

东方品质消费一年持有期混合型证券投资  
基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
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	48

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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</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 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	东方品质消费一年持有期混合	
基金主代码	012506	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 8 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	232,759,687.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	东方品质消费一年持有期混合 A	东方品质消费一年持有期混合 C
下属分级基金的交 易代码	012506	012507
报告期末下属分级 基金的份额总额	200,786,761.94 份	31,972,925.78 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效管理投资风险的基础上，重点挖掘并捕捉“品质消费”主题行业及相关上市公司的投资机会，力争实现基金资产的长期、稳健增值。
投资策略	本基金根据资本市场实际情况对大类资产比例进行动态调整，以专业的研究分析为根本，挖掘市场中的投资机会，在严格控制投资风险的基础上，争取为基金份额持有人谋求长期、稳健的投资回报。
业绩比较基准	中证主要消费行业指数收益率×35%+中证可选消费行业指数收益率×35%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×10%+中债综合全价指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金将投资港股通标的股票，将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		东方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李景岩	任航
	联系电话	010-66295888	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95599
传真		010-66578700	010-68121816
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼 远洋锐中心 26 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号 凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100073	100031
法定代表人	崔伟	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
基金中期报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所或办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理股份有限公司	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

# § 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	东方品质消费一年持有期混合 A	东方品质消费一年持有期混合 C
本期已实现收益	-10,660,635.78	-1,753,244.90
本期利润	-13,831,349.31	-2,227,392.24
加权平均基金份额 本期利润	-0.0673	-0.0652
本期加权平均净 值利润率	-15.49%	-15.17%
本期基金份额净 值增长率	-14.55%	-14.72%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-122,245,001.70	-19,614,288.34
期末可供分配基 金份额利润	-0.6088	-0.6135
期末基金资产净 值	78,541,760.24	12,358,637.44
期末基金份额净	0.3912	0.3865

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-60.88%	-61.35%

注：①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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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。

### 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

东方品质消费一年持有期混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.78%	0.58%	-5.43%	0.45%	-2.35%	0.13%
过去三个月	-12.93%	0.70%	-3.90%	0.67%	-9.03%	0.03%
过去六个月	-14.55%	1.00%	-1.55%	0.80%	-13.00%	0.20%
过去一年	-27.11%	1.01%	-8.53%	0.79%	-18.58%	0.22%
自基金合同生效起至今	-60.88%	1.11%	-26.23%	0.97%	-34.65%	0.14%

东方品质消费一年持有期混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.82%	0.57%	-5.43%	0.45%	-2.39%	0.12%
过去三个月	-13.03%	0.70%	-3.90%	0.67%	-9.13%	0.03%
过去六个月	-14.72%	1.00%	-1.55%	0.80%	-13.17%	0.20%
过去一年	-27.42%	1.01%	-8.53%	0.79%	-18.89%	0.22%

自基金合同生效起 至今	-61.35%	1.10%	-26.23%	0.97%	-35.12%	0.13%
----------------	---------	-------	---------	-------	---------	-------

### 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

东方品质消费一年持有期混合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



东方品质消费一年持有期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证

监基金字[2004]80号”批复，于2004年6月11日成立。

截至2024年6月30日，本公司注册资本3.3333亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份19200万股，持股比例57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份8100万股，持股比例24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份2700万股，持股比例8.1%；海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持股比例3.37%；海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止2024年6月30日，本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有

期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金、东方锦合一年定期开放债券型发起式证券投资基金、东方享悦 90 天滚动持有债券型证券投资基金、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金、东方享誉 30 天滚动持有债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王然	本基金基金经理、权益研究部总经理、公募投资决策委员会委员	2021 年 7 月 8 日	-	16 年	权益研究部总经理，公募投资决策委员会委员。北京交通大学产业经济学硕士，16 年证券从业经历。曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010 年 4 月加盟本基金管理人，曾任权益研究部副总经理，权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于 2017 年 5 月 11 日转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于 2017 年 9 月 13 日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于 2018 年 1 月 17 日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资

					基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
蔡尚军	本基金基金经理助理	2023年4月20日	2024年2月21日	7年	清华大学化学专业博士，7年证券从业经历。曾任方正证券股份有限公司助理研究员、中海基金管理有限公司研究员。2020年8月加盟本基金管理人，曾任权益研究部研究员、高级研究员、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、东方创新医疗股票型证券投资基金基金经理助理。现任东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《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

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），制定了公司公平交易管理制度。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易

执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，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

