

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）  
2022 年中期报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 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合规守信情况的说明              | 10        |
| 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             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 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 | 12        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b>             | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产 (基金净值) 变动表                      | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>45</b> |
| 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       | 46        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 46        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 47        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 47        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 47        |
| 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 ..... | 47        |
| 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 .....    | 47        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 47        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 47        |
| 7.12 本报告期投资基金情况 .....                       | 47        |
| 7.13 投资组合报告附注 .....                         | 50        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51        |
| 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 .....      | 51        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>52</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>52</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 52        |
| 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 .....      | 52        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 52        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....               | 52        |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 53        |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 53        |
| 10.9 其他重大事件 .....                           | 56        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>57</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 57        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 58        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>58</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 58        |
| 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       | 东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金 (FOF) |
| 基金简称       | 东方红颐 and 稳健养老两年 (FOF)              |
| 基金主代码      | 009174                             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式, 但本基金对每份基金份额设置两年锁定持有期       |
| 基金合同生效日    | 2020 年 6 月 24 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      | 中国工商银行股份有限公司                       |
| 报告期末基金份额总额 | 165,965,554.40 份                   |
| 基金合同存续期    | 不定期                                |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                               |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金是稳健型养老目标风险基金中基金, 依照目标风险进行稳健的大类资产配置, 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   | 本基金是一只稳健的养老目标风险策略基金。在设定的投资范围及风险目标下, 通过定量和定性的结合分析实现基金的资产配置。同时, 根据宏观经济、资本市场的动量因素和事件驱动做出资产动态调整决策。                                                                |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*18%+恒生指数收益率*2%+中国债券总指数收益率*75%+银行活期存款利率 (税后) *5%                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金, 是目标风险型基金, 且投资风格为稳健型, 其预期收益及风险水平高于货币市场基金、货币市场基金中基金、债券型基金及债券型基金中基金, 低于股票型基金和股票型基金中基金。<br>本基金将投资港股通标的股票, 需承担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               | 中国工商银行股份有限公司      |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                           | 周陶                |
|             | 联系电话                         | 021-53950806      |
|             | 电子邮箱                         | service@dfham.com |
| 客户服务电话      | 4009200808                   | 95588             |
| 传真          | 021-63326381                 | 010-66105798      |
| 注册地址        | 上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层    | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址        | 上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码        | 200010                       | 100140            |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 宋雪枫 | 陈四清 |
|-------|-----|-----|

## 2.4 信息披露方式

|                     |                     |
|---------------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报                |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.dfham.com       |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市黄浦区外马路 108 号 7 层 |

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -1,885,064.35                       |
| 本期利润          | -2,479,553.47                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0113                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -1.07%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.96%                              |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 9,877,532.24                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0595                              |
| 期末基金资产净值      | 177,205,636.77                      |
| 期末基金份额净值      | 1.0677                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 6.77%                               |

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | 0.79%  | 0.16% | 1.52%  | 0.21% | -0.73% | -0.05% |
| 过去三个月      | 1.13%  | 0.16% | 1.19%  | 0.28% | -0.06% | -0.12% |
| 过去六个月      | -0.96% | 0.20% | -1.84% | 0.30% | 0.88%  | -0.10% |
| 过去一年       | 1.10%  | 0.19% | -1.63% | 0.26% | 2.73%  | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.77%  | 0.17% | 3.12%  | 0.25% | 3.65%  | -0.08% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*18%+恒生指数收益率\*2%+中国债券总指数收益率\*75%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

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

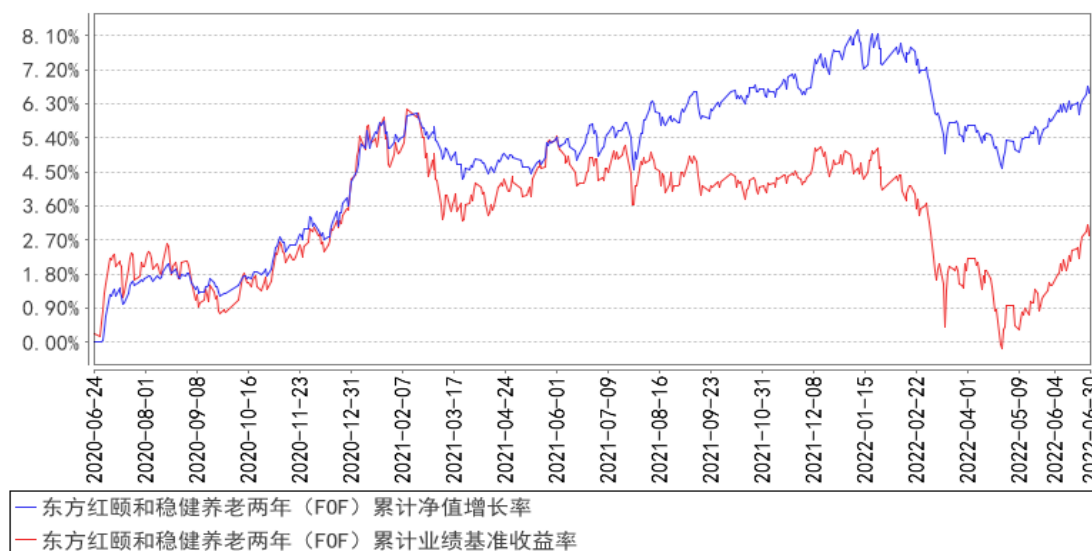
$$\text{benchmark}_t = 18\% * [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 2\% * [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1 日恒生指数}) - 1] + 75\% * [\text{t 日中国债券总指数} / (\text{t-1 日中国债券总指数}) - 1] + 5\% * [\text{t 日银行活期存款利率 (税后)} / 365];$$

