

东方红品质优选两年定期开放混合型证券 投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 年 01 月 16 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	12
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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
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	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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	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
§ 8 基金份额持有人信息	49
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	50
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
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
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
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
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	东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金
基金简称	东方红品质优选定开混合
基金主代码	008263
基金运作方式	契约型，定期开放式，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式
基金合同生效日	2020 年 1 月 16 日
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,346,802,076.46 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金主要投资于固定收益类资产，本基金的投资策略将结合基金每两年开放一次，在封闭期封闭运作，在开放期内有大规模申购赎回的流动性需求的特点，做好流动性管理，在临近开放期和开放期内，更多的关注组合资产的流动性；在封闭期内，充分发挥封闭运作的优势，做一些长久期匹配。</p> <p>基于本基金每满两年开放一次，除开放期外封闭运作的特点，基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力，分散投资，做好流动性管理以应对开放期投资者的赎回需求。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	<p>本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李云亮	张燕
	联系电话	021-63325888	0755-83199084
	电子邮箱	service@dfham.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	95555
传真		021-63326981	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 318 号 31	深圳市深南大道 7088 号招商银

	层	行大厦
办公地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	潘鑫军	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金中期报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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	中国北京市西城区太平桥大街 17 号
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

§ 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(2020 年 1 月 16 日(基金合同生效日) - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	35,553,429.92
本期利润	13,532,724.12
加权平均基金份额本期利润	0.0058
本期加权平均净值利润率	0.58%
本期基金份额净值增长率	0.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	13,532,724.12
期末可供分配基金份额利润	0.0058
期末基金资产净值	2,360,334,800.58
期末基金份额净值	1.0058
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.58%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

4、本基金合同于 2020 年 1 月 6 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满半年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.39%	0.27%	0.69%	0.19%	0.70%	0.08%
过去三个月	3.10%	0.31%	1.24%	0.21%	1.86%	0.10%
自基金合同生效起至今	0.58%	0.39%	-0.06%	0.30%	0.64%	0.09%

注：1、自基金合同生效日起至今指 2020 年 1 月 16 日-2020 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%。

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

$$\text{benchmark}_t = 80\% \times [\text{t 日中债综合指数} / (\text{t-1 日中债综合指数}) - 1] + 15\% \times [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 5\% \times [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1 日恒生指数}) - 1]$$

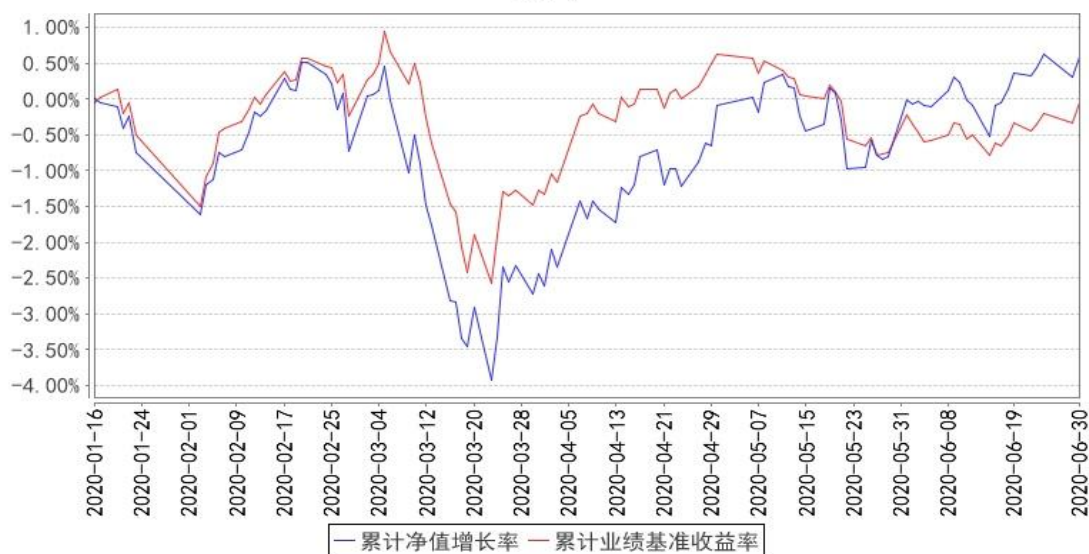
期间 T 日收益率 (benchmark_T) 按下列公式计算：

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

$\prod (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 $(1 + \text{benchmark}_t)$ 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

