

# 东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 02 月 25 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 错误!未定义书签。 |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 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等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>42</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42        |
| 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                     | 45        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 47        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 47        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 47        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 47        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 47        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 47        |
| 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>50</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 50        |
| 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        |
| <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>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 51        |
| 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 .....                           | 52        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>53</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 .....    | 53        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 53        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 53        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 54        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 54        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                             |
|------------|-----------------------------|
| 基金名称       | 东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金       |
| 基金简称       | 东方红匠心甄选一年持有混合               |
| 基金主代码      | 008990                      |
| 基金运作方式     | 契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置一年锁定持有期 |
| 基金合同生效日    | 2020 年 2 月 25 日             |
| 基金管理人      | 上海东方证券资产管理有限公司              |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司                |
| 报告期末基金份额总额 | 2,978,428,698.58 份          |
| 基金合同存续期    | 不定期                         |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略，在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略努力实现基金资产的稳定增值。   |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率×2%+中债综合指数收益率×90%   |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                      | 基金托管人                 |
|-------------|------|----------------------------|-----------------------|
| 名称          |      | 上海东方证券资产管理有限公司             | 中国建设银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李云亮                        | 李申                    |
|             | 联系电话 | 021-63325888               | 021-60637102          |
|             | 电子邮箱 | service@dfham.com          | lishen.zh@ccb.com     |
| 客户服务电话      |      | 4009200808                 | 021-60637111          |
| 传真          |      | 021-63326981               | 021-60635778          |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层      | 北京市西城区金融大街 25 号       |
| 办公地址        |      | 上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码        |      | 200010                     | 100033                |
| 法定代表人       |      | 潘鑫军                        | 田国立                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |  |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报   |
| 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<br>中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |

## 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 2 月 25 日(基金合同生效日) - 2020 年 6 月 30 日) |
|---------------|---|
| 本期已实现收益       | 26,124,687.01                                   |
| 本期利润          | 22,438,550.07                                   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0075  |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.75%   |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.75%   |
| 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      | 22,438,550.07                                   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0075  |
| 期末基金资产净值      | 3,000,867,248.65                                |
| 期末基金份额净值      | 1.0075  |
| 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   | 0.75%   |

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

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

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

4、本基金合同于 2020 年 2 月 25 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      | 0.33%    | 0.12%       | -0.12%     | 0.13%         | 0.45% | -0.01% |
| 过去三个月      | 1.06%    | 0.12%       | 0.14%      | 0.14%         | 0.92% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.75%    | 0.14%       | -0.40%     | 0.16%         | 1.15% | -0.02% |

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

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

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

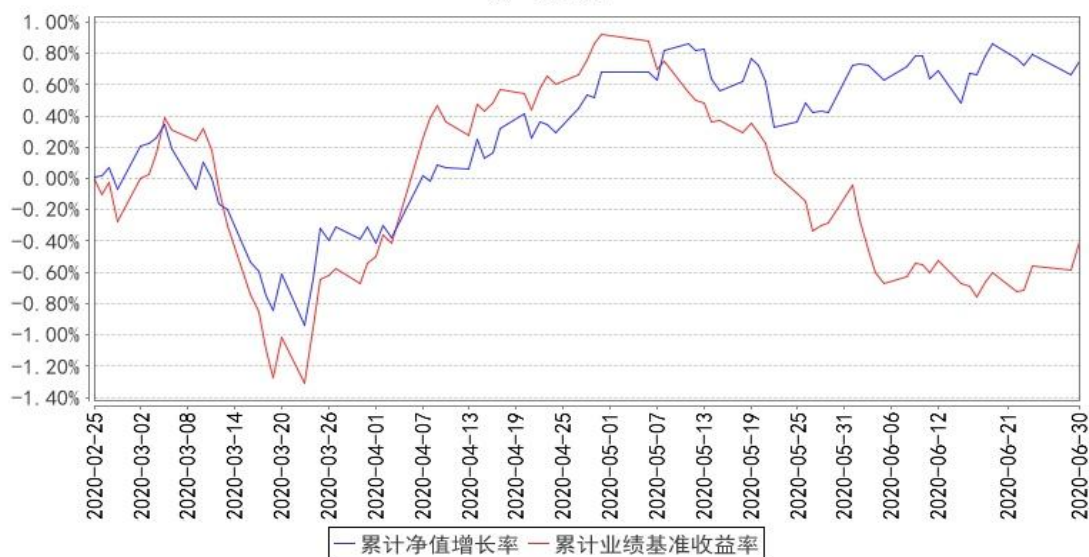
期间 T 日收益率 (benchmark<sub>T</sub>) 按下列公式计算：

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

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

东方红匠心甄选一年持有混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2020 年 2 月 25 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 2 月 25 日起至 2020 年 8 月 24 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 |        |  |
| 王佳骏 | 本基金基金经理 | 2020 年 2 月 25 日 | -    | 5 年    | 2019 年 08 月至今任东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至今任东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 02 月至今任东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 03 月至今任东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。帝国理工学院金融学硕士。历任国信证券股份有限公司助理分析师，上海东方证券 |

|    |  |                |   |      |  |
|----|--|----------------|---|------|--|
|    |  |                |   |      | 资产管理有限公司私募固定收益投资部投资支持高级经理。具备证券投资基金从业资格。中国国籍。   |
| 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。中国国籍。 |