回顾 2024 年上半年，市场呈现宽幅震荡、结构分化的走势。根据 wind 数据，上半年红利指数表现相对较好，沪深 300、上证 50 指数小涨，其他宽基指数普跌；结构方面，上半年银行、煤炭、公用事业申万一级行业涨幅居前，涨幅超过 10%；超过 2/3 的行业下跌，跌幅居前的申万一级行业为综合、计算机、商贸零售，跌幅超过 20%。

整体上看，上半年市场反应了国内经济弱复苏和国外不确定性提升的预期。1 季度，国内房地产虽有政策出台但效果尚未显现，海外不确定因素增多，市场层面监管加强，强调上市公司经营质量和回馈投资者。2 季度，市场进入业绩披露期，政治局会议提出“抓紧构建房地产发展新模式，促进房地产高质量发展”，但后续宏观数据低于预期，大宗商品价格有所松动，消费需求低迷，风险偏好有所下降。整体来看，经济修复动能仍有待提升，政策态度相对积极但效果仍有待时间验证，风险偏好较低，中大盘绩优股表现好于预期，高股息资产内部虽有轮动，但整体上仍是上半年较好的投资品种。科技进程持续推进，AI、低空经济等主题性投资机会时有轮动。

本期产品在操作上继续维持自上而下优选行业和自下而上甄选个股相结合的配置策略。自上而下方面，仍然看好医药、美容护理等消费行业的中长期壁垒和增长空间，以及在经济动能修复过程中受益的消费行业；自下而上方面，继续对行业内的优质公司进行研究和机会挖掘，综合考

考虑估值性价比、流动性等因素进行配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日,本基金 A 类净值增长率为-14.55%, 业绩比较基准收益率为-1.55%, 低于业绩比较基准 13.00%; 本基金 C 类净值增长率为-14.72%, 业绩比较基准收益率为-1.55%, 低于业绩比较基准 13.17%。

#### 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,随着近期多项政策出台,房地产、内需消费、设备更新等多个领域存在边际改善的可能,叠加下半年美国大选和降息预期的逐步明朗,经济修复动能有望增强,市场风险偏好有望提升。自上而下方面,我们将继续关注顺周期领域的边际变化,如白酒、医美、小家电等,以及因产业政策推动而带来的行业内部逻辑和数据变化的机会,如创新药、中药、景区、教育等,同时关注海外科技和出口相关产业链的动态,如医疗器械、CXO 等;自下而上方面,继续寻找具备中期逻辑且估值具备性价比的行业龙头进行配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关会计核算业务细则,本管理人对所管理的基金各项资产进行核算,本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下:

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会(以下简称“估值委员会”),成员包括公司总经理、分管运营高级管理人员、分管投研高级管理人员、督察长以及运营部负责人、投研部门指定负责人、合规法务部负责人、风险管理部负责人及总办会其他指定人员。估值委员会设立委员会主任 1 名,委员会副主任 1-2 名,估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性,熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下:

##### 1. 委员会主任

负责召集估值委员会工作会议,就估值参与各方提交的估值问题组织讨论,进行决议并组织实施;因特殊原因,委员会主任无法履行职责时,由指定的副主任代理其行使召集职责。

##### 2. 运营部

(1) 自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

(2) 征求托管行意见并借鉴行业通行做法,提出估值方法的修改意见。

(3) 根据估值委员会会议决定的估值方法及估值模型而最终确认的具体投资品种公允价值与托管行协商一致后,对相应产品进行估值。

(4) 负责编制相应产品持有的投资品种变更估值方法的相关公告,协调相关部门对外发布公

告，并根据公告内容协助相关部门做好客户沟通。

(5) 负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

### 3. 投研部门

根据现行法律法规及各产品相关法律文件，适时评估各产品持有投资品种的现有估值政策及估值方法是否公允、适当；对估值方法有失公允性时，投研部门必要时可向运营部提交估值方法调整说明，由运营部提请估值委员会召集估值会议进行审议。

### 4. 合规法务部、风险管理部

在日常合规监控及风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会召集估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期末，公司已与中债金融估值中心有限公司签署了《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