东方红品质优选定开混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2020 年 1 月 16 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2020 年 1 月 16 日起至 2020 年 7 月 15 日，至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理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、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵

活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红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、东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债券型证券投资基金、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、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）及东方红智远三年持有期混合型证券投资基金共计 49 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		
孔超	上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部总经理助理、本基金基金经理	2020 年 01 月 17 日	-	9 年	上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部总经理助理、2016 年 08 月至今任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2018 年 03 月至今任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 05 月

					至今任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018 年 06 月至今任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 06 月至今任东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2018 年 07 月至今任东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理、2019 年 09 月至今任东方红聚利债券型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至今任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。北京大学金融学硕士。历任平安证券有限责任公司总部综合研究所策略研究员，国信证券股份有限公司经济研究所策略研究研究员，上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部基金经理。具备证券投资基金从业资格。
胡伟	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募固定收益投资部总经理、本基金基金经理	2020 年 6 月 3 日	-	16 年	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募固定收益投资部总经理、2020 年 05 月至今任东方红收益增强债券型证券投资基金基金经理、2020 年 05 月至今任东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金经理、2020 年 06 月至今任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 06 月至今任东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。中南财经政法大学金融学学士。历任珠海市商业银行资金营运部债券交易员，华富基金管理有限公司债券交易员，固定收益部基金经理、副总监、总监，总经理助理。具备证券投资基金从业资格。

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

权益方面，上半年市场整体走势分化，上证综指下跌 2.15%，创业板表现更加突出，创业板指上半年上涨 35.6%。新冠疫情的出现超出了市场预期，在这种环境下，多数上市公司的盈利受到了一定程度的冲击；但另一方面，疫情冲击的环境下流动性较为宽松，一些长期成长空间较为广阔的公司估值水平出现了较为明显的提升。我们逐步降低了一些估值偏高的行业的配置，增加了一些虽然短期受到冲击、但长期竞争优势明显的行业龙头的配置。

转债方面，上半年中证转债指数下跌 1.84%。转债整体的估值相比年初有一定的压缩，结构分化仍然较大。本基金前期持有的一些转债逐步实现了换股收益，同时自下而上精选一些优质的新发转债进行配置。

债券方面，2020 年上半年全球经历了新冠疫情的冲击，经济出现大幅下滑，进入二季度后，国内随着疫情得到控制以及复工复产的持续，经济领先全球得到修复。虽然全球仍处于大放水的环境中，但央行 5 月开始已将货币政策从前期危机模式调回正常模式。债券市场经历了大幅的波动，10 年国债从年初 3.15%一路下行至 4 月上旬 2.48%的位置，随后又回调至 2.82%。信用债也跟随波动，且在 3-4 月出现了信用利差大幅压缩的情况，3 年 AAA 一度低至 2.53%；5 月后随着市场调整，信用利差再度走扩，整个上半年来看，3 年 AAA 下行 22BP 至 3.2%。本产品在债券配置上精选个券，有效防范信用风险，调整组合久期和杠杆，获取了较为稳定的收益。

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 1.0058 元，份额累计净值为 1.0058 元；本报告期基金

份额净值增长率为 0.58%，业绩比较基准收益率为-0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面，展望未来，随着疫情带来的不确定性逐渐消退，在疫情不会二次爆发的情景下，宏观环境将逐渐回归正常路径。另外，中美关系也会带来一定的不确定性。目前市场估值分化较大，未来我们仍然坚持价值投资理念，自下而上精选估值合理的优质公司进行配置，同时关注一些估值水平处于历史低位、股息回报率已经较高的大盘蓝筹公司。