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

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

### 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

东方红颐 and 稳健养老两年 (FOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、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、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、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、东方红沪港深灵活配置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、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券



投资基金（LOF）、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置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、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、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、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深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、东方红创新优选三年定期开放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、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、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、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、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、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红优质甄选一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）、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、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）、东方红鑫泰 66 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、东方红鑫安 39 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、东方红启航三年持有期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、东方红锦丰优选两年定期开放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、东方红启瑞三年持有期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）、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红创新趋势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、东方红启恒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、东方红启程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、东方红新源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、东方红锦和甄选 18 个月持有期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、东方红启兴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、东方红中证东方红红利低波动指数证券投资基金、东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金、东方红 ESG 可持续投资混合型证券投资基金、东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红医疗升级股票型发起式证券投资基金、东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红短债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金共计 85 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 陈文扬 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理 | 2020 年 6 月 24 日 | -    | 12 年   | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2020 年 06 月至今任 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）基金经理、2020 年 06 月至今任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）基金经理、2020 年 06 月至今任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）基金经理、2021 年 03 月至今任东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。上海财经大学金融学硕士。曾任上海国利货币经纪有限公司利率衍生产品部经纪人，宁波银行股份有限公司金融市场部交易员，南京银行股份有限公司金融市场部高级投资经理，上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究员、投资主办人。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的相关规定。

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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金是配置 10%-25% 比例权益类资产的养老目标 FOF 基金。我们的目标是通过大类资产配置和基金精选，在控制回撤的前提下，为持有人的养老储备争取稳健的投资回报。

上半年市场出现了比较罕见的大波动 V 型走势，下跌幅度大，反弹幅度也大。在这个过程中，产品净值一度回撤到我们心中的安全线附近。我们还是抱着谨慎的态度进行了减仓操作，在反弹中的参与也比较谨慎。

虽然上半年的走势不理想，但考虑权益资产的估值与历史相比处于比较低的位置，我们认为下半年开始乃至明年都是布局的好时机，有较多的定价不贵的资产给我们提供增厚收益的机会。下半年我们将在房地产产业链、交运、线下消费、互联网等领域寻找合适的资产。

#### 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 1.0677 元，份额累计净值为 1.0677 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.96%，业绩比较基准收益率为-1.84%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们预期内需方面稍有压力，但会获得基建和出口需求的有利支持，整体看经济将会平稳运行。

一些符合国家大政方针的方向，如新能源、军工等产业需求会继续保持稳健。

内需为主的行业有望在当前水平保持稳定。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）的管理人——上海东方证券资产管理有限公司在东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）未进行利润分配。

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

本托管人依法对上海东方证券资产管理有限公司编制和披露的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）2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 68,144,840.36                  | 1,663,847.99                     |
| 结算备付金         |            | 123,414.35                     | 341,111.93                       |
| 存出保证金         |            | 26,927.48                      | 28,098.43                        |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 143,906,098.63                 | 234,632,778.57                   |
| 其中：股票投资       |            | -                              | 23,915,390.00                    |
| 基金投资          |            | 143,906,098.63                 | 210,500,388.57                   |
| 债券投资          |            | -                              | 217,000.00                       |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | 22,991,862.65                  | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | 267,401.10                       |
| 应收申购款         |            | 4,365.43                       | 1,548.80                         |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | 119,401.25                     | 44,317.98                        |
| 资产总计          |            | 235,316,910.15                 | 236,979,104.80                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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      | 6.4.7.3  | -              | -              |
| 卖出回购金融资产款   |          | -              | -              |
| 应付清算款       |          | -              | -              |
| 应付赎回款       |          | 57,892,699.84  | -              |
| 应付管理人报酬     |          | 59,458.53      | 56,921.17      |
| 应付托管费       |          | 21,691.11      | 22,741.47      |
| 应付销售服务费     |          | -              | -              |
| 应付投资顾问费     |          | -              | -              |
| 应交税费        |          | -              | -              |
| 应付利润        |          | -              | -              |
| 递延所得税负债     |          | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 137,423.90     | 208,932.23     |
| 负债合计        |          | 58,111,273.38  | 288,594.87     |
| <b>净资产：</b> |          |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 165,965,554.40 | 219,559,604.65 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -              | -              |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | 11,240,082.37  | 17,130,905.28  |
| 净资产合计       |          | 177,205,636.77 | 236,690,509.93 |
| 负债和净资产总计    |          | 235,316,910.15 | 236,979,104.80 |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0677 元，基金份额总额 165,965,554.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 附注号      | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|-----------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
|                 |          | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| <b>一、营业总收入</b>  |          | -1,919,603.78                   | 3,647,998.49                    |
| 1. 利息收入         |          | 21,363.93                       | 160,743.71                      |
| 其中：存款利息收入       | 6.4.7.13 | 20,158.45                       | 30,188.52                       |
| 债券利息收入          |          | -                               | 96.03                           |
| 资产支持证券利息收入      |          | -                               | -                               |
| 买入返售金融资产收入      |          | 1,205.48                        | 130,459.16                      |
| 证券出借利息收入        |          | -                               | -                               |
| 其他利息收入          |          | -                               | -                               |
| 2. 投资收益（损失以“-”填 |          | -1,422,109.65                   | 6,448,821.64                    |