## 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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东方基金管理股份有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，东方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，东方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 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：东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,883,150.37	7,503,444.62
结算备付金		6,076,573.78	248,544.84
存出保证金		128,427.34	71,404.55
交易性金融资产	6.4.7.2	82,223,190.85	107,155,550.66
其中：股票投资		76,158,806.74	99,411,796.14
基金投资		-	-
债券投资		6,064,384.11	7,743,754.52
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		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		2,536.32	5,484.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		92,313,878.66	114,984,428.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		749,102.53	0.19
应付赎回款		61,307.06	56,064.52
应付管理人报酬		94,042.82	119,022.61
应付托管费		15,673.78	19,837.09
应付销售服务费		4,272.72	5,658.59
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	6.4.7.7	489,082.07	431,645.92
负债合计		1,413,480.98	632,228.92
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.8	232,759,687.72	250,159,152.66
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	-141,859,290.04	-135,806,952.88
净资产合计		90,900,397.68	114,352,199.78
负债和净资产总计		92,313,878.66	114,984,428.70

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，东方品质消费一年持有期混合 A 基金份额净值 0.3912 元，基金份额总额 200,786,761.94 份；东方品质消费一年持有期混合 C 基金份额净值 0.3865 元，基金份额总额 31,972,925.78 份。东方品质消费一年持有期混合份额总额合计为 232,759,687.72 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 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
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

<b>一、营业总收入</b>		-15,215,536.89	-14,841,372.29
1. 利息收入		26,339.49	30,365.35
其中：存款利息收入	6.4.7.10	26,339.49	30,365.35
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,597,015.51	-11,610,523.49
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-12,577,678.45	-13,224,470.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	39,348.52	157,415.36
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	941,314.42	1,456,531.30
以摊余成本计量的金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（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,644,860.87	-3,261,214.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		843,204.66	1,618,882.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	620,370.13	1,262,486.04
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	103,394.98	210,414.29
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	29,204.53	52,072.14
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.20	90,235.02	93,910.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,058,741.55	-16,460,254.88
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,058,741.55	-16,460,254.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-16,058,741.55	-16,460,254.88

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	250,159,152.66	-	-135,806,952.88	114,352,199.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	250,159,152.66	-	-135,806,952.88	114,352,199.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,399,464.94	-	-6,052,337.16	-23,451,802.10
（一）、综合收益总额	-	-	-16,058,741.55	-16,058,741.55
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-17,399,464.94	-	10,006,404.39	-7,393,060.55
其中：1. 基金申购款	2,368,014.43	-	-1,340,550.77	1,027,463.66
2. 基金赎回款	-19,767,479.37	-	11,346,955.16	-8,420,524.21
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号	-	-	-	-

填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	232,759,687.72	-	-141,859,290.04	90,900,397.68
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	305,819,519.97	-	-124,130,614.26	181,688,905.71
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	305,819,519.97	-	-124,130,614.26	181,688,905.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-33,791,387.79	-	-2,062,031.94	-35,853,419.73
(一)、综合收益总额	-	-	-16,460,254.88	-16,460,254.88
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-33,791,387.79	-	14,398,222.94	-19,393,164.85
其中：1. 基金申购款	3,180,355.58	-	-1,324,712.01	1,855,643.57
2. 基金赎回款	-36,971,743.37	-	15,722,934.95	-21,248,808.42
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	272,028,132.18	-	-126,192,646.20	145,835,485.98
-----------	----------------	---	-----------------	----------------

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：

刘鸿鹏	刘鸿鹏	王丹丹
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

东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2021 年 3 月 17 日中国证监会《关于准予东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2021】872 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金合同》自 2021 年 6 月 15 日至 2021 年 7 月 2 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 365,533,644.82 元人民币，业经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）“中喜验字【2021】第 00057 号”验资报告验证。经向中国证监会备案（机构部函【2021】2117 号），《东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 365,633,912.59 份基金单位，其中认购资金利息折合 100,267.77 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款）、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规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。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金

业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、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号文《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[2016]127号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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号文《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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继

续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81 号《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〔2023〕39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 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，以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(2) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地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，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

对内地个人投资者通过沪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。内地个人投资者通过沪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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12

月 31 日。

(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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,883,150.37
等于：本金	3,882,390.14
加：应计利息	760.23
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	3,883,150.37

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	81,343,841.05	-	76,158,806.74	-5,185,034.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	6,012,780.00	50,584.11	6,064,384.11	1,020.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,012,780.00	50,584.11	6,064,384.11	1,020.00
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	87,356,621.05	50,584.11	82,223,190.85	-5,184,014.31

### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	404,546.71
其中：交易所市场	404,546.71
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	489,082.07

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

东方品质消费一年持有期混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	214,286,439.09	214,286,439.09
本期申购	1,987,195.21	1,987,195.21
本期赎回(以“-”号填列)	-15,486,872.36	-15,486,872.36
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	200,786,761.94	200,786,761.94