转债方面，目前转债的整体估值水平相对合理，结构性分化较大，有一些转债开始具备较好的投资价值。长期来看我们仍然认为可转债是非常优秀的投资品种，未来主要考虑股票本身资质和转债的溢价水平，在转债市场中选择一些优质的转债品种进行配置。

债券方面，从全球来看，疫情虽然仍未过去，但不确定性已逐渐变小。资本市场逐渐从疫情的影响中走出来，风险偏好逐步提升。可以预期的是，在发行了大量特别国债与地方债后，财政政策将继续发力，而货币政策将继续边际收紧，政策组合由宽货币转为宽信用。但货币政策转向的可能性目前看也不大，通胀和汇率短期都不对其构成制约。整体来看，经济将保持复苏的趋势，但疫情的延续性对经济仍具有持续的影响，导致后期经济复苏的“斜率”或有减缓。因此，预计债券市场后期或处于区间震荡的走势，无风险利率的中枢逐步抬升；信用债则受益于宽松的资金面，经历前期快速下跌后，配置价值提升，但防范信用风险仍是重中之重。操作上我们仍将维持个券精细化操作，努力寻求稳健的收益。

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

本基金收益分配应遵循下列原则：

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

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

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	42,052,388.12
结算备付金		5,762,076.98
存出保证金		217,239.28
交易性金融资产	6.4.7.2	2,680,533,736.39
其中：股票投资		599,522,182.98
基金投资		-
债券投资		2,031,108,531.50
资产支持证券投资		49,903,021.91
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	35,693,481.09
应收股利		3,325,608.00
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		2,767,584,529.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		404,000,000.00
应付证券清算款		1,033,975.08
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,540,742.98
应付托管费		385,185.72
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	32,931.89
应交税费		152,221.35
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	104,672.26
负债合计		407,249,729.28
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	2,346,802,076.46
未分配利润	6.4.7.10	13,532,724.12
所有者权益合计		2,360,334,800.58
负债和所有者权益总计		2,767,584,529.86

注：本基金合同生效日为 2020 年 01 月 16 日，本报告期自基金合同生效日 2020 年 01 月 16 日起至 2020 年 06 月 30 日止。报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0058 元，基金份额总额 2,346,802,076.4600 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 16 日（基金合同 生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		25,874,607.01
1. 利息收入		29,479,032.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	559,669.34
债券利息收入		20,870,189.88
资产支持证券利息收入		1,728,349.75
买入返售金融资产收入		6,320,823.51
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,416,280.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,932,502.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	36,182.89
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-204,624.66
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	8,652,219.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-22,020,705.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、费用		12,341,882.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,454,642.35

2. 托管费	6.4.10.2.2	2,113,660.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	815,720.77
5. 利息支出		776,949.54
其中：卖出回购金融资产支出		776,949.54
6. 税金及附加		65,177.94
7. 其他费用	6.4.7.20	115,731.81
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		13,532,724.12
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		13,532,724.12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,346,802,076.46	-	2,346,802,076.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,532,724.12	13,532,724.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,346,802,076.46	13,532,724.12	2,360,334,800.58

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：

任莉

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

东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1989号《关于准予东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,345,981,508.61 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 0050 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,346,802,076.46 份基金份额,其中认购资金利息折合 820,567.85 份基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日,结束之日为基金合同生效日所对应的第二年年度对应日前的倒数第一个工作日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日,结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第二年年度对应日前的倒数第一个工作日,依次类推。本基金自封闭期结束之后的下一个工作日起(即每个开放期首日为每个封闭期起始之日的第二年年度对应日,包括该日)进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日。

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》、《东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 16 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具（主要为股指期货）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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。

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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为股指期货)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指

数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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]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。

