结算备付金利息收入1,807,016.97元。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021	2022	新股	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-

	王	年9月 30日	年4月 14日	锁定						
301079	邵阳 液压	2021 年10 月11 日	2022 年4月 19日	新股 锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301082	久盛 电气	2021 年10 月14 日	2022 年4月 27日	新股 锁定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301096	百诚 医药	2021 年12 月13 日	2022 年6月 20日	新股 锁定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301100	风光 股份	2021 年12 月10 日	2022 年6月 17日	新股 锁定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301108	洁雅 股份	2021 年11 月25 日	2022 年6月 6日	新股 锁定	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万 年青	2021 年11 月30 日	2022 年6月 7日	新股 锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301126	达嘉 维康	2021 年11 月30 日	2022 年6月 7日	新股 锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301133	金钟 股份	2021 年11 月19 日	2022 年5月 26日	新股 锁定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标 股份	2021 年12 月31 日	2022 年1月 11日	新股 未上 市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研 精机	2021 年12 月8日	2022 年6月 15日	新股 锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301166	优宁 维	2021 年12 月21	2022 年6月 28日	新股 锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-

		日								
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股锁定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股锁定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年7月7日	新股锁定	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688737	中自科技	2021年10月14日	2022年4月22日	新股锁定	70.90	55.06	2,186	154,987.40	120,361.16	-
689009	九号公司	2021年11月10日	2022年5月10日	非公开转让	57.00	64.58	600,000	34,200,000.00	38,748,000.00	-

		日							
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；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；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

#### 7.4.13.2 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建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 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内每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于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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算）不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

本基金所持证券均在证券交易所上市，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 7.4.12。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 12 月 31 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%。

于开放期内，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。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	277,417,618.13	-	-	-	-	277,417,618.13
结算备付金	6,160,505.69	-	-	-	-	6,160,505.69
存出保证金	792,187.63	-	-	-	-	792,187.63
交易性金融资产	-	-	-	-	3,667,465,948.55	3,667,465,948.55
应收利息	-	-	-	-	28,699.05	28,699.05
应收证券清算款	-	-	-	-	11,820,878.24	11,820,878.24
资产总计	284,370,311.45	-	-	-	3,679,315,525.84	3,963,685,837.29
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,033,225.37	5,033,225.37
应付托管费	-	-	-	-	838,870.89	838,870.89
应付证券清算款	-	-	-	-	175.86	175.86
应付销售服务费	-	-	-	-	25,708.45	25,708.45
应付交易费用	-	-	-	-	1,204,949.32	1,204,949.32
其他负债	-	-	-	-	106,000.00	106,000.00
负债总计	-	-	-	-	7,208,929.89	7,208,929.89
利率敏感度缺口	284,370,311.45	-	-	-	3,672,106,595.95	3,956,476,907.40

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	733,073,131.23	-	733,073,131.23
资产合计	-	733,073,131.23	-	733,073,131.23
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	733,073,131.23	-	733,073,131.23

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外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12月31日）
分析	1、港币相对人民币升值 5%	36,653,656.56
	2、港币相对人民币贬值 5%	-36,653,656.56

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,667,465,948.55	92.70
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	3,667,465,948.55	92.70

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日)
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	208,632,134.72
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-208,632,134.72

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

#### 7.4.14 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) 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。

##### (b) 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 12 月 31 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人民币 3,626,985,476.96 元, 属于第二层次的余额为人民币 1,253,239.55 元, 属于第三层次的余额为人民币 39,227,232.04 元。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别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根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

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人民币 39,227,232.04 元。本基金本期净转入第三层次的金额为人民币 34,664,137.79 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为人民币 4,563,094.25 元。

于 2021 年 12 月 31 日本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为交易所市场上市交易但尚在限售期内的股票投资)公允价值为人民币 39,227,232.04 元，采用平均价格亚式期权模型作为估值技术进行估值，不可观察输入值为该流通受限股票在剩余限售期内的股价的预期平均波动率，与公允价值之间呈负相关关系。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,667,465,948.55	92.53
	其中：股票	3,667,465,948.55	92.53
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	283,578,123.82	7.15
8	其他各项资产	12,641,764.92	0.32
9	合计	3,963,685,837.29	100.00

注：1、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 733,073,131.23 元人民币，占期末基金资产净值比例 18.53%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	31,947,764.80	0.81
C	制造业	2,831,399,272.07	71.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	137,751.96	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,801,897.09	1.79
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	96,809.60	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	2,934,392,817.32	74.17

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	205,799,555.42	5.20
30 主要消费	334,870,400.48	8.46
35 医药卫生	-	-
40 金融	38,238,808.61	0.97
45 信息技术	-	-
50 通信服务	154,164,366.72	3.90
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	733,073,131.23	18.53