东方品质消费一年持有期混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	35,872,713.57	35,872,713.57
本期申购	380,819.22	380,819.22
本期赎回(以“-”号填列)	-4,280,607.01	-4,280,607.01
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	31,972,925.78	31,972,925.78

注：本期申购包含基金转换入、红利再投份额；赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

东方品质消费一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-115,248,862.05	-944,433.76	-116,193,295.81
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-115,248,862.05	-944,433.76	-116,193,295.81
本期利润	-10,660,635.78	-3,170,713.53	-13,831,349.31
本期基金份额交易产生的变动数	7,712,837.66	66,805.76	7,779,643.42
其中：基金申购款	-1,119,056.56	-6,076.43	-1,125,132.99
基金赎回款	8,831,894.22	72,882.19	8,904,776.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-118,196,660.17	-4,048,341.53	-122,245,001.70

东方品质消费一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,450,987.22	-162,669.85	-19,613,657.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-19,450,987.22	-162,669.85	-19,613,657.07
本期利润	-1,753,244.90	-474,147.34	-2,227,392.24
本期基金份额交易产生的变动数	2,232,241.86	-5,480.89	2,226,760.97
其中：基金申购款	-218,512.24	3,094.46	-215,417.78
基金赎回款	2,450,754.10	-8,575.35	2,442,178.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,971,990.26	-642,298.08	-19,614,288.34

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		18,778.09
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		6,962.93
其他		598.47
合计		26,339.49

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-12,577,678.45
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		-12,577,678.45

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		458,707,213.05
减：卖出股票成本总额		470,098,725.38
减：交易费用		1,186,166.12
买卖股票差价收入		-12,577,678.45

### 6.4.7.12 债券投资收益

#### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	64,647.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-25,298.94
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	39,348.52

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,766,374.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,625,114.94
减：应计利息总额	166,558.70
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-25,298.94

### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	941,314.42
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	941,314.42

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,644,860.87
股票投资	-3,664,915.81
债券投资	20,054.94
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	-3,644,860.87

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	5,699.66
合计	90,235.02

#### 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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明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

本报告期内不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。

### 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
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	620,370.13	1,262,486.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	303,643.23	616,833.14
应支付基金管理人的净管理费	316,726.90	645,652.90

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%（2023 年 8 月 28 日之前为 1.50%）

的年费率计算，具体计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

③本基金于 2023 年 8 月 28 日，将管理费率自 1.50%调整至 1.20%，详情请见《东方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	103,394.98	210,414.29

注：①计提标准：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%（2023 年 8 月 28 日之前为 0.25%）的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

③本基金于 2023 年 8 月 28 日，将托管费率自 0.25%调整至 0.20%，详情请见《东方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方品质消费一年持有期混合 A	东方品质消费一年持有期混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	8.85	8.85
中国农业银行股份有限公司	-	16,076.22	16,076.22

司			
合计	-	16,085.07	16,085.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方品质消费一年持有期混合 A	东方品质消费一年持有期混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	11.55	11.55
中国农业银行股份有限公司	-	25,612.77	25,612.77
合计	-	25,624.32	25,624.32

注：①计提标准：本基金销售服务费按前一日东方品质消费 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国农业银行股份有限公司	3,883,150.37	18,778.09	5,648,039.16	21,359.90

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.48	53	1,127.84	1,562.44	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.34	46	1,334.92	1,165.64	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.02	18	1,304.28	1,224.36	-
603375	盛景微	2024年1月17日	6个月	新股流通受限	38.18	38.88	33	1,259.94	1,283.04	-

688584	上海合晶	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	22.66	15.87	158	3,580.28	2,507.46	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.54	124	2,781.32	3,910.96	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

#### 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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风控部门组成的风险管理组织体系，对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金投资于具有良好信用等级的证券，并在法律法规规定和本基金基金合同约定的基础上，进一步进行分散化投资管理。

除通过上述措施控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场

进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、短期融资券、超短期融资券及同业存单等。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人严密监控基金申购赎回情况，预留充足可用现金头寸与之相匹配。本基金所持资产大部分可在证券交易所或银行间同业市场交易，除在本报告（期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦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。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求、计算并预留最优现金头寸；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，保持组合必要的流动性和可变现能力，未发生流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。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

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和负债不计息，持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,883,150.37	-	-	-	3,883,150.37
结算备付金	6,076,573.78	-	-	-	6,076,573.78
存出保证金	128,427.34	-	-	-	128,427.34
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	76,158,806.74	76,158,806.74
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	6,064,384.11	-	-	-	6,064,384.11
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,536.32	2,536.32
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,152,535.60	-	-	76,161,343.06	92,313,878.66
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	749,102.53	749,102.53
应付赎回款	-	-	-	61,307.06	61,307.06
应付管理人报酬	-	-	-	94,042.82	94,042.82