(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。

(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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	42,052,388.12
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	42,052,388.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	609,385,388.98	599,522,182.98	-9,863,206.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,751,671,531.50	-13,036,592.92
	银行间市场	279,437,000.00	879,093.12
	合计	2,031,108,531.50	-12,157,499.80
资产支持证券	49,903,021.91	49,903,021.91	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,702,554,442.19	2,680,533,736.39	-22,020,705.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	4,853.07
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,082.70
应收债券利息	33,088,402.85
应收资产支持证券利息	2,597,019.18
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	123.29
合计	35,693,481.09

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	30,881.89
银行间市场应付交易费用	2,050.00
合计	32,931.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

预提费用	104,672.26
合计	104,672.26

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,346,802,076.46	2,346,802,076.46
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,346,802,076.46	2,346,802,076.46

注：本基金合同生效日为 2020 年 1 月 16 日。本基金在募集期间有效净认购资金共计 2,345,981,508.61 元，折合基金份额 2,345,981,508.61 份，产生的利息收入 820,567.85 元，折合基金份额 820,567.85 份，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	35,553,429.92	-22,020,705.80	13,532,724.12
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,553,429.92	-22,020,705.80	13,532,724.12

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	活期存款利息收入	358,054.80
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	199,503.96	
其他	2,110.58	
合计	559,669.34	

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,932,502.64
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	9,932,502.64

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出股票成交总额	39,966,013.07
减：卖出股票成本总额	30,033,510.43
买卖股票差价收入	9,932,502.64

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	36,182.89
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	36,182.89

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,271,111.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,044,876.71
减：应收利息总额	1,190,052.02
买卖债券差价收入	36,182.89

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	21,414,684.00
减：卖出资产支持证券成本总额	20,204,624.66
减：应收利息总额	1,414,684.00
资产支持证券投资收益	-204,624.66

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,652,219.46
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,652,219.46

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-22,020,705.80
股票投资	-9,863,206.00
债券投资	-12,157,499.80
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	-22,020,705.80

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	813,670.77
银行间市场交易费用	2,050.00
合计	815,720.77

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	47,578.30
信息披露费	57,093.96
证券出借违约金	-
银行费用	11,059.55
合计	115,731.81

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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

本基金合同生效日为 2020 年 1 月 16 日，无上年度可比期间。

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 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
东方证券	194,781,164.02	28.91

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
东方证券	332,616,374.84	19.86

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东方证券	2,110,000,000.00	6.97

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
东方证券	138,547.07	27.93	-	-

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
	2020 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,454,642.35
其中：支付销售机构的客户维护费	3,854,324.28

注：基金管理人的管理费本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,113,660.48

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

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 2020年1月16日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	42,052,388.12	358,054.80

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688004	博汇科技	2020年6月5日	2020年12月14日	新股流通受限	28.77	71.90	2,500	71,925.00	179,750.00	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688518	联赢激光	2020年6月12日	2020年12月22日	新股流通受限	7.81	20.83	14,111	110,206.91	293,932.13	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688566	吉贝尔	2020年5月8日	2020年11月18日	新股流通受限	23.69	38.43	9,882	234,104.58	379,765.26	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-

688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123052	飞鹿转债	2020年6月10日	2020年7月3日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

2、本基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本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

截至本报告期末2020年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额404,000,000.00元，于2020年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下

设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案等。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

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 2020年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	29,832,000.00
合计	29,832,000.00

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.2 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 2020年6月30日
A-1	29,842,643.83

A-1 以下	-
未评级	-
合计	29,842,643.83

注：该评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	49,115,000.00
合计	49,115,000.00

注：该评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日
AAA	1,612,271,307.00
AAA 以下	339,890,224.50
未评级	-
合计	1,952,161,531.50

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日
AAA	-
AAA 以下	20,060,378.08
未评级	-
合计	20,060,378.08

注：该评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 404,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 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 2020 年 6 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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	42,052,388.12	-	-	-	-	-	42,052,388.12
结算备付金	5,762,076.98	-	-	-	-	-	5,762,076.98