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场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

债券方面，上半年疫情防治进展对市场影响较大，一季度标志性的 10Y 国债收益率曾突破 2008 年金融危机时的水平，央行也采取下调存款准备金率、降低商业银行超额准备金利率等措施，以应对经济下行压力。二季度随着疫情得到有效防控，我国经济的韧性与活力逐步体现。虽然部分政策工具适时退出，但在央行努力下，市场流动性仍然保持充裕，信贷和社融明显增长，前期过于乐观的债券定价水平也得到一定修正。组合配置以投资级信用债为主，久期较短，较好的规避了后续收益率上行的冲击。

权益方面，今年市场风格差异较大，上半年创业板指上涨 35.6%，而同期上证综指下跌 2.2%；同时，行业间的估值水平也出现了明显分化，消费、科技等板块的估值处在历史极高位置，而金融地产等周期行业的估值则处在历史底部。报告期内权益仓位维持在产品的目标风险范围之内，自下而上精选基本面稳健、估值合理的优质公司进行分散配置。

转债市场整体上半年表现一般，指数上半年下跌 1.84%，但个券表现分化较大。转债估值也在上半年经历了先拉升后压缩的过程，整体估值较前两年有了明显的修复。报告期内，组合内的转债仓位整体不高，以偏债类 EB 和低估值品种为主。

### 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 1.0075 元，份额累计净值为 1.0075 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.75%，同期业绩比较基准收益率为-0.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，疫情逐步得到有效防控，国内政策的着眼点转向就业和增长，阶段性通胀和金融风险需要关注。在市场达成新的均衡水平过程中，组合仍维持投资级信用债的配置为主，以获取票息为目的，并适度拉长组合久期。我们也将继续发挥团队信用研究的传统优势，坚持自下而上的个体研究，着重调研具有竞争优势的产业龙头和政策支持地区的城投债，努力为持有人获取长期、稳健的回报。

权益方面，在新冠疫情不出现大规模二次爆发的情况下，国内宏观经济有望逐步回归至正常

增速区间。当前 A 股行业间估值分化仍然较大，未来我们仍然会坚持价值投资，自下而上精选估值合理的优质公司进行配置，重点关注以下几类方向：一是基本面稳健、低估值高分红的价值蓝筹，二是竞争优势显著、业绩稳定增长的制造业龙头公司，三是行业空间广阔、估值相对合理的新兴成长行业优质公司。

转债市场目前整体估值仍然不便宜，并且个券分化较大。但长期来看，转债仍然是一个良好的投资品种。未来转债市场主要以自下而上、精选个券为主，随着转债市场的继续扩容，仍有很多优质转债的机会可以继续挖掘。

#### 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，若每季度末每 10 份基金份额可供分配利润金额大于等于 0.01 元，则本基金进行收益分配，收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 60%，具体分配方案以公告为准。本基金每年收益分配次数最多为 12 次。若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

2、在本基金认购份额的锁定持有期内，收益分配方式仅现金分红一种方式；在本基金认购份额的锁定持有期结束后，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。

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

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

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

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

#### 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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：东方红匠心甄选一年持有期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<br>2020 年 6 月 30 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| <b>资 产:</b>     |            |                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 24,497,488.66                  |
| 结算备付金           |            | 44,820,762.00                  |
| 存出保证金           |            | 478,992.55                     |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 2,910,420,884.93               |
| 其中: 股票投资        |            | 333,747,743.13                 |
| 基金投资            |            | -                              |
| 债券投资            |            | 2,526,738,141.80               |
| 资产支持证券投资        |            | 49,935,000.00                  |
| 贵金属投资           |            | -                              |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              |
| 应收证券清算款         |            | 25,552.07                      |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 24,559,190.33                  |
| 应收股利            |            | 1,610,146.54                   |
| 应收申购款           |            | -                              |
| 递延所得税资产         |            | -                              |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              |
| 资产总计            |            | 3,006,413,017.08               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 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       |            | -                              |
| 应付证券清算款         |            | 3,125,313.10                   |
| 应付赎回款           |            | -                              |
| 应付管理人报酬         |            | 1,721,123.39                   |
| 应付托管费           |            | 491,749.57                     |
| 应付销售服务费         |            | -                              |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 48,466.10                      |
| 应交税费            |            | 73,360.79                      |
| 应付利息            |            | -                              |
| 应付利润            |            | -                              |
| 递延所得税负债         |            | -                              |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 85,755.48                      |
| 负债合计            |            | 5,545,768.43                   |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 2,978,428,698.58               |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 22,438,550.07                  |