应付托管费	-	-	-	15,673.78	15,673.78
应付销售服务费	-	-	-	4,272.72	4,272.72
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	-	-	-	489,082.07	489,082.07
负债总计	-	-	-	1,413,480.98	1,413,480.98
利率敏感度缺口	16,152,535.60	-	-	74,747,862.08	90,900,397.68
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,503,444.62	-	-	-	7,503,444.62
结算备付金	248,544.84	-	-	-	248,544.84
存出保证金	71,404.55	-	-	-	71,404.55
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	99,411,796.14	99,411,796.14
交易性金融资产-债券投资	7,743,754.52	-	-	-	7,743,754.52
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,484.03	5,484.03
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,567,148.53	-	-	99,417,280.17	114,984,428.70
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	0.19	0.19
应付赎回款	-	-	-	56,064.52	56,064.52
应付管理人报酬	-	-	-	119,022.61	119,022.61
应付托管费	-	-	-	19,837.09	19,837.09
应付销售服务费	-	-	-	5,658.59	5,658.59
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	-	-	-	431,645.92	431,645.92

负债总计	-	-	632,228.92	632,228.92
利率敏感度缺口	15,567,148.53	-	-98,785,051.25	114,352,199.78

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	-8,773.65	-4,069.34
	市场利率下调 0.25%	8,773.65	4,069.34

#### 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。本基金可投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30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	0.00	8,974,519.34	0.00	8,974,519.34
资产合计	0.00	8,974,519.34	0.00	8,974,519.34
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	0.00	8,974,519.34	0.00	8,974,519.34
项目	上年度末			

	2023 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	0.00	4,221,625.87	0.00	4,221,625.87
资产合计	0.00	4,221,625.87	0.00	4,221,625.87
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	0.00	4,221,625.87	0.00	4,221,625.87

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	448,725.97	211,081.29
	所有外币相对人民币贬值 5%	-448,725.97	-211,081.29

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格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。

本基金按照基金合同的约定和法律法规的规定进行投资，所面临的最大市场价格风险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市场价格风险，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。

##### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	76,158,806.74	83.78	99,411,796.14	86.93

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	6,064,384.11	6.67	7,743,754.52	6.77
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	82,223,190.85	90.45	107,155,550.66	93.71

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的的数据建立回归模型计算得到,对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票,默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%,其他市场变量均不发生变化,计算本基金资产净值变动		
分析	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(2024年6月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	沪深 300 指数上涨 5%	3,263,105.08	4,714,298.02
	沪深 300 指数下跌 5%	-3,263,105.08	-4,714,298.02

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	76,147,152.84	99,329,141.76
第二层次	6,064,384.11	7,743,754.52
第三层次	11,653.90	82,654.38
合计	82,223,190.85	107,155,550.66

#### 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证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，确定相关证券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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 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

截至中期报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	76,158,806.74	82.50
	其中：股票	76,158,806.74	82.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,064,384.11	6.57
	其中：债券	6,064,384.11	6.57
	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	9,959,724.15	10.79
8	其他各项资产	130,963.66	0.14
9	合计	92,313,878.66	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,369,400.00	3.71
B	采矿业	1,331,100.00	1.46
C	制造业	47,607,376.44	52.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,405,000.00	2.65
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,149,000.00	1.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,910.96	0.00
J	金融业	4,307,600.00	4.74
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,748,900.00	3.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,262,000.00	4.69
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	67,184,287.40	73.91

### 7.2.2 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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	1,046,615.79	1.15
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	2,447,807.76	2.69
F 医疗保健	2,421,157.50	2.66
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-

I 电信服务	3,058,938.29	3.37
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	8,974,519.34	9.87