存出保证金	217,239.28	-	-	-	-	-	217,239.28
交易性金融资产	80,367,378.08	160,451,643.83	513,651,620.90	1,192,144,053.20	134,396,857.40	599,522,182.98	2,680,533,736.39
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	35,693,481.09	35,693,481.09
应收股利	-	-	-	-	-	3,325,608.00	3,325,608.00
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	128,399,082.46	160,451,643.83	513,651,620.90	1,192,144,053.20	134,396,857.40	638,541,272.07	2,767,584,529.86
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,540,742.98	1,540,742.98
应付托管费	-	-	-	-	-	385,185.72	385,185.72
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,033,975.08	1,033,975.08
卖出回购金融资产款	404,000,000.00	-	-	-	-	-	404,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	32,931.89	32,931.89
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	152,221.35	152,221.35
其他负债	-	-	-	-	-	104,672.26	104,672.26
负债总计	404,000,000.00	-	-	-	-	3,249,729.28	407,249,729.28
利率敏感度缺口	-275,600,917.54	160,451,643.83	513,651,620.90	1,192,144,053.20	134,396,857.40	635,291,542.79	2,360,334,800.58

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020年6月30日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	12,084,681.35
	2. 市场利率上升 25 个基点	-11,956,117.30

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本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 2020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	-	175,482,946.84	-	175,482,946.84
资产合计	-	175,482,946.84	-	175,482,946.84
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	-	175,482,946.84	-	175,482,946.84

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变
----	----------------

	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020年6月30日）
分析	1、港币相对人民币升值 5%	8,774,147.34
	2、港币相对人民币贬值 5%	-8,774,147.34

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 2020年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	599,522,182.98	25.40
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	599,522,182.98	25.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020年6月30日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	38,027,473.76
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-38,027,473.76

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其

他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间百分之九十五		
	2. 观察期统计日之前的 250 个交易日		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1 天	14,491,687.03	-
	1 周	32,751,546.74	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 737,133,893.92 元，属于第二层次的余额为 1,893,496,820.56 元，属于第三层次的余额为 49,903,021.91 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具为 49,903,021.91 元。本基金本期净转入第三层次的金额为 49,903,021.91 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为 0 元。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	599,522,182.98	21.66
	其中：股票	599,522,182.98	21.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,081,011,553.41	75.19
	其中：债券	2,031,108,531.50	73.39
	资产支持证券	49,903,021.91	1.80
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	47,814,465.10	1.73
8	其他各项资产	39,236,328.37	1.42
9	合计	2,767,584,529.86	100.00

注：1、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 175,482,946.84 元人民币，占期末基金资产净值比例 7.43%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

B	采矿业	-	-
C	制造业	253,646,689.88	10.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	22,263,688.80	0.94
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,903,256.00	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,380,170.34	2.01
J	金融业	36,909,065.60	1.56
K	房地产业	34,332,276.00	1.45
L	租赁和商务服务业	18,591,323.20	0.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	424,039,236.14	17.97

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	32,934,141.84	1.40
C 消费者常用品	-	-
D 能源	37,055,625.00	1.57
E 金融	37,335,000.00	1.58
F 医疗保健	-	-
G 工业	2,536,740.00	0.11
H 信息科技	-	-
I 电信服务	61,541,440.00	2.61
J 公用事业	4,080,000.00	0.17
K 房地产	-	-
合计	175,482,946.84	7.43

注：以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

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	00700	腾讯控股	98,400	44,815,296.00	1.90