|            |  |                  |
|------------|--|------------------|
| 所有者权益合计    |  | 3,000,867,248.65 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 3,006,413,017.08 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0075 元，基金份额总额 2,978,428,698.58 份。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 02 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 06 月 30 日止期间，无上年度末可比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 2 月 25 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<br>2020 年 2 月 25 日（基金合同<br>生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|---|
| 一、收入                   |            | 32,323,589.43                                       |
| 1. 利息收入                |            | 20,353,637.43                                       |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 705,235.12  |
| 债券利息收入                 |            | 10,676,526.53                                       |
| 资产支持证券利息收入             |            | 48,438.36   |
| 买入返售金融资产收入             |            | 8,923,437.42  |
| 证券出借利息收入               |            | -   |
| 其他利息收入                 |            | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 15,656,088.94                                       |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 10,155,662.84                                       |
| 基金投资收益                 | -          | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 666,955.64  |
| 资产支持证券投资收益             | 6.4.7.13.5 | -   |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14   | -   |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15   | -   |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | 4,833,470.46  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -3,686,136.94                                       |
| 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                 |            | 9,885,039.36  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 7,197,937.34  |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 2,056,553.53  |
| 3. 销售服务费               | -          | -   |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 483,925.54  |
| 5. 利息支出                |            | 33,694.09   |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 33,694.09   |

|                     |          |               |
|---------------------|----------|---------------|
| 6. 税金及附加            |          | 20,184.46     |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20 | 92,744.40     |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |          | 22,438,550.07 |
| 减: 所得税费用            |          | -             |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   |          | 22,438,550.07 |

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期: 2020 年 2 月 25 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<br>2020 年 2 月 25 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)                        | 2,978,428,698.58                                | -             | 2,978,428,698.58 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -   | 22,438,550.07 | 22,438,550.07    |
| 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)                        | 2,978,428,698.58                                | 22,438,550.07 | 3,000,867,248.65 |

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

东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]172 号《关于准予东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,978,428,698.58 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 0125 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,978,428,698.58 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金每份基金份额设置 1 年锁定持有期,由红利再投资而来的基金份额不受锁定持有期的限制。锁定持有期指基金合同生效日(对认购份额而言,下同)、基金份额申购申请日(对申购份额而言,下同)或基金份额转换转入申请日(对转换转入份额而言,下同)起(即锁定持有期起始日),至基金合同生效日、基金份额申购申请日或基金份额转换转入申请日次 1 年的年度对日(即锁定持有期到期日)止。每份基金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期,自其开放持有期首日起才可以办理赎回及转换转出业务,每份基金份额的开放持有期首日为锁定持有期起始日次 1 年的年度对日,若该年度对日为非工作日或不存在对应日期的,则顺延至下一个工作日。

### 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》、《东方红匠心甄选一年持有期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 2 月 25 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。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

#### 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 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间。

#### 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）〈视当期有无持仓来列示〉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〈视当期有无持仓来列示〉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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项〈视当期有无持仓来列示〉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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 24,497,488.66          |
| 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             | 24,497,488.66          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                  |                  |
|---------------|------------------------|------------------|------------------|
|               | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票            | 323,817,089.49         | 333,747,743.13   | 9,930,653.64     |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -                | -                |
| 债券            | 交易所市场                  | 1,816,163,694.85 | 1,802,656,141.80 |
|               | 银行间市场                  | 724,126,237.53   | 724,082,000.00   |
|               | 合计                     | 2,540,289,932.38 | 2,526,738,141.80 |
| 资产支持证券        | 50,000,000.00          | 49,935,000.00    | -65,000.00       |
| 基金            | -                      | -                | -                |

|    |                  |                  |               |
|----|------------------|------------------|---------------|
| 其他 | -                | -                | -             |
| 合计 | 2,914,107,021.87 | 2,910,420,884.93 | -3,686,136.94 |

#### 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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 3,912.30               |
| 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  | 16,974.36              |
| 应收债券利息     | 24,489,812.03          |
| 应收资产支持证券利息 | 48,438.36              |
| 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         | 53.28                  |
| 合计         | 24,559,190.33          |

#### 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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 46,150.76              |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,315.34               |
| 合计          | 48,466.10              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元



| 项目          | 本期末<br>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        | 85,755.48              |
| 合计          | 85,755.48              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020 年 2 月 25 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       | 2,978,428,698.58                                | 2,978,428,698.58 |
| 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           | 2,978,428,698.58                                | 2,978,428,698.58 |

注：本基金合同生效日为 2020 年 2 月 25 日。本基金在募集期间有效净认购资金共计 2,978,428,698.58 元，折合基金份额 2,978,428,698.58 份，产生的利息收入 0 元，折合基金份额 0 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           | 26,124,687.01 | -3,686,136.94 | 22,438,550.07 |
| 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            | 26,124,687.01 | -3,686,136.94 | 22,438,550.07 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------|---|
| 活期存款利息收入 | 431,536.01                                      |
| 定期存款利息收入 | -   |
| 其他存款利息收入 | -   |

|           |            |
|-----------|------------|
| 结算备付金利息收入 | 270,773.97 |
| 其他        | 2,925.14   |
| 合计        | 705,235.12 |

#### 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

##### 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<br>2020年2月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
|------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 45,069,731.91                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 34,914,069.07                        |
| 买卖股票差价收入   | 10,155,662.84                        |