|                                 |            |               |               |
|---------------------------------|------------|---------------|---------------|
| 列)                              |            |               |               |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.14   | -2,817,587.65 | 236,605.88    |
| 基金投资收益                          | 6.4.7.15   | -1,095,337.03 | 4,396,474.34  |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.16   | 23,214.00     | 2,532.64      |
| 资产支持证券投资收<br>益                  | 6.4.7.17   | -             | -             |
| 贵金属投资收益                         | 6.4.7.18   | -             | -             |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.19   | -             | -             |
| 股利收益                            | 6.4.7.20   | 2,467,601.03  | 1,813,208.78  |
| 以摊余成本计量的金<br>融资产终止确认产生的收益       |            | -             | -             |
| 其他投资收益                          |            | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失<br>以“-”号填列）      | 6.4.7.21   | -594,489.12   | -3,016,078.90 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号<br>填列）          |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号<br>填列）          | 6.4.7.22   | 75,631.06     | 54,512.04     |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 559,949.69    | 709,691.45    |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 338,156.41    | 361,035.69    |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 128,358.00    | 115,338.17    |
| 3. 销售服务费                        |            | -             | -             |
| 4. 投资顾问费                        |            | -             | -             |
| 5. 利息支出                         |            | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支<br>出               |            | -             | -             |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.24   | -             | -             |
| 7. 税金及附加                        |            | -             | -             |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.25   | 93,435.28     | 233,317.59    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以<br/>“-”号填列）</b> |            | -2,479,553.47 | 2,938,307.04  |
| 减：所得税费用                         |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |            | -2,479,553.47 | 2,938,307.04  |
| <b>五、其他综合收益的税后净<br/>额</b>       |            | -             | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | -2,479,553.47 | 2,938,307.04  |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|                                     | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |               |                |
|-------------------------------------|---------------------------------|--------|---------------|----------------|
|                                     | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                     | 219,559,604.65                  | -      | 17,130,905.28 | 236,690,509.93 |
| 加:会计政策变更                            | -                               | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                              | -                               | -      | -             | -              |
| 其他                                  | -                               | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                     | 219,559,604.65                  | -      | 17,130,905.28 | 236,690,509.93 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -53,594,050.25                  | -      | -5,890,822.91 | -59,484,873.16 |
| (一)、综合收益总额                          | -                               | -      | -2,479,553.47 | -2,479,553.47  |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -53,594,050.25                  | -      | -3,411,269.44 | -57,005,319.69 |
| 其中:1.基金申购款                          | 829,376.65                      | -      | 58,003.50     | 887,380.15     |
| 2.基金赎回款                             | -54,423,426.90                  | -      | -3,469,272.94 | -57,892,699.84 |
| (三)、                                | -                               | -      | -             | -              |



|                                      |                                 |        |               |                |
|--------------------------------------|---------------------------------|--------|---------------|----------------|
| 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) |                                 |        |               |                |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                     | -                               | -      | -             | -              |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                      | 165,965,554.40                  | -      | 11,240,082.37 | 177,205,636.77 |
| 项目                                   | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |        |               |                |
|                                      | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                      | 216,890,753.86                  | -      | 9,241,091.49  | 226,131,845.35 |
| 加:会计政策变更                             | -                               | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                               | -                               | -      | -             | -              |
| 其他                                   | -                               | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                      | 216,890,753.86                  | -      | 9,241,091.49  | 226,131,845.35 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                 | 1,428,322.18                    | -      | 3,013,743.92  | 4,442,066.10   |

|                                              |                |   |               |                |
|----------------------------------------------|----------------|---|---------------|----------------|
| （一）、<br>综合收益总额                               | -              | - | 2,938,307.04  | 2,938,307.04   |
| （二）、<br>本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 1,428,322.18   | - | 75,436.88     | 1,503,759.06   |
| 其中：1. 基金申购款                                  | 1,428,322.18   | - | 75,436.88     | 1,503,759.06   |
| 2. 基金赎回款                                     | -              | - | -             | -              |
| （三）、<br>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） | -              | - | -             | -              |
| （四）、<br>其他综合收益结转留存收益                         | -              | - | -             | -              |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                              | 218,319,076.04 | - | 12,254,835.41 | 230,573,911.45 |

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

东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金(FOF) (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[2019]2529号《关于准予东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金(FOF)注册的批复》准予注册,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 214,784,990.20 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 0426 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于 2020 年 6 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 214,884,595.47 份基金份额,其中认购资金利息折合 99,605.27 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。根据《东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定,本基金设置投资者最短持有期限为两年。对于每份基金份额,自基金合同生效之日(对认购份额而言,下同)起、自基金份额申购申请日(对申购份额而言,下同)起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)两年内锁定。在锁定期内,该份额不能赎回。自锁定期结束后第一个工作日(含)起,该份额可以赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定,本基金投资于依法发行或上市的公开募集证券投资基金、股票及存托凭证、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,具体包括:经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金(含 QDII 基金、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)、香港互认基金,下同)、股票及存托凭证(包含主板、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(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、永续债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、同业存单、现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合

中国证监会相关规定)。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。本基金的投资组合比例为:80%以上基金资产投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集;投资于权益类资产的战略配置比例为 20%,其中权益类资产为股票、存托凭证、股票型基金以及混合型基金。基金经理可以在符合本基金投资目标和投资策略的前提下,根据市场情况,对权益类资产的配置比例进行战术调整,但权益资产的向上、向下的战术调整幅度分别不得超过战略配置比例的 5%、10%,即权益类资产占基金资产的比例在 10%-25%之间。其中,计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一:1)基金合同约定股票资产(含存托凭证)投资比例不低于基金资产 50%的混合型基金;2)根据基金披露的定期报告,最近四个季度中任一季度股票资产(含存托凭证)占基金资产比例均不低于 50%的混合型基金。投资于股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等品种的比例合计不超过基金资产的 30%;投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。投资于商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)的比例不超过基金资产的 10%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,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。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 18%+恒生指数收益率 $\times$ 2%+中国债券总指数收益率 $\times$ 75%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金(FOF)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 2022 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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 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