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	605098	行动教育	100,000	4,262,000.00	4.69
2	000858	五 粮 液	30,000	3,841,200.00	4.23
3	600660	福耀玻璃	80,000	3,832,000.00	4.22
4	600398	海澜之家	400,000	3,696,000.00	4.07
5	000333	美的集团	55,003	3,547,693.50	3.90
6	002475	立讯精密	90,000	3,537,900.00	3.89
7	688062	迈威生物	120,000	3,472,800.00	3.82
8	600690	海尔智家	120,000	3,405,600.00	3.75
9	300498	温氏股份	170,000	3,369,400.00	3.71
10	603868	飞科电器	80,000	3,072,000.00	3.38
11	00700	腾讯控股	9,000	3,058,938.29	3.37
12	600054	黄山旅游	245,000	2,748,900.00	3.02
13	601988	中国银行	580,000	2,679,600.00	2.95
14	300573	兴齐眼药	16,000	2,624,000.00	2.89
15	002594	比亚迪	10,000	2,502,500.00	2.75
16	01336	新华保险	180,000	2,447,807.76	2.69
17	06990	科伦博泰生物-B	16,000	2,421,157.50	2.66
18	600011	华能国际	250,000	2,405,000.00	2.65
19	000596	古井贡酒	10,000	2,110,700.00	2.32
20	600329	达仁堂	65,000	2,105,350.00	2.32
21	002384	东山精密	80,000	1,656,000.00	1.82
22	601939	建设银行	220,000	1,628,000.00	1.79
23	000513	丽珠集团	40,000	1,488,400.00	1.64
24	600519	贵州茅台	1,000	1,467,390.00	1.61
25	603486	科沃斯	30,000	1,415,400.00	1.56
26	002327	富安娜	140,000	1,407,000.00	1.55
27	601088	中国神华	30,000	1,331,100.00	1.46
28	000729	燕京啤酒	150,000	1,324,500.00	1.46
29	600754	锦江酒店	50,000	1,149,000.00	1.26
30	603529	爱玛科技	40,000	1,093,200.00	1.20
31	02313	申洲国际	15,000	1,046,615.79	1.15
32	688695	中创股份	124	3,910.96	0.00
33	688584	上海合晶	158	2,507.46	0.00
34	603082	北自科技	53	1,562.44	0.00
35	603375	盛景微	33	1,283.04	0.00

36	603325	博隆技术	18	1,224.36	0.00
37	603312	西典新能	46	1,165.64	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	10,937,516.28	9.56
2	600398	海澜之家	8,961,891.00	7.84
3	300573	兴齐眼药	8,889,493.20	7.77
4	605098	行动教育	8,014,362.00	7.01
5	600690	海尔智家	7,455,955.00	6.52
6	603529	爱玛科技	7,361,763.00	6.44
7	603868	飞科电器	7,276,418.00	6.36
8	688062	迈威生物	7,150,609.55	6.25
9	600422	昆药集团	6,854,502.00	5.99
10	300856	科思股份	6,280,491.00	5.49
11	300498	温氏股份	6,010,837.79	5.26
12	600872	中炬高新	5,680,779.00	4.97
13	688036	传音控股	5,665,198.10	4.95
14	600054	黄山旅游	5,656,351.27	4.95
15	600754	锦江酒店	5,424,278.00	4.74
16	000596	古井贡酒	5,413,555.00	4.73
17	002840	华统股份	5,205,221.00	4.55
18	002050	三花智控	5,198,751.00	4.55
19	300529	健帆生物	5,134,547.00	4.49
20	300725	药石科技	4,906,069.00	4.29
21	000858	五粮液	4,884,745.00	4.27
22	600809	山西汾酒	4,824,971.00	4.22
23	300705	九典制药	4,756,194.00	4.16
24	603477	巨星农牧	4,578,374.00	4.00
25	300347	泰格医药	4,508,145.00	3.94
26	601988	中国银行	4,380,200.00	3.83
27	601225	陕西煤业	4,279,821.00	3.74
28	600176	中国巨石	4,248,076.09	3.71
29	002327	富安娜	4,210,278.00	3.68
30	000625	长安汽车	4,171,157.00	3.65
31	603156	养元饮品	3,975,064.00	3.48
32	601857	中国石油	3,936,000.00	3.44
33	601021	春秋航空	3,935,639.00	3.44
34	600285	羚锐制药	3,932,955.00	3.44
35	002594	比亚迪	3,926,043.00	3.43
36	600660	福耀玻璃	3,804,644.00	3.33