##### 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<br>2020年2月25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 | 666,955.64                           |
| 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                            | 666,955.64                           |

##### 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<br>2020年2月25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 | 18,866,346.31                        |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）   | 18,165,783.97                        |

|          |            |
|----------|------------|
| 成本总额     |            |
| 减：应收利息总额 | 33,606.70  |
| 买卖债券差价收入 | 666,955.64 |

#### 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

注：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

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020 年 2 月 25 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   | 4,833,470.46                                    |
| 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            | 4,833,470.46                                    |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2020 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---|
| 1. 交易性金融资产             | -3,686,136.94                                   |
| 股票投资                   | 9,930,653.64                                    |
| 债券投资                   | -13,551,790.58                                  |
| 资产支持证券投资               | -65,000.00                                      |
| 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                     | -3,686,136.94                                   |

#### 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<br>2020 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---|
| 交易所市场交易费用 | 481,775.54                                      |
| 银行间市场交易费用 | 2,150.00  |
| 合计        | 483,925.54                                      |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2020 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|------|---|
| 审计费用 | 40,835.58                                       |

|         |           |
|---------|-----------|
| 信息披露费   | 44,919.90 |
| 证券出借违约金 | —         |
| 银行费用    | 6,628.92  |
| 账户维护费   | 360.00    |
| 合计      | 92,744.40 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |                     |
|-------|---|---------------------|
|       | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 269,245,838.57                                  | 67.45               |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |                     |
|-------|---|---------------------|
|       | 成交金额  | 占当期债券<br>成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 1,589,072,395.21                                | 98.52               |

#### 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<br>2020 年 2 月 25 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<br>成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 41,609,000,000.00                               | 100.00                |

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期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<br>2020年2月25日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |                   |           |                     |
|-------|--------------------------------------|-------------------|-----------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                             | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 东方证券  | 199,299.84                           | 68.32             | 20,016.27 | 43.37               |

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<br>2020 年 2 月 25 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  | 7,197,937.34                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,067,567.74                                    |

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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。

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期  |
|----------------|---|
|                | 2020 年 2 月 25 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 | 2,056,553.53                              |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值 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。

#### 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：本基金本报告期内未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

注：本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020 年 2 月 25 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     |
| 建设银行  | 24,497,488.66                                   | 431,536.01 |

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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：本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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   | - |
| 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 | - |
| 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  | - |
| 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<br>(单位: 张) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
|--------|-------|-----------------|-----------------|--------|--------|--------|---------------|----------|----------|----|
| 128112 | 歌尔转 2 | 2020 年 6 月 17 日 | 2020 年 7 月 13 日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 10            | 1,000.00 | 1,000.00 | -  |

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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

#### 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债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及的各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案等。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除

国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 79.82%(2019 年 12 月 31 日：本基金无债券投资 )。

#### 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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| A-1    | -                      |
| A-1 以下 | -                      |
| 未评级    | 239,466,000.00         |
| 合计     | 239,466,000.00         |

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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| A-1    | 49,935,000.00          |
| A-1 以下 | -                      |
| 未评级    | -                      |
| 合计     | 49,935,000.00          |

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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| A-1    | -                      |
| A-1 以下 | -                      |
| 未评级    | 393,175,000.00         |
| 合计     | 393,175,000.00         |

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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
|--------|------------------------|

|        |                  |
|--------|------------------|
| AAA    | 1,622,715,583.02 |
| AAA 以下 | 140,018,558.78   |
| 未评级    | 131,363,000.00   |
| 合计     | 1,894,097,141.80 |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末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，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和卖出回购金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 年 6 月<br>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                      | 24,497,488.66  | -             | -                | -                | -             | -              | 24,497,488.66    |
| 结算备付金                     | 44,820,762.00  | -             | -                | -                | -             | -              | 44,820,762.00    |
| 存出保证金                     | 478,992.55     | -             | -                | -                | -             | -              | 478,992.55       |
| 交易性金融资产                   | 60,072,000.00  | 80,414,000.00 | 1,024,784,570.00 | 1,339,902,565.40 | 71,500,006.40 | 333,747,743.13 | 2,910,420,884.93 |
| 买入返售金融资产                  | -              | -             | -                | -                | -             | -              | -                |
| 应收利息                      | -              | -             | -                | -                | -             | 24,559,190.33  | 24,559,190.33    |
| 应收股利                      | -              | -             | -                | -                | -             | 1,610,146.54   | 1,610,146.54     |
| 应收申购款                     | -              | -             | -                | -                | -             | -              | -                |
| 应收证券清算款                   | -              | -             | -                | -                | -             | 25,552.07      | 25,552.07        |
| 其他资产                      | -              | -             | -                | -                | -             | -              | -                |
| 资产总计                      | 129,869,243.21 | 80,414,000.00 | 1,024,784,570.00 | 1,339,902,565.40 | 71,500,006.40 | 359,942,632.07 | 3,006,413,011.08 |
| 负债                        |                |               |                  |                  |               |                |                  |
| 应付赎回款                     | -              | -             | -                | -                | -             | -              | -                |
| 应付管理人报酬                   | -              | -             | -                | -                | -             | 1,721,123.39   | 1,721,123.39     |
| 应付托管费                     | -              | -             | -                | -                | -             | 491,749.57     | 491,749.57       |
| 应付证券清算款                   | -              | -             | -                | -                | -             | 3,125,313.10   | 3,125,313.10     |
| 卖出回购金融资产款                 | -              | -             | -                | -                | -             | -              | -                |
| 应付销售服务费                   | -              | -             | -                | -                | -             | -              | -                |
| 应付交易费用                    | -              | -             | -                | -                | -             | 48,466.10      | 48,466.10        |
| 应付利息                      | -              | -             | -                | -                | -             | -              | -                |
| 应付利润                      | -              | -             | -                | -                | -             | -              | -                |