2	000333	美的集团	675,300	40,376,187.00	1.71
3	02628	中国人寿	2,620,000	37,335,000.00	1.58
4	600741	华域汽车	1,702,561	35,396,243.19	1.50
5	01088	中国神华	3,187,500	35,285,625.00	1.49
6	000002	万科A	1,313,400	34,332,276.00	1.45
7	600426	华鲁恒升	1,927,000	34,069,360.00	1.44
8	002415	海康威视	1,102,790	33,469,676.50	1.42
9	600887	伊利股份	1,073,100	33,405,603.00	1.42
10	600030	中信证券	1,000,000	24,110,000.00	1.02
11	600031	三一重工	1,265,200	23,735,152.00	1.01
12	02313	申洲国际	274,600	23,428,872.00	0.99
13	002065	东华软件	1,852,866	23,197,882.32	0.98
14	601668	中国建筑	4,667,440	22,263,688.80	0.94
15	002027	分众传媒	3,337,760	18,591,323.20	0.79
16	601012	隆基股份	451,118	18,374,036.14	0.78
17	000997	新大陆	1,048,900	16,761,422.00	0.71
18	00772	阅文集团	350,800	16,726,144.00	0.71
19	600438	通威股份	956,200	16,618,756.00	0.70
20	000001	平安银行	999,927	12,799,065.60	0.54
21	600745	闻泰科技	94,800	11,940,060.00	0.51
22	601021	春秋航空	309,400	10,903,256.00	0.46
23	02020	安踏体育	152,133	9,505,269.84	0.40
24	300271	华宇软件	249,925	7,050,384.25	0.30
25	600309	万华化学	100,000	4,999,000.00	0.21
26	01071	华电国际电力股份	2,000,000	4,080,000.00	0.17
27	00177	江苏宁沪高速公路	306,000	2,536,740.00	0.11
28	00386	中国石油化工股份	600,000	1,770,000.00	0.07
29	688566	吉贝尔	9,882	379,765.26	0.02
30	688518	联赢激光	14,111	293,932.13	0.01
31	688004	博汇科技	2,500	179,750.00	0.01
32	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
33	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
34	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
35	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
36	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
37	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
38	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
39	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
40	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
41	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
42	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
43	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00

44	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
45	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

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

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600741	华域汽车	44,852,551.35	1.90
2	01088	中国神华	41,659,722.03	1.76
3	000333	美的集团	39,025,210.18	1.65
4	000002	万科A	38,942,874.23	1.65
5	02628	中国人寿	38,884,259.70	1.65
6	002415	海康威视	36,947,862.23	1.57
7	600426	华鲁恒升	35,980,815.48	1.52
8	00700	腾讯控股	35,560,405.17	1.51
9	600887	伊利股份	35,108,209.79	1.49
10	601668	中国建筑	26,962,191.00	1.14
11	02313	申洲国际	26,770,611.12	1.13
12	002065	东华软件	26,544,049.76	1.12
13	600031	三一重工	23,468,592.00	0.99
14	600030	中信证券	22,097,939.00	0.94
15	002027	分众传媒	19,845,852.40	0.84
16	000997	新大陆	19,235,335.00	0.81
17	00772	阅文集团	17,294,180.99	0.73
18	601012	隆基股份	13,993,396.04	0.59
19	600438	通威股份	13,921,291.00	0.59
20	002304	洋河股份	13,875,483.38	0.59

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002304	洋河股份	13,926,177.11	0.59
2	00772	阅文集团	8,266,131.41	0.35
3	02020	安踏体育	2,426,482.10	0.10
4	00700	腾讯控股	2,382,005.64	0.10
5	600031	三一重工	2,356,816.00	0.10
6	688599	天合光能	1,714,354.13	0.07
7	688520	神州细胞	1,049,835.00	0.04
8	688106	金宏气体	1,043,000.00	0.04
9	688318	财富趋势	906,832.08	0.04

10	688086	紫晶存储	749,907.83	0.03
11	688051	佳华科技	526,890.00	0.02
12	688312	燕麦科技	502,520.00	0.02
13	688189	南新制药	430,847.89	0.02
14	688222	成都先导	366,456.31	0.02
15	688157	松井股份	280,835.10	0.01
16	688228	开普云	271,256.40	0.01
17	688365	光云科技	244,116.98	0.01
18	688555	泽达易盛	228,874.76	0.01
19	688466	金科环境	225,722.00	0.01
20	688516	奥特维	216,720.00	0.01

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	639,418,899.41
卖出股票收入（成交）总额	39,966,013.07