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	7,266,900	357,531,480.00	9.04
2	000858	五粮液	1,576,115	350,937,765.90	8.87
3	601100	恒立液压	4,125,510	337,466,718.00	8.53
4	00291	华润啤酒	6,400,000	334,104,064.00	8.44
5	002415	海康威视	5,393,290	282,176,932.80	7.13
6	000568	泸州老窖	987,708	250,749,429.96	6.34
7	002311	海大集团	3,001,000	219,973,300.00	5.56
8	688002	睿创微纳	2,285,591	179,578,884.87	4.54
9	000596	古井贡酒	661,919	161,508,236.00	4.08
10	00941	中国移动	4,029,000	154,164,366.72	3.90
11	002180	纳思达	3,072,300	146,733,048.00	3.71
12	600031	三一重工	4,495,124	102,488,827.20	2.59
13	02020	安踏体育	721,200	68,930,449.73	1.74
14	03690	美团-W	371,500	68,462,635.36	1.73
15	688078	龙软科技	1,017,096	59,194,987.20	1.50
16	688017	绿的谐波	284,095	49,591,623.20	1.25
17	600519	贵州茅台	21,000	43,050,000.00	1.09
18	600019	宝钢股份	5,826,472	41,717,539.52	1.05
19	300487	蓝晓科技	406,100	39,939,935.00	1.01
20	300083	创世纪	2,780,400	39,704,112.00	1.00
21	689009	九号公司	600,000	38,748,000.00	0.98
22	00388	香港交易所	102,700	38,238,808.61	0.97

23	000733	振华科技	289,700	36,003,916.00	0.91
24	02331	李宁	507,500	35,414,446.20	0.90
25	601899	紫金矿业	3,293,584	31,947,764.80	0.81
26	00175	吉利汽车	1,702,000	29,640,125.76	0.75
27	688798	艾为电子	129,201	27,907,416.00	0.71
28	688022	瀚川智能	370,346	24,102,117.68	0.61
29	300776	帝尔激光	84,700	21,674,730.00	0.55
30	605499	东鹏饮料	105,400	19,165,936.00	0.48
31	688533	上声电子	334,325	18,678,737.75	0.47
32	688690	纳微科技	202,694	16,179,035.08	0.41
33	688088	虹软科技	253,270	11,159,076.20	0.28
34	300747	锐科激光	133,370	7,883,500.70	0.20
35	002705	新宝股份	297,000	7,335,900.00	0.19
36	600809	山西汾酒	20,600	6,505,068.00	0.16
37	01691	JS 环球生活	312,000	3,351,898.37	0.08
38	688235	百济神州	19,217	2,777,048.67	0.07
39	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.02
40	01579	颐海国际	26,000	766,336.48	0.02
41	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
42	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.00
43	688737	中自科技	2,186	120,361.16	0.00
44	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.00
45	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
46	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
47	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
48	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
49	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
50	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
51	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
52	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
53	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
54	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
55	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
56	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
57	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
58	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
59	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
60	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
61	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
62	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
63	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
64	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00

65	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
66	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
67	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
68	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600031	三一重工	481,928,636.33	12.18
2	601100	恒立液压	424,606,215.40	10.73
3	000858	五粮液	382,167,154.70	9.66
4	00291	华润啤酒	340,351,586.04	8.60
5	688002	睿创微纳	322,095,783.34	8.14
6	002475	立讯精密	316,664,311.63	8.00
7	002415	海康威视	287,355,040.39	7.26
8	002311	海大集团	248,267,189.18	6.27
9	02020	安踏体育	237,990,957.40	6.02
10	000568	泸州老窖	218,782,672.89	5.53
11	601899	紫金矿业	196,255,595.34	4.96
12	03690	美团-W	190,824,677.01	4.82
13	00941	中国移动	188,256,148.18	4.76
14	000596	古井贡酒	160,754,331.30	4.06
15	600019	宝钢股份	158,840,456.94	4.01
16	600519	贵州茅台	142,094,315.31	3.59
17	002180	纳思达	120,222,411.61	3.04
18	002390	信邦制药	92,882,119.00	2.35
19	603233	大参林	81,132,465.84	2.05
20	300750	宁德时代	76,845,425.00	1.94

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。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600031	三一重工	335,230,662.13	8.47
2	02020	安踏体育	164,159,589.99	4.15
3	601899	紫金矿业	139,510,892.31	3.53
4	600019	宝钢股份	123,469,560.67	3.12
5	03690	美团-W	121,818,143.71	3.08
6	600519	贵州茅台	117,893,082.71	2.98
7	300750	宁德时代	93,049,630.00	2.35