|         |                |               |                  |                  |               |                |                  |
|---------|----------------|---------------|------------------|------------------|---------------|----------------|------------------|
| 应交税费    | -              | -             | -                | -                | -             | 73,360.79      | 73,360.79        |
| 其他负债    | -              | -             | -                | -                | -             | 85,755.48      | 85,755.48        |
| 负债总计    | -              | -             | -                | -                | -             | 5,545,768.43   | 5,545,768.43     |
| 利率敏感度缺口 | 129,869,243.21 | 80,414,000.00 | 1,024,784,570.00 | 1,339,902,565.40 | 71,500,006.40 | 354,396,863.64 | 3,000,867,248.65 |

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   | 12,135,528.77               |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -12,013,364.74              |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |               |                |               |
|----------|------------------------|---------------|----------------|---------------|
|          | 美元<br>折合人民币元           | 港币<br>折合人民币元  | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计            |
| 以外币计价的资产 |                        |               |                |               |
| 交易性金融资产  | -                      | 81,221,843.44 | -              | 81,221,843.44 |
| 资产合计     | -                      | 81,221,843.44 | -              | 81,221,843.44 |
| 以外币计价的负债 |                        |               |                |               |

|                       |   |               |   |               |
|-----------------------|---|---------------|---|---------------|
| 负债合计                  | - | -             | - | -             |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | - | 81,221,843.44 | - | 81,221,843.44 |

#### 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<br>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% | 4,061,092.17                    |  |
|    | 2、港币相对人民币贬值 5% | -4,061,092.17                   |  |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>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  | 333,747,743.13    | 11.12        |
| 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            | 333,747,743.13    | 11.12        |



#### 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%       | 19,117,799.78               |
|    | 2. 沪深 300 指数下降 5%       | -19,117,799.78              |

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<br>（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                    | 7,505,521.15         | —                      |
|    | 1 周                    | 16,321,703.87        | —                      |
|    | 合计                     | —                    | —                      |

#### 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 391,118,820.24 元，属于第二层次的余额为 2,519,302,064.69 元，无属于第三层次的余额。

(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

无。

(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              | 333,747,743.13   | 11.10         |
|    | 其中：股票             | 333,747,743.13   | 11.10         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 2,576,673,141.80 | 85.71         |
|    | 其中：债券             | 2,526,738,141.80 | 84.04         |
|    | 资产支持证券            | 49,935,000.00    | 1.66          |
| 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 | -                | -             |

|   | 产            |                  |        |
|---|--------------|------------------|--------|
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 69,318,250.66    | 2.31   |
| 8 | 其他各项资产       | 26,673,881.49    | 0.89   |
| 9 | 合计           | 3,006,413,017.08 | 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 81,221,843.44 元人民币，占期末基金资产净值比例 2.71%

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              | 156,536,206.98 | 5.22         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32      | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 19,817,539.00  | 0.66         |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,394,677.00   | 0.11         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 9,598,435.77   | 0.32         |
| J  | 金融业              | 36,338,308.12  | 1.21         |
| K  | 房地产业             | 16,144,064.00  | 0.54         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 6,033,424.00   | 0.20         |
| 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        | 4,650,478.50   | 0.15         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 252,525,899.69 | 8.42         |

### 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 | 28,168,764.30 | 0.94         |
| C 消费者常用品  | -             | -            |
| D 能源      | 18,704,273.39 | 0.62         |

|        |               |      |
|--------|---------------|------|
| E 金融   | -             | -    |
| F 医疗保健 | -             | -    |
| G 工业   | 9,751,099.88  | 0.32 |
| H 信息技术 | -             | -    |
| I 电信服务 | 24,597,705.87 | 0.82 |
| J 公用事业 | -             | -    |
| K 房地产  | -             | -    |
| 合计     | 81,221,843.44 | 2.71 |