除下述会计政策涉及变更外,本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报

告相一致。

### 1、金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 2、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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于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；对于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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 3、收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

## 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《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》及《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”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年半年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初

留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 1,663,847.99 元、341,111.93 元、28,098.43 元、547.79 元、267,401.10 元、1,548.80 元和 43,770.19 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 1,664,224.71 元、341,265.43 元、28,111.13 元、0.00 元、267,401.10 元、1,548.91 元和 43,770.19 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 234,632,778.57 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 234,632,783.33 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 56,921.17 元、22,741.47 元和 38,932.23 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 56,921.17 元、22,741.47 元和 38,932.23 元。

(ii) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 68,144,840.36          |
| 等于：本金          | 68,142,712.86          |
| 加：应计利息         | 2,127.50               |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 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           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 68,144,840.36          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |      |      |        |
|---------------|------------------------|------|------|--------|
|               | 成本                     | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票            | -                      | -    | -    | -      |
| 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     |    | 142,664,878.53 | - | 143,906,098.63 | 1,241,220.10 |
| 其他     |    | -              | - | -              | -            |
| 合计     |    | 142,664,878.53 | - | 143,906,098.63 | 1,241,220.10 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2022年6月30日 |
|-----------|-------------------|
| 应收利息      | -                 |
| 其他应收款     | -                 |
| 待摊费用      | -                 |
| 应收销售服务费返还 | 119,401.25        |
| 合计        | 119,401.25        |

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022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   | -                 |
| 应付交易费用      | 3,121.34          |
| 其中：交易所市场    | 3,121.34          |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 134,302.56        |
| 合计          | 137,423.90        |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 219,559,604.65             | 219,559,604.65 |
| 本期申购          | 829,376.65                 | 829,376.65     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -54,423,426.90             | -54,423,426.90 |
| 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           | 165,965,554.40             | 165,965,554.40 |

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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       |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 本期期初           | 15,268,632.91 | 1,862,272.37 | 17,130,905.28 |
| 本期利润           | -1,885,064.35 | -594,489.12  | -2,479,553.47 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,506,036.32 | 94,766.88    | -3,411,269.44 |
| 其中：基金申购款       | 54,445.05     | 3,558.45     | 58,003.50     |
| 基金赎回款          | -3,560,481.37 | 91,208.43    | -3,469,272.94 |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | 9,877,532.24  | 1,362,550.13 | 11,240,082.37 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 18,621.89                  |
| 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 | 1,287.99                   |
| 其他        | 248.57                     |
| 合计        | 20,158.45                  |

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -2,817,587.65              |
| 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               | -2,817,587.65              |

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 27,865,276.26              |
| 减：卖出股票成本总额 | 30,626,018.04              |

|          |               |
|----------|---------------|
| 减：交易费用   | 56,845.87     |
| 买卖股票差价收入 | -2,817,587.65 |

#### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------------------|----------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额           | 222,571,906.94             |
| 减：卖出/赎回基金成本总额         | 223,599,330.75             |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值<br>税额 | -                          |
| 减：交易费用                | 67,913.22                  |
| 基金投资收益                | -1,095,337.03              |

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                               | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                     | 16.17                      |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券<br>到期兑付）差价收入 | 23,197.83                  |
| 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                               | 23,214.00                  |

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                         | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总<br>额   | 240,219.00                 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成<br>本总额 | 217,000.00                 |
| 减：应计利息总额                   | 20.93                      |
| 减：交易费用                     | 0.24                       |
| 买卖债券差价收入                   | 23,197.83                  |

##### 6.4.7.16.3 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。

#### 6.4.7.16.4 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。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 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。

##### 6.4.7.18.2 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。

##### 6.4.7.18.3 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。

##### 6.4.7.18.4 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。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 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。

##### 6.4.7.19.2 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。

#### 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | -116.59                         |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                               |

|             |              |
|-------------|--------------|
| 基金投资产生的股利收益 | 2,467,717.62 |
| 合计          | 2,467,601.03 |

#### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -594,489.12                           |
| 股票投资                   | -600,967.01                           |
| 债券投资                   | -                                     |
| 资产支持证券投资               | -                                     |
| 基金投资                   | 6,477.89                              |
| 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                     | -594,489.12                           |

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                     |
| 销售服务费返还 | 75,631.06                             |
| 合计      | 75,631.06                             |

#### 6.4.7.23 持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------------|-----------------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 106,266.49                              |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 518,039.29                              |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 136,374.23                              |

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

#### 6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|



|         |           |
|---------|-----------|
| 审计费用    | 24,795.19 |
| 信息披露费   | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | -         |
| 证券组合费   | 1.72      |
| 银行费用    | 131.00    |
| 账户维护费   | 9,000.00  |
| 合计      | 93,435.28 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系           |
|------------------------|-------------------|
| 上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”） | 基金管理人、基金销售机构      |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金销售机构      |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构   |
| 上海东证期货有限公司（“东证期货”）     | 受东方证券控制的公司、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                     |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例(%) |
| 东方证券  | 13,574,659.28              | 38.64                   | 14,313,301.99                   | 28.14               |