37	603199	九华旅游	3,699,406.00	3.24
38	00700	腾讯控股	3,635,512.84	3.18
39	688076	诺泰生物	3,616,900.74	3.16
40	002311	海大集团	3,523,402.00	3.08
41	600572	康恩贝	3,520,206.00	3.08
42	002475	立讯精密	3,346,875.00	2.93
43	002230	科大讯飞	3,225,428.00	2.82
44	688266	泽璟制药	3,192,806.58	2.79
45	02020	安踏体育	3,125,813.73	2.73
46	603486	科沃斯	3,116,796.00	2.73
47	002444	巨星科技	3,107,967.00	2.72
48	600535	天士力	3,063,090.00	2.68
49	605108	同庆楼	3,034,979.00	2.65
50	002668	TCL 智家	3,026,231.00	2.65
51	000400	许继电气	3,012,911.00	2.63
52	002033	丽江股份	2,964,301.30	2.59
53	002032	苏泊尔	2,939,038.00	2.57
54	300396	迪瑞医疗	2,929,067.00	2.56
55	600566	济川药业	2,928,340.00	2.56
56	300364	中文在线	2,919,567.00	2.55
57	01336	新华保险	2,839,588.76	2.48
58	688235	百济神州	2,779,599.13	2.43
59	688526	科前生物	2,779,104.89	2.43
60	601601	中国太保	2,762,197.00	2.42
61	002567	唐人神	2,682,376.00	2.35
62	001215	千味央厨	2,642,610.70	2.31
63	06990	科伦博泰生物 -B	2,621,771.11	2.29
64	603215	比依股份	2,618,218.00	2.29
65	600329	达仁堂	2,561,002.00	2.24
66	000589	贵州轮胎	2,548,664.00	2.23
67	00883	中国海洋石油	2,486,727.39	2.17
68	600011	华能国际	2,294,157.00	2.01

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600422	昆药集团	13,129,452.78	11.48
2	603529	爱玛科技	9,073,022.00	7.93
3	002050	三花智控	8,339,367.00	7.29

4	300573	兴齐眼药	8,097,628.20	7.08
5	600809	山西汾酒	7,637,978.00	6.68
6	605098	行动教育	7,431,720.60	6.50
7	000333	美的集团	7,361,473.00	6.44
8	600872	中炬高新	6,979,976.00	6.10
9	688266	泽璟制药	6,615,529.51	5.79
10	300856	科思股份	6,352,594.00	5.56
11	000858	五粮液	6,171,094.00	5.40
12	688235	百济神州	5,922,690.57	5.18
13	600398	海澜之家	5,537,520.00	4.84
14	688036	传音控股	5,396,941.15	4.72
15	603099	长白山	5,320,028.00	4.65
16	603477	巨星农牧	5,275,840.00	4.61
17	605108	同庆楼	5,219,203.00	4.56
18	300705	九典制药	5,205,343.00	4.55
19	600754	锦江酒店	5,146,155.00	4.50
20	300529	健帆生物	5,098,863.10	4.46
21	300725	药石科技	4,948,377.94	4.33
22	000625	长安汽车	4,887,356.00	4.27
23	600519	贵州茅台	4,803,233.00	4.20
24	603939	益丰药房	4,714,965.00	4.12
25	002840	华统股份	4,675,867.20	4.09
26	600690	海尔智家	4,582,689.00	4.01
27	600285	羚锐制药	4,559,642.00	3.99
28	601225	陕西煤业	4,476,395.00	3.91
29	603156	养元饮品	4,421,773.00	3.87
30	600176	中国巨石	4,381,332.00	3.83
31	000895	双汇发展	4,323,309.00	3.78
32	688062	迈威生物	4,185,465.85	3.66
33	300347	泰格医药	4,059,226.00	3.55
34	000589	贵州轮胎	3,766,592.00	3.29
35	601857	中国石油	3,744,012.00	3.27
36	601021	春秋航空	3,712,874.00	3.25
37	688076	诺泰生物	3,643,364.42	3.19
38	603199	九华旅游	3,637,079.00	3.18
39	002311	海大集团	3,389,707.00	2.96
40	301345	涛涛车业	3,222,472.70	2.82
41	000400	许继电气	3,189,872.00	2.79
42	600276	恒瑞医药	3,163,796.20	2.77
43	002033	丽江股份	3,094,535.00	2.71
44	600129	太极集团	3,045,467.00	2.66
45	002327	富安娜	3,038,772.48	2.66
46	002444	巨星科技	3,034,008.00	2.65