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  | 600887 | 伊利股份     | 722,461   | 22,490,210.93 | 0.75         |
| 2  | 000333 | 美的集团     | 339,100   | 20,274,789.00 | 0.68         |
| 3  | 01088  | 中国神华     | 1,689,500 | 18,704,273.39 | 0.62         |
| 4  | 00700  | 腾讯控股     | 38,000    | 17,306,764.99 | 0.58         |
| 5  | 601166 | 兴业银行     | 1,057,834 | 16,692,620.52 | 0.56         |
| 6  | 000002 | 万科A      | 617,600   | 16,144,064.00 | 0.54         |
| 7  | 600741 | 华域汽车     | 724,722   | 15,066,970.38 | 0.50         |
| 8  | 601186 | 中国铁建     | 1,599,100 | 13,400,458.00 | 0.45         |
| 9  | 601688 | 华泰证券     | 645,827   | 12,141,547.60 | 0.40         |
| 10 | 002415 | 海康威视     | 393,300   | 11,936,655.00 | 0.40         |
| 11 | 002078 | 太阳纸业     | 1,132,084 | 10,777,439.68 | 0.36         |
| 12 | 002271 | 东方雨虹     | 262,649   | 10,671,428.87 | 0.36         |
| 13 | 02020  | 安踏体育     | 166,168   | 10,382,059.66 | 0.35         |
| 14 | 00175  | 吉利汽车     | 905,000   | 10,085,291.04 | 0.34         |
| 15 | 600031 | 三一重工     | 529,900   | 9,940,924.00  | 0.33         |
| 16 | 002311 | 海大集团     | 168,835   | 8,034,857.65  | 0.27         |
| 17 | 600585 | 海螺水泥     | 146,800   | 7,767,188.00  | 0.26         |
| 18 | 601012 | 隆基股份     | 185,577   | 7,558,551.21  | 0.25         |
| 19 | 601318 | 中国平安     | 105,100   | 7,504,140.00  | 0.25         |
| 20 | 00772  | 阅文集团     | 152,909   | 7,290,940.88  | 0.24         |
| 21 | 600176 | 中国巨石     | 744,224   | 6,809,649.60  | 0.23         |
| 22 | 601668 | 中国建筑     | 1,345,300 | 6,417,081.00  | 0.21         |
| 23 | 600782 | 新钢股份     | 1,500,000 | 6,120,000.00  | 0.20         |
| 24 | 002027 | 分众传媒     | 1,083,200 | 6,033,424.00  | 0.20         |
| 25 | 02238  | 广汽集团     | 1,134,000 | 5,790,350.97  | 0.19         |
| 26 | 002925 | 盈趣科技     | 99,900    | 5,788,206.00  | 0.19         |
| 27 | 01055  | 中国南方航空股份 | 1,698,000 | 5,320,002.44  | 0.18         |

|    |        |      |           |              |      |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 28 | 002065 | 东华软件 | 389,200   | 4,872,784.00 | 0.16 |
| 29 | 002739 | 万达电影 | 304,550   | 4,650,478.50 | 0.15 |
| 30 | 002555 | 三七互娱 | 96,900    | 4,534,920.00 | 0.15 |
| 31 | 00753  | 中国国航 | 1,050,000 | 4,431,097.44 | 0.15 |
| 32 | 000858 | 五粮液  | 23,600    | 4,038,432.00 | 0.13 |
| 33 | 603056 | 德邦股份 | 250,900   | 3,394,677.00 | 0.11 |
| 34 | 002597 | 金禾实业 | 143,400   | 3,293,898.00 | 0.11 |
| 35 | 600486 | 扬农化工 | 34,800    | 2,871,000.00 | 0.10 |
| 36 | 600019 | 宝钢股份 | 549,800   | 2,507,088.00 | 0.08 |
| 37 | 02313  | 申洲国际 | 22,400    | 1,911,062.63 | 0.06 |
| 38 | 688568 | 中科星图 | 11,020    | 178,634.20   | 0.01 |
| 39 | 688377 | 迪威尔  | 7,894     | 129,619.48   | 0.00 |
| 40 | 688277 | 天智航  | 8,810     | 106,072.40   | 0.00 |
| 41 | 688027 | 国盾量子 | 2,830     | 102,389.40   | 0.00 |
| 42 | 688528 | 秦川物联 | 8,337     | 94,458.21    | 0.00 |
| 43 | 688600 | 皖仪科技 | 5,468     | 84,754.00    | 0.00 |
| 44 | 300824 | 北鼎股份 | 1,954     | 26,789.34    | 0.00 |
| 45 | 300842 | 帝科股份 | 455       | 18,527.60    | 0.00 |
| 46 | 600956 | 新天绿能 | 2,533     | 12,766.32    | 0.00 |
| 47 | 300839 | 博汇股份 | 502       | 11,751.82    | 0.00 |
| 48 | 300845 | 捷安高科 | 470       | 8,286.10     | 0.00 |
| 49 | 300843 | 胜蓝股份 | 751       | 7,517.51     | 0.00 |
| 50 | 300840 | 酷特智能 | 1,185     | 7,038.90     | 0.00 |
| 51 | 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  | 600887 | 伊利股份 | 20,790,559.00 | 0.69           |
| 2  | 01088  | 中国神华 | 20,317,839.57 | 0.68           |
| 3  | 600741 | 华域汽车 | 17,855,032.03 | 0.59           |
| 4  | 000002 | 万科 A | 17,842,700.80 | 0.59           |
| 5  | 000333 | 美的集团 | 17,840,261.00 | 0.59           |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 17,822,847.42 | 0.59           |
| 7  | 601186 | 中国铁建 | 14,865,022.00 | 0.50           |
| 8  | 002271 | 东方雨虹 | 14,836,609.26 | 0.49           |
| 9  | 00700  | 腾讯控股 | 13,049,044.61 | 0.43           |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 11,893,835.12 | 0.40           |
| 11 | 601688 | 华泰证券 | 11,880,632.51 | 0.40           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 00175  | 吉利汽车 | 10,490,757.47 | 0.35 |
| 13 | 002078 | 太阳纸业 | 10,356,425.53 | 0.35 |
| 14 | 02020  | 安踏体育 | 10,085,019.25 | 0.34 |
| 15 | 600031 | 三一重工 | 8,936,562.03  | 0.30 |
| 16 | 600585 | 海螺水泥 | 8,936,132.00  | 0.30 |
| 17 | 02238  | 广汽集团 | 8,645,742.36  | 0.29 |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 7,464,298.00  | 0.25 |
| 19 | 601668 | 中国建筑 | 7,432,620.00  | 0.25 |
| 20 | 002311 | 海大集团 | 7,121,769.00  | 0.24 |