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 东方证券  | -                          | -                       | 38,203.20                       | 14.28                   |

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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

#### 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期基金<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期基金<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 东方证券  | 6,680,600.80               | 2.87                    | 9,128,136.10                    | 6.19                    |

#### 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 东方证券  | 9,787.58                        | 38.96              | 3,110.18     | 99.64                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 东方证券  | 10,181.15                       | 28.14              | 490.46       | 7.83                 |

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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                  | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 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   | 338,156.41                      | 361,035.69                      |
| 其中: 支付销售机构的客户维护费 | 120,886.15                      | 117,020.43                      |

注: 1、本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人管理的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额 (若为负数, 则取 0) 的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

日管理费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额 (若为负数, 则取 0) × 0.50% / 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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

| 项目             | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 128,358.00                            | 115,338.17                                 |

注: 1、本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 (若为负数, 则取 0) 的 0.15% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。其计算公式为:

日托管费 = 前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额 (若为负数, 则取 0) × 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

注: 本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                              | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|---------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                                 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（2020 年 6 月 24 日）持有的基金份额 | -                               | -                               |
| 报告期初持有的基金份额                     | 8,009,260.00                    | 8,009,260.00                    |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -                               | -                               |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                               | -                               |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | 6,200,000.00                    | -                               |
| 报告期末持有的基金份额                     | 1,809,260.00                    | 8,009,260.00                    |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 1.0901%                         | 3.6686%                         |

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

##### 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末             |                      | 上年度末             |                      |
|-------|-----------------|----------------------|------------------|----------------------|
|       | 2022 年 6 月 30 日 |                      | 2021 年 12 月 31 日 |                      |
|       | 持有的基金份额         | 持有的基金份额占基金总份额的比例 (%) | 持有的基金份额          | 持有的基金份额占基金总份额的比例 (%) |
| 东证期货  | -               | -                    | 39,007,630.00    | 17.7663              |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

##### 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                              |           | 上年度可比期间                         |           |
|--------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|        | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |           | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |           |
|        | 期末余额                            | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 中国工商银行 | 68,144,840.36                   | 18,621.89 | 7,015,684.73                    | 25,148.03 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有基金管理人东证资管所管理的公开募集证券投资基金合计 25,972,126.94 元，占本基金资产净值的比例为 14.66%（2021 年 12 月 31 日：本基金持有基金管理人东证资管所管理的公开募集证券投资基金合计 102,538,900.55 元，占本基金资产净值的比例为 43.32%）。

### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

| 项目                       | 本期费用<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6<br>月 30 日 |
|--------------------------|--------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元）          | -                                          | -                                             |
| 当期交易基金产生的赎回费（元）          | 4,457.67                                   | -                                             |
| 当期持有基金产生的应支付销售<br>服务费（元） | 75,631.13                                  | 45,816.98                                     |
| 当期持有基金产生的应支付管理<br>费（元）   | 249,004.18                                 | 145,929.09                                    |
| 当期持有基金产生的应支付托管<br>费（元）   | 73,434.52                                  | 43,780.45                                     |
| 当期持有基金产生的应支付交易<br>费用（元）  | 86.70                                      | 113.73                                        |

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费为零，当期交易基金产生的赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

## 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022 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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间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。

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

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | -                 | 217,000.00          |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | -                 | 217,000.00          |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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于每个开放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 2022 年 6 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  
时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本  
基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净  
资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发  
行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基  
金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)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，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，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 2022 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 2022 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年6月30<br>日 | 1个月以内         | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息             | 合计             |
|-----------------------|---------------|-------|--------|------|------|-----------------|----------------|
| 资产                    |               |       |        |      |      |                 |                |
| 银行存款                  | 68,144,840.36 | -     | -      | -    | -    | -               | 68,144,840.36  |
| 结算备付金                 | 123,414.35    | -     | -      | -    | -    | -               | 123,414.35     |
| 存出保证金                 | 26,927.48     | -     | -      | -    | -    | -               | 26,927.48      |
| 交易性金融资产               | -             | -     | -      | -    | -    | -143,906,098.63 | 143,906,098.63 |