8	01810	小米集团-W	71,301,158.95	1.80
9	603233	大参林	70,605,440.29	1.78
10	002390	信邦制药	66,798,820.63	1.69
11	002311	海大集团	57,507,573.00	1.45
12	002475	立讯精密	51,425,588.09	1.30
13	000858	五粮液	42,443,009.34	1.07
14	603993	洛阳钼业	42,262,956.87	1.07
15	000630	铜陵有色	39,553,936.00	1.00
16	603939	益丰药房	39,267,756.20	0.99
17	600702	舍得酒业	39,245,684.00	0.99
18	601100	恒立液压	38,745,319.26	0.98
19	002049	紫光国微	37,329,862.14	0.94
20	688002	睿创微纳	33,756,509.95	0.85

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,666,760,266.11
卖出股票收入（成交）总额	1,930,774,106.57

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行股指期货投资。

##### 8.10.2 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原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货

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，以获取相应股票组合的超额收益。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	792,187.63
2	应收证券清算款	11,820,878.24
3	应收股利	-
4	应收利息	28,699.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,641,764.92

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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未存在流通受限情况。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
东方红智华三年持有混合 A	40,902	97,002.27	18,887,602.67	0.48	3,948,699,081.35	99.52
东方红智华三年持有混合 C	3,297	26,963.04	-	-	88,897,147.23	100.00
合计	44,199	91,777.73	18,887,602.67	0.47	4,037,596,228.58	99.53

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）。

### 9.2 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	东方红智华三年持有混合 A	183,825.78	0.00
	东方红智华三年持有混合 C	1,065,887.38	1.20
	合计	1,249,713.16	0.03

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）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	东方红智华三年持有混合 A	0
	东方红智华三年持有混合 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红智华三年持有混合 A	0
	东方红智华三年持有混合 C	0
	合计	0

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

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。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红智华三年持有混合 A	东方红智华三年持有混合 C
基金合同生效日 (2021 年 8 月 18 日) 基金份额总额	3,967,586,684.02	88,897,147.23
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	-	-
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份 额总额	3,967,586,684.02	88,897,147.23

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

饶刚同志于 2021 年 3 月 12 日起不再担任本基金管理人的副总经理职务；张锋同志自 2021 年 8 月 20 日起担任本基金管理人的总经理职务，同时任莉同志不再担任总经理职务；胡雅丽

同志于 2021 年 9 月 24 日起担任本基金管理人的联席总经理职务。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 11.5 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德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 5.6 万元人民币

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	4	5,389,995,210.50	71.37%	3,924,390.88	71.18%	-
中泰证券	1	1,464,112,140.13	19.39%	1,042,664.60	18.91%	-
招商证券	1	558,934,790.22	7.40%	447,147.84	8.11%	-
德邦证券	2	139,081,120.23	1.84%	98,936.60	1.79%	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

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

(2) 选择程序

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

3、本基金合同生效日为 2021 年 8 月 18 日，上述交易单元均为本报告期新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	1,329,600,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 1 月 8 日
2	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、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 3 月 13 日
3	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、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电	2021 年 6 月 22 日

		子披露网站、公司官网	
4	东方红智华三年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 7 月 21 日
5	东方红智华三年持有期混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 7 月 21 日
6	东方红智华三年持有期混合型证券投资基金托管协议	中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 7 月 21 日
7	东方红智华三年持有期混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 7 月 21 日
8	东方红智华三年持有期混合型证券投资基金基金合同	中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 7 月 21 日
9	东方红智华三年持有期混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 7 月 21 日
10	关于东方红智华三年持有期混合型证券投资基金增加部分渠道为代理销售机构的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 7 月 30 日
11	关于东方红智华三年持有期混合型证券投资基金增加部分渠道为代理销售机构的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 8 月 5 日
12	关于东方红智华三年持有期混合型证券投资基金增加上海东证期货有限公司为代理销售机构的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 8 月 6 日
13	关于东方红智华三年持有期混合型证券投资基金增加中国银行股份有限公司为代理销售机构的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 8 月 9 日
14	关于东方红智华三年持有期混合型证券投资基金增加华夏银行股份有限公司为代理销售机构的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 8 月 12 日
15	关于东方红智华三年持有期混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 8 月 12 日
16	东方红智华三年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 8 月 19 日
17	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、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 8 月 21 日
18	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、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 9 月 25 日
19	上海东方证券资产管理有限公司关于	上海证券报、中国证券	2021 年 11 月 3 日

	旗下基金在直销平台开展机构客户费率优惠活动的公告	报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	
20	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所股票的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 11 月 19 日
21	上海东方证券资产管理有限公司关于设立北京分公司的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 12 月 2 日
22	上海东方证券资产管理有限公司关于提醒直销平台投资者及时完善、更新身份资料信息的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 12 月 10 日
23	上海东方证券资产管理有限公司关于公司网上直销平台暂停服务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 12 月 22 日
24	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代理销售机构的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 12 月 24 日
25	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2021 年底及 2022 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 12 月 28 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红智华三年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红智华三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红智华三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红智华三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。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

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

上海东方证券资产管理有限公司

2022 年 3 月 31 日