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  | 002271 | 东方雨虹 | 8,057,024.08 | 0.27           |
| 2  | 601966 | 玲珑轮胎 | 5,216,717.66 | 0.17           |
| 3  | 300166 | 东方国信 | 4,288,983.00 | 0.14           |
| 4  | 600486 | 扬农化工 | 4,181,699.00 | 0.14           |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 4,172,717.18 | 0.14           |
| 6  | 002555 | 三七互娱 | 2,994,366.00 | 0.10           |
| 7  | 02020  | 安踏体育 | 1,854,765.27 | 0.06           |
| 8  | 00772  | 阅文集团 | 1,854,098.86 | 0.06           |
| 9  | 688599 | 天合光能 | 1,714,507.41 | 0.06           |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 1,502,818.68 | 0.05           |
| 11 | 002311 | 海大集团 | 1,500,347.55 | 0.05           |
| 12 | 688520 | 神州细胞 | 1,053,284.96 | 0.04           |
| 13 | 688106 | 金宏气体 | 1,045,868.25 | 0.03           |
| 14 | 688318 | 财富趋势 | 906,832.08   | 0.03           |
| 15 | 688312 | 燕麦科技 | 502,520.00   | 0.02           |
| 16 | 688566 | 吉贝尔  | 457,730.98   | 0.02           |
| 17 | 688518 | 联赢激光 | 393,883.38   | 0.01           |
| 18 | 688222 | 成都先导 | 368,040.00   | 0.01           |
| 19 | 688157 | 松井股份 | 280,835.10   | 0.01           |
| 20 | 688004 | 博汇科技 | 258,835.52   | 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 | 358,731,158.56 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 45,069,731.91  |

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      | 787,610,264.00   | 26.25        |
|    | 其中：政策性金融债 | 131,363,000.00   | 4.38         |
| 4  | 企业债券      | 659,682,470.00   | 21.98        |
| 5  | 企业短期融资券   | 179,616,000.00   | 5.99         |
| 6  | 中期票据      | 19,928,000.00    | 0.66         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 486,726,407.80   | 16.22        |
| 8  | 同业存单      | 393,175,000.00   | 13.10        |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 2,526,738,141.80 | 84.20        |

## 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  | 136722    | 16 石化 02       | 1,500,000 | 150,510,000.00 | 5.02         |
| 2  | 132015    | 18 中油 EB       | 1,400,000 | 140,000,000.00 | 4.67         |
| 3  | 132009    | 17 中油 EB       | 1,222,550 | 122,633,990.50 | 4.09         |
| 4  | 190203    | 19 国开 03       | 1,000,000 | 101,390,000.00 | 3.38         |
| 5  | 012001769 | 20 光大集团 SCP014 | 1,000,000 | 99,600,000.00  | 3.32         |

## 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  | 2089082 | 20 上和 1A1 | 500,000 | 49,935,000.00 | 1.66         |

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行股指期货投资。

## 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，以获取相应股票组合的超额收益。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 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

本基金持有的华泰证券（代码：601688.SH）发行主体华泰证券股份有限公司因未履行客户身份识别义务、未按规定报送可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易的行为，于 2020 年 2 月 10 日被中国人民银行处以罚款 1010 万元。

本基金持有的 16 中油 01（代码：136164.SH）发行主体中国石油天然气股份有限公司因下属广东广州销售分公司地埋式贮油罐未采取地下油罐防渗措施，且未根据穗环领导小组办[2019]47 号文的要求在 2019 年 6 月前完成地下油罐改造工作，于 2019 年 9 月 24 日被广州市生态环境局处以罚款 8 万元。