|                     |               |       |        |             |                |                 |                |
|---------------------|---------------|-------|--------|-------------|----------------|-----------------|----------------|
| 应收申购款               | 3,499.17      | -     | -      | -           | -              | 866.26          | 4,365.43       |
| 应收清算款               | -             | -     | -      | -           | -              | 22,991,862.65   | 22,991,862.65  |
| 其他资产                | -             | -     | -      | -           | -              | 119,401.25      | 119,401.25     |
| 资产总计                | 68,298,681.36 | -     | -      | -           | -              | 167,018,228.79  | 235,316,910.15 |
| 负债                  |               |       |        |             |                |                 |                |
| 应付赎回款               | -             | -     | -      | -           | -              | 57,892,699.84   | 57,892,699.84  |
| 应付管理人报酬             | -             | -     | -      | -           | -              | 59,458.53       | 59,458.53      |
| 应付托管费               | -             | -     | -      | -           | -              | 21,691.11       | 21,691.11      |
| 其他负债                | -             | -     | -      | -           | -              | 137,423.90      | 137,423.90     |
| 负债总计                | -             | -     | -      | -           | -              | 58,111,273.38   | 58,111,273.38  |
| 利率敏感度缺口             | 68,298,681.36 | -     | -      | -           | -              | -108,906,955.41 | 177,205,636.77 |
| 上年度末<br>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                | 1,663,847.99  | -     | -      | -           | -              | -               | 1,663,847.99   |
| 结算备付金               | 341,111.93    | -     | -      | -           | -              | -               | 341,111.93     |
| 存出保证金               | 28,098.43     | -     | -      | -           | -              | -               | 28,098.43      |
| 交易性金融资产             | -             | -     | -      | -217,000.00 | 234,415,778.57 | 234,632,778.57  |                |
| 应收股利                | -             | -     | -      | -           | -              | 267,401.10      | 267,401.10     |
| 应收申购款               | 1,499.10      | -     | -      | -           | -              | 49.70           | 1,548.80       |
| 其他资产                | -             | -     | -      | -           | -              | 44,317.98       | 44,317.98      |
| 资产总计                | 2,034,557.45  | -     | -      | -217,000.00 | 234,727,547.35 | 236,979,104.80  |                |
| 负债                  |               |       |        |             |                |                 |                |
| 应付管理人报酬             | -             | -     | -      | -           | -              | 56,921.17       | 56,921.17      |
| 应付托管费               | -             | -     | -      | -           | -              | 22,741.47       | 22,741.47      |
| 其他负债                | -             | -     | -      | -           | -              | 208,932.23      | 208,932.23     |
| 负债总计                | -             | -     | -      | -           | -              | 288,594.87      | 288,594.87     |
| 利率敏感度缺口             | 2,034,557.45  | -     | -      | -217,000.00 | 234,438,952.48 | 236,690,509.93  |                |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|           |                             |                |  |
|-----------|-----------------------------|----------------|--|
| 假设        | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变          |                |  |
| 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                |  |
|           | 本期末（2022年6月30日）             | 上年度末（2021年12月） |  |

|    |                  |   |           |
|----|------------------|---|-----------|
|    |                  |   | 31 日 )    |
| 分析 | 1. 市场利率下降 25 个基点 | - | 3,109.04  |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点 | - | -3,057.42 |

#### 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<br>2022 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2021 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  | -                      | -             | 23,915,390.00            | 10.10         |
| 交易性金融资产—基金投资  | 143,906,098.63         | 81.21         | 210,500,388.57           | 88.93         |
| 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            | 143,906,098.63         | 81.21         | 234,415,778.57           | 99.04         |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                                |                             |
|----|--------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变 |                             |
|    | 相关风险变量的变                       | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元) |

|    | 动                                | 本期末（2022 年 6 月 30 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
|----|----------------------------------|----------------------|------------------------|
| 分析 | 1. 业绩比较基准<br>(附注 6.4.1) 上升<br>5% | 1,024,035.99         | 2,167,068.77           |
|    | 2. 业绩比较基准<br>(附注 6.4.1) 下降<br>5% | -1,024,035.99        | -2,167,068.77          |

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，业绩比较基准发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 143,906,098.63         | 234,415,778.57           |
| 第二层次          | -                      | 217,000.00               |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 143,906,098.63         | 234,632,778.57           |

###### 6.4.14.2.2 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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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（2021 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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              | -              | -             |
|    | 其中：股票             | -              | -             |
| 2  | 基金投资              | 143,906,098.63 | 61.15         |
| 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      | 68,268,254.71  | 29.01         |
| 8  | 其他各项资产            | 23,142,556.81  | 9.83          |
| 9  | 合计                | 235,316,910.15 | 100.00        |

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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  | 601669 | 中国电建  | 1,658,422.51 | 0.70           |
| 2  | 000672 | 上峰水泥  | 1,647,849.00 | 0.70           |
| 3  | 600153 | 建发股份  | 1,172,445.24 | 0.50           |
| 4  | 002475 | 立讯精密  | 942,378.00   | 0.40           |
| 5  | 601318 | 中国平安  | 703,760.00   | 0.30           |
| 6  | 002352 | 顺丰控股  | 464,265.00   | 0.20           |
| 7  | 06969  | 思摩尔国际 | 443,407.11   | 0.19           |
| 8  | 600383 | 金地集团  | 236,001.00   | 0.10           |
| 9  | 603132 | 金徽股份  | 14,493.60    | 0.01           |
| 10 | 603209 | 兴通股份  | 12,804.40    | 0.01           |
| 11 | 603150 | 万朗磁塑  | 8,581.69     | 0.00           |
| 12 | 603215 | 比依股份  | 7,187.50     | 0.00           |

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  | 600585 | 海螺水泥  | 8,213,845.83 | 3.47           |
| 2  | 002475 | 立讯精密  | 5,939,870.00 | 2.51           |
| 3  | 601669 | 中国电建  | 4,999,215.19 | 2.11           |
| 4  | 002352 | 顺丰控股  | 1,791,843.00 | 0.76           |
| 5  | 000672 | 上峰水泥  | 1,786,275.00 | 0.75           |
| 6  | 600153 | 建发股份  | 1,154,729.00 | 0.49           |
| 7  | 601888 | 中国中免  | 1,107,580.00 | 0.47           |
| 8  | 600383 | 金地集团  | 1,049,745.00 | 0.44           |
| 9  | 601318 | 中国平安  | 714,720.00   | 0.30           |
| 10 | 06969  | 思摩尔国际 | 558,772.17   | 0.24           |
| 11 | 600754 | 锦江酒店  | 480,891.00   | 0.20           |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 12 | 603132 | 金徽股份 | 28,316.20 | 0.01 |
| 13 | 603209 | 兴通股份 | 15,672.30 | 0.01 |
| 14 | 603215 | 比依股份 | 14,431.74 | 0.01 |
| 15 | 603150 | 万朗磁塑 | 9,369.83  | 0.00 |

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 | 7,311,595.05  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 27,865,276.26 |

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货投资。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