47	603868	飞科电器	3,029,118.00	2.65
48	600572	康恩贝	3,017,617.00	2.64
49	000568	泸州老窖	2,934,755.00	2.57
50	02020	安踏体育	2,927,115.40	2.56
51	01801	信达生物	2,904,546.24	2.54
52	002032	苏泊尔	2,900,042.00	2.54
53	000596	古井贡酒	2,874,528.00	2.51
54	300364	中文在线	2,836,036.00	2.48
55	002230	科大讯飞	2,833,030.00	2.48
56	002668	TCL 智家	2,802,202.00	2.45
57	600054	黄山旅游	2,785,792.00	2.44
58	601601	中国太保	2,780,094.00	2.43
59	600566	济川药业	2,724,059.00	2.38
60	688526	科前生物	2,691,389.14	2.35
61	300396	迪瑞医疗	2,665,214.00	2.33
62	000516	国际医学	2,627,589.00	2.30
63	001215	千味央厨	2,584,786.00	2.26
64	00883	中国海洋石油	2,530,250.72	2.21
65	002567	唐人神	2,511,359.00	2.20
66	688192	迪哲医药	2,510,393.69	2.20
67	600189	泉阳泉	2,488,948.00	2.18
68	603215	比依股份	2,434,967.00	2.13
69	600535	天士力	2,383,359.00	2.08
70	603998	方盛制药	2,369,088.00	2.07
71	000423	东阿阿胶	2,335,364.00	2.04
72	600839	四川长虹	2,289,466.00	2.00

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	450,510,651.79
卖出股票收入（成交）总额	458,707,213.05

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

1	国家债券	6,064,384.11	6.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,064,384.11	6.67

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019733	24 国债 02	60,000	6,064,384.11	6.67

### 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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发现存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	128,427.34
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,536.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	130,963.66

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
东方品质消费一年持有期混合 A	3,820	52,561.98	4,965,625.00	2.47	195,821,136.94	97.53
东方品质消费一年持有期混合 C	2,143	14,919.70	0.00	0.00	31,972,925.78	100.00
合计	5,963	39,033.99	4,965,625.00	2.13	227,794,062.72	97.87

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有	东方品质消费一年持有期	458,907.72	0.23

从业人员持有本基金	混合 A		
	东方品质消费一年持有期混合 C	500,325.69	1.56
	合计	959,233.41	0.41

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方品质消费一年持有期混合 A	10~50
	东方品质消费一年持有期混合 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	东方品质消费一年持有期混合 A	0
	东方品质消费一年持有期混合 C	50~100
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方品质消费一年持有期混合 A	东方品质消费一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2021 年 7 月 8 日) 基金份额总额	305,033,356.59	60,600,556.00
本报告期期初基金份额总额	214,286,439.09	35,872,713.57
本报告期基金总申购份额	1,987,195.21	380,819.22
减：本报告期基金总赎回份额	15,486,872.36	4,280,607.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	200,786,761.94	31,972,925.78

注：基金总申购份额包含红利再投资、基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券股份有限公司	2	690,904,432.52	76.00	654,054.20	76.04	-
光大证券股份有限公司	2	216,138,092.67	23.77	205,130.02	23.85	-
浙商证券股份有限公司	2	2,062,856.00	0.23	920.01	0.11	-
德邦证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限	2	-	-	-	-	-

公司						
太平洋证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；③经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚，或处罚未对其研究服务业务产生重大影响；④合规风控能力较强，具备健全的风险管理机制、合规管理机制和信息管理机制；⑤具备为公募基金提供交易服务所需的业务资格，能够提供高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥具备为公募基金提供研究服务所需的业务资格，建立完善的研究报告质量控制和合规保障机制，具备独立客观的研究观点，能够提供各类研究服务支持，形式包括但不限于线上/线下路演、线上/线下会议、沟通交流、调研活动、数据支持、专题研讨、委托课题、金股推介等；⑦证监系统白名单券商优先纳入合作对象；⑧证监会券商分类标准原则上 CCC 级以下不纳入合作对象；⑨收取的佣金率满足各项法律法规、监管政策的相关规定。

券商选择程序：每年定期根据已租用交易单元的券商提供的资质说明，经交易佣金管理小组审议通过后，建立公司内部券商白名单。如有新增券商，在履行上述程序通过后，可不定期加入公司内部白名单。

（3）本报告期内本基金交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券股份有限公司	13,612,596.00	100.00	-	-	-	-

光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方基金管理股份有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 2 日
2	东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 20 日
3	关于增加上海大智慧基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时参与申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 5 日
4	东方基金管理股份有限公司关于终止和合期货有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 23 日

5	关于提醒投资者防范不法分子仿冒我司名义从事诈骗活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 23 日
6	关于旗下部分基金参与深圳前海微众银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 2 月 29 日
7	关于增加江苏银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 14 日
8	关于旗下部分基金参与玄元保险代理有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 15 日
9	关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司等两家机构申购费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 27 日
10	东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 30 日
11	东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 2 日
12	东方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资北交所股票及相关风险提示的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 10 日
13	东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 20 日
14	东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 27 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、《东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）查阅。

东方基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 31 日