本基金持有的 20 中信银行 CD091（代码：112008091.IB）发行主体中信银行股份有限公司因违规发放土地储备贷款，受托支付不符合监管规定，信托消费贷款业务开展不审慎，流动资金贷款被挪用于股权投资等 18 项行为，于 2020 年 2 月 20 日被北京银保监局责令改正，并处以罚款合计 2020 万元；因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、信贷资产转让业务漏报、贸易融资业务漏报等 6 项违法违规行为，于 2020 年 4 月 20 日被银保监会处以罚款 160 万元；因在未经客户本人授权的情况下，向第三方提供个人银行账户交易明细，于 2020 年 5 月 9 日被中国银保监会消费者权益保护局采取立案调查的措施。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对



上述证券继续保持跟踪研究。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 478,992.55    |
| 2  | 应收证券清算款 | 25,552.07     |
| 3  | 应收股利    | 1,610,146.54  |
| 4  | 应收利息    | 24,559,190.33 |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 26,673,881.49 |

### 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<br>(%) |
|----|--------|----------|----------------|------------------|
| 1  | 132015 | 18 中油 EB | 140,000,000.00 | 4.67             |
| 2  | 132009 | 17 中油 EB | 122,633,990.50 | 4.09             |
| 3  | 132006 | 16 皖新 EB | 64,860,000.00  | 2.16             |
| 4  | 132007 | 16 凤凰 EB | 50,241,120.00  | 1.67             |
| 5  | 132012 | 17 巨化 EB | 20,300,000.00  | 0.68             |
| 6  | 110047 | 山鹰转债     | 4,312,400.00   | 0.14             |
| 7  | 110056 | 亨通转债     | 3,569,700.00   | 0.12             |
| 8  | 110031 | 航信转债     | 3,236,100.00   | 0.11             |
| 9  | 110052 | 贵广转债     | 2,161,800.00   | 0.07             |
| 10 | 113549 | 白电转债     | 2,138,566.00   | 0.07             |
| 11 | 128049 | 华源转债     | 2,046,892.80   | 0.07             |
| 12 | 110063 | 鹰 19 转债  | 1,598,550.00   | 0.05             |
| 13 | 127007 | 湖广转债     | 1,240,759.58   | 0.04             |
| 14 | 128084 | 木森转债     | 1,224.30       | 0.00             |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中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<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构         |            |                  |            |
|--------------|---------------|---------------|------------|------------------|------------|
|              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者            |            |
|              |               | 持有份额          | 占总份额比例 (%) | 持有份额             | 占总份额比例 (%) |
| 29,694       | 100,304.06    | 55,761,980.85 | 1.87       | 2,922,666,717.73 | 98.13      |

### 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 | 554,330.59 | 0.0186       |

### 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 2 月 25 日) 基金份额总额    | 2,978,428,698.58 |
| 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                        | 2,978,428,698.58 |

注：本基金合同生效日为 2020 年 2 月 25 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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东方证券 | 4      | 269,245,838.57 | 67.45%       | 199,299.84 | 68.32%     | -  |
| 中泰证券 | 1      | 129,925,360.02 | 32.55%       | 92,416.13  | 31.68%     | -  |
| 西部证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

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

2、交易单元的选择标准和程序：（1）选择标准：券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。（2）选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本基金合同生效日为 2020 年 2 月 25 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             | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | 1,589,072,395.21 | 98.52%       | 41,609,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 中泰证券 | 23,830,088.39    | 1.48%        | -                 | -              | -    | -            |
| 西部证券 | -                | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -                | -            | -                 | -              | -    | -            |

### 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  | 东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书                                      | 规定媒介   | 2020 年 02 月 12 日 |
| 2  | 东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金托管协议                                       | 规定媒介   | 2020 年 02 月 12 日 |
| 3  | 东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同                                       | 规定媒介   | 2020 年 02 月 12 日 |
| 4  | 东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告                                   | 规定媒介   | 2020 年 02 月 12 日 |
| 5  | 东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告                            | 规定媒介   | 2020 年 02 月 12 日 |
| 6  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金增部分渠道为代理销售机构的公告          | 规定媒介   | 2020 年 02 月 18 日 |
| 7  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金增加中国光大银行股份有限公司为代理销售机构的公告 | 规定媒介   | 2020 年 02 月 19 日 |
| 8  | 关于东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金提前结束募集的公告                                | 规定媒介   | 2020 年 02 月 20 日 |
| 9  | 关于东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金认购申请确认比例的                                | 规定媒介   | 2020 年 02 月 21 日 |

|    |   |      |                  |
|----|---|------|------------------|
|    | 公告  |      |                  |
| 10 | 东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告                         | 规定媒介 | 2020 年 02 月 26 日 |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 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 |
| 14 | 上海东方证券资产管理有限公司关于增聘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的公告        | 规定媒介 | 2020 年 06 月 03 日 |
| 15 | 东方红匠心甄选一年持有期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 |
| 16 | 东方红匠心甄选一年持有期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证券时报、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、托管协议、招募说明书、定期报告、上市交易公告书仅在指定网站披露，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匠心甄选一年持有混合基金的文件；
- 2、《东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金金托管协议》；
- 4、报告期内在指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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2020 年 8 月 31 日