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	270,976,000.00	11.48
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,240,346,941.50	52.55
5	企业短期融资券	29,832,000.00	1.26
6	中期票据	149,025,000.00	6.31
7	可转债（可交换债）	291,813,590.00	12.36
8	同业存单	49,115,000.00	2.08
9	其他	-	-
10	合计	2,031,108,531.50	86.05

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	110059	浦发转债	1,100,000	112,035,000.00	4.75
2	143354	17中车G2	1,000,000	104,330,000.00	4.42

3	163156	20 中证 G1	1,000,000	99,820,000.00	4.23
4	163181	20 东风 01	800,000	79,648,000.00	3.37
5	163092	20 安信 G1	700,000	70,581,000.00	2.99

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	139908	信捷 15 优	300,000	29,842,643.83	1.26
2	139827	建银 2 优 A	200,000	20,060,378.08	0.85

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金持有的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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	217,239.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,325,608.00
4	应收利息	35,693,481.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,236,328.37

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	112,035,000.00	4.75
2	132009	17 中油 EB	51,158,100.00	2.17
3	132013	17 宝武 EB	51,115,000.00	2.17
4	132015	18 中油 EB	50,000,000.00	2.12
5	113021	中信转债	10,002,082.60	0.42
6	128033	迪龙转债	6,864,900.00	0.29
7	113025	明泰转债	5,128,500.00	0.22
8	113020	桐昆转债	2,352,400.00	0.10
9	110065	淮矿转债	889,112.10	0.04

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
18,235	128,697.67	2,079,302.42	0.09	2,344,722,774.04	99.91

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	1,142,372.69	0.0487

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 1 月 16 日) 基金份额总额	2,346,802,076.46
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	2,346,802,076.46

注：本基金合同生效日为 2020 年 1 月 16 日。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2020 年 5 月 15 日起，林鹏同志不再担任本基金管理人副总经理职务。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内本基金未发生改聘会计师事务所的情形。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	338,938,768.44	50.30%	257,918.02	51.99%	-
东方证券	5	194,781,164.02	28.91%	138,547.07	27.93%	-
中信建投证券	2	117,350,890.85	17.42%	83,471.73	16.83%	-
兴业证券	1	22,736,598.46	3.37%	16,172.66	3.26%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
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、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序：

(1) 选择标准：

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

(2) 选择程序：

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

3、本基金合同生效日为 2020 年 1 月 16 日，上述交易单元均为本报告期新增。

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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券 成交总额 的比例		券回购 成交总额 的比例		证 成交总额 的比例
长江证券	1,225,798,825.36	73.19%	28,111,400,000.00	92.93%	-	-
东方证券	332,616,374.84	19.86%	2,110,000,000.00	6.97%	-	-
中信建投证券	59,555,454.51	3.56%	30,000,000.00	0.10%	-	-
兴业证券	56,958,618.18	3.40%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金合同生效公告	规定媒介	2020年01月17日

2	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 2020 年春节假期期间相关业务安排调整的公告	规定媒介	2020 年 01 月 30 日
3	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	规定媒介	2020 年 03 月 18 日
4	东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	规定媒介	2020 年 04 月 22 日
5	关于在网上直销平台开通东方红货币市场基金 D 类份额与旗下部分基金赎回转购（含定期定额赎回转购）业务的公告	规定媒介	2020 年 04 月 24 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	规定媒介	2020 年 05 月 16 日
7	上海东方证券资产管理有限公司关于增聘东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理的公告	规定媒介	2020 年 06 月 03 日
8	东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2020 年第 1 号)	规定媒介	2020 年 06 月 05 日
9	东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金招募说明书(摘要)(2020 年第 1 号)	规定媒介	2020 年 06 月 05 日

注：本基金信息披露的规定媒介为上海证券报、公司官网、中国证监会基金电子披露网站。上述公告中，基金合同、招募说明书、定期报告、上市交易公告书仅在规定网站披露，规定报刊仅披露相关提示性公告。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；

- 4、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、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的办公场所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层。

12.3 查阅方式

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

上海东方证券资产管理有限公司

2020 年 8 月 31 日