#### 7.12 本报告期投资基金情况

##### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金将根据基金产品特征，综合定量和定性两个维度优选拟投资基金标的。首先，对全市场基金进行筛选，构建基础基金池，再通过对基础基金池中基金管理人和基金经理的调研情况进

一步筛选，构建精选基金池，最后结合市场情况和基金风格构建投资组合，通过分散投资风险为投资者谋求较稳定的投资回报。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称            | 运作方式         | 持有份额 (份)      | 公允价值 (元)      | 占基金资产净值比例 (%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-----------------|--------------|---------------|---------------|---------------|------------------------|
| 1  | 511360 | 海富通中证短融ETF      | 交易型开放式 (ETF) | 227,500.00    | 23,955,977.50 | 13.52         | 否                      |
| 2  | 002659 | 兴业中债1-3年政策性金融债A | 契约型开放式       | 10,921,718.22 | 11,957,097.11 | 6.75          | 否                      |
| 3  | 002650 | 东方红稳添利纯债债券A     | 契约型开放式       | 10,037,662.91 | 10,928,003.61 | 6.17          | 是                      |
| 4  | 005623 | 广发中债1-3年农发债指数A  | 契约型开放式       | 10,031,830.79 | 10,575,556.02 | 5.97          | 否                      |
| 5  | 511880 | 银华交易型货币A        | 契约型开放式       | 104,500.00    | 10,559,620.50 | 5.96          | 否                      |



|    |        |              |              |               |               |      |   |
|----|--------|--------------|--------------|---------------|---------------|------|---|
| 6  | 006663 | 易方达安悦超短债债券 C | 契约型开放式       | 10,274,746.05 | 10,442,224.41 | 5.89 | 否 |
| 7  | 001711 | 安信新趋势混合 C    | 契约型开放式       | 6,430,555.28  | 7,433,721.90  | 4.19 | 否 |
| 8  | 511990 | 华宝添益货币 A     | 交易型开放式 (ETF) | 73,314.00     | 7,331,326.69  | 4.14 | 否 |
| 9  | 005754 | 平安短债债券 A     | 契约型开放式       | 5,674,280.10  | 6,462,437.61  | 3.65 | 否 |
| 10 | 001763 | 广发多策略混合      | 契约型开放式       | 3,281,947.52  | 6,317,748.98  | 3.57 | 否 |
| 11 | 002652 | 东方红汇利债券 C    | 契约型开放式       | 5,392,300.27  | 5,781,624.35  | 3.26 | 是 |
| 12 | 512800 | 华宝中证银行 ETF   | 交易型开放式 (ETF) | 4,853,800.00  | 5,538,185.80  | 3.13 | 否 |
| 13 | 006870 | 广发景和中短债债券 A  | 契约型开放式       | 5,000,686.93  | 5,053,694.21  | 2.85 | 否 |
| 14 | 002701 | 东方红汇         | 契约型开         | 4,548,275.79  | 5,039,944.40  | 2.84 | 是 |

|    |        |                                   |                         |              |              |      |   |
|----|--------|-----------------------------------|-------------------------|--------------|--------------|------|---|
|    |        | 阳债<br>券 A                         | 放式                      |              |              |      |   |
| 15 | 519062 | 海富<br>通阿<br>尔法<br>对冲<br>混合<br>A   | 契约<br>型开<br>放式          | 4,085,698.50 | 4,751,667.36 | 2.68 | 否 |
| 16 | 003669 | 东方<br>红益<br>鑫纯<br>债债<br>券 C       | 契约<br>型开<br>放式          | 4,106,345.02 | 4,222,554.58 | 2.38 | 是 |
| 17 | 512000 | 华宝<br>中证<br>全指<br>证券<br>公司<br>ETF | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 3,733,400.00 | 3,486,995.60 | 1.97 | 否 |
| 18 | 512200 | 南方<br>中证<br>全指<br>房地<br>产<br>ETF  | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 2,867,600.00 | 2,245,330.80 | 1.27 | 否 |
| 19 | 512880 | 国泰<br>中证<br>全指<br>证券<br>公司<br>ETF | 交易<br>型开<br>放式<br>(ETF) | 1,867,200.00 | 1,822,387.20 | 1.03 | 否 |

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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。

### 7.13.2 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。

### 7.13.3 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     | 26,927.48     |
| 2  | 应收清算款     | 22,991,862.65 |
| 3  | 应收股利      | -             |
| 4  | 应收利息      | -             |
| 5  | 应收申购款     | 4,365.43      |
| 6  | 其他应收款     | -             |
| 7  | 待摊费用      | -             |
| 8  | 应收销售服务费返还 | 119,401.25    |
| 9  | 其他        | -             |
| 10 | 合计        | 23,142,556.81 |

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 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。

### 7.13.6 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>(%) | 持有份额          | 占总份额比例<br>(%) |
| 2,090        | 79,409.36     | 76,828,985.00 | 46.29         | 89,136,569.40 | 53.71         |

### 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 | 460,660.69 | 0.28        |

### 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 10~50 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020 年 6 月 24 日）<br>基金份额总额 | 214,884,595.47 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 219,559,604.65 |
| 本报告期基金总申购份额                        | 829,376.65     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 54,423,426.90  |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 165,965,554.40 |

## § 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

2022 年 2 月 25 日起，张锋代行本基金管理人合规负责人、首席风险官职务，李云亮不再担任合规负责人、首席风险官、首席信息官职务；2022 年 3 月 4 日起，胡伟担任本基金管理人的副总经理职务。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

### 10.6 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。

### 10.7 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。

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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 (%) |    |
| 东吴证券     | 2      | 21,559,144.84 | 61.36            | 15,335.67 | 61.04          | -  |
| 东方证券     | 6      | 13,574,659.28 | 38.64            | 9,787.58  | 38.96          | -  |
| 安信证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 长江证券     | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 东北证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 东兴证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 方正证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 高华证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 光大证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 广发证券     | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 国金证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 国盛证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 国泰君安     | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 国信证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 海通证券     | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 宏信证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 华安证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 华创证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 华西证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 民生证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 平安证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 瑞银证券     | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 申万宏源     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 西部证券     | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 信达证券     | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 兴业证券     | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 野村东方国际证券 | 1      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 招商证券     | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |
| 浙商证券     | 2      | -             | -                | -         | -              | -  |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 中金公司       | 3 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信证券       | 2 | - | - | - | - | - |

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

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

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

(2) 选择程序

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

3、本基金本报告期租用券商交易单元无变更。

10.8.2 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 |                  | 基金交易          |                  |
|------|------------|------------------|--------------|--------------------|------|------------------|---------------|------------------|
|      | 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 (%) | 成交金额          | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| 东吴证券 | 240,219.00 | 100.00           | 2,000,000.00 | 100.00             | -    | -                | 88,599,723.72 | 38.05            |
| 东方证券 | -          | -                | -            | -                  | -    | -                | 6,680,600.80  | 2.87             |
| 安信证券 | -          | -                | -            | -                  | -    | -                | -             | -                |
| 长江证券 | -          | -                | -            | -                  | -    | -                | -             | -                |
| 东北证券 | -          | -                | -            | -                  | -    | -                | -             | -                |
| 东兴证券 | -          | -                | -            | -                  | -    | -                | -             | -                |
| 方正证券 | -          | -                | -            | -                  | -    | -                | -             | -                |
| 高华证  | -          | -                | -            | -                  | -    | -                | -             | -                |

|                  |   |   |   |   |   |                 |       |   |
|------------------|---|---|---|---|---|-----------------|-------|---|
| 券                |   |   |   |   |   |                 |       |   |
| 光大证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 广发证<br>券         | - | - | - | - | - | -137,576,363.05 | 59.08 |   |
| 国金证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 国盛证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 国泰君<br>安         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 国信证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 海通证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 宏信证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 华安证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 华创证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 华西证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 民生证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 平安证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 瑞银证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 申万宏<br>源         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 西部证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 信达证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 兴业证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 野村东<br>方国际<br>证券 | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 招商证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |
| 浙商证<br>券         | - | - | - | - | - | -               | -     | - |

|        |   |   |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 中金公司   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | - | - | - | - | - | - | - | - |

### 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                      | 法定披露方式    | 法定披露日期          |
|----|-----------------------------------------------------------|-----------|-----------------|
| 1  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告                  | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 1 日  |
| 2  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金在交通银行股份有限公司不参与申购费率优惠活动的公告             | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 11 日 |
| 3  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加北京雪球基金销售有限公司为代理销售机构及开通部分基金定投业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 4  | 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）2021 年第四季度报告                 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 24 日 |
| 5  | 上海东方证券资产管理有限公司关于自有资金投资旗下偏股型基金的公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 1 月 28 日 |
| 6  | 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                               | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 2 月 26 日 |
| 7  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加中国农业银行股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告     | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 3 日  |
| 8  | 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                               | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 5 日  |
| 9  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告   | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 15 日 |
| 10 | 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）2021 年年度报告                   | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 3 月 31 日 |
| 11 | 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）2022 年第一季度报告                 | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 12 | 上海东方证券资产管理有限公司关于                                          | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 4 月 29 日 |



|    |                                                             |           |                 |
|----|-------------------------------------------------------------|-----------|-----------------|
|    | 旗下部分基金增加部分渠道为代理销售机构并开通定投业务的公告                               |           |                 |
| 13 | 东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新) (2022 年第 1 号) | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 12 日 |
| 14 | 东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金产品资料概要更新               | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 12 日 |
| 15 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告                         | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 12 日 |
| 16 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销平台开展费率优惠活动的公告                    | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 5 月 19 日 |
| 17 | 东方红颐 and 稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金 (FOF) 开放赎回业务的公告                | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 6 月 20 日 |
| 18 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告         | 中国证监会规定媒介 | 2022 年 6 月 23 日 |

## § 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

| 投资者类别                                                                                                                                                      | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |      |               | 报告期末持有基金情况    |          |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|---------------|------|---------------|---------------|----------|
|                                                                                                                                                            | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额          | 持有份额          | 份额占比 (%) |
| 机构                                                                                                                                                         | 1              | 20220101-20220630       | 50,013,400.00 | 0.00 | 0.00          | 50,013,400.00 | 30.1300  |
|                                                                                                                                                            | 2              | 20220627-20220628       | 39,007,630.00 | 0.00 | 39,007,630.00 | 0.00          | 0.0000   |
| 产品特有风险                                                                                                                                                     |                |                         |               |      |               |               |          |
| <p>本基金由于存在单一投资者份额集中度较高的情况,可能存在巨额赎回的风险,增加基金管理人的流动性管理压力;基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金份额集中度的影响,同时将完善流动性风险管控机制,加强对基金持有人利益的保护。</p> |                |                         |               |      |               |               |          |

## 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颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）的文件；
- 2、《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）基金合同》；
- 3、《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）托管协议》；
- 4、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）财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

### 12.3 查阅方式

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

上海东方证券资产管理有限公司

2022 年 8 月 31 日