

东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF） 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2021 年 03 月 09 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	52

8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 本报告期投资基金情况	58
8.13 投资组合报告附注	69
§ 9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	70
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	71
§ 10 开放式基金份额变动	71
§ 11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	71
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	72
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.9 其他重大事件	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	77
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	东方红欣和平衡两年混合（FOF）
基金主代码	011587
基金运作方式	契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置两年锁定持有期，由红利再投资而来的基金份额不受锁定持有期的限制。
基金合同生效日	2021 年 3 月 9 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	4,006,288,828.66 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以平衡的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金是一只平衡风险策略基金。在设定的投资范围及风险目标下，通过定量和定性的结合分析实现基金的资产配置。同时，根据宏观经济、资本市场的动量因素和事件驱动做出资产动态调整决策。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%+中国债券总指数收益率×55%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金中基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金及债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 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。除了需要承担与内地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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张锋
	联系电话	021-33315895
	电子邮箱	service@dfham.com
客户服务电话	4009200808	95555
传真	021-63326381	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 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	宋雪枫	缪建民
-------	-----	-----

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	60,521,118.21
本期利润	31,015,558.49
加权平均基金份额本期利润	0.0077
本期加权平均净值利润率	0.77%
本期基金份额净值增长率	0.77%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	31,015,558.49
期末可供分配基金份额利润	0.0077
期末基金资产净值	4,037,304,387.15
期末基金份额净值	1.0077
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	0.77%

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

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

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

4、本基金合同于 2021 年 3 月 9 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

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
过去三个月	1.09%	0.26%	0.34%	0.33%	0.75%	-0.07%
过去六个月	0.51%	0.24%	-2.86%	0.45%	3.37%	-0.21%
自基金合同生效起至今	0.77%	0.19%	-1.33%	0.45%	2.10%	-0.26%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%+中国债券总指数收益率×55%

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：

$$\text{benchmark}_t = 35\% \times [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 10\% \times [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1 日恒生指数}) - 1] + 55\% \times [\text{t 日中国债券总指数} / (\text{t-1 日中国债券总指数}) - 1];$$

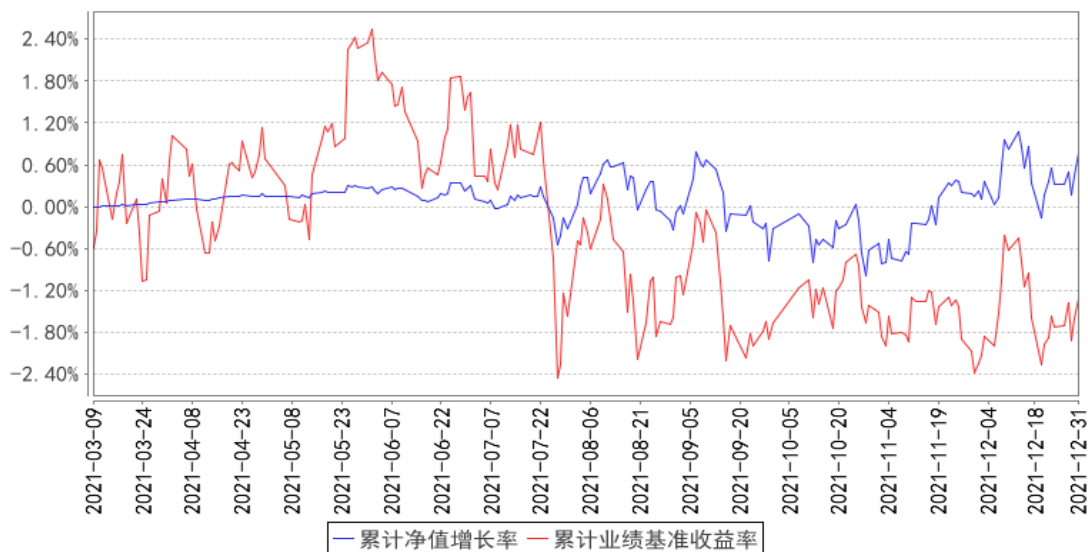
期间 T 日收益率（benchmark_T）按下列公式计算：

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

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

东方红欣和平衡两年混合（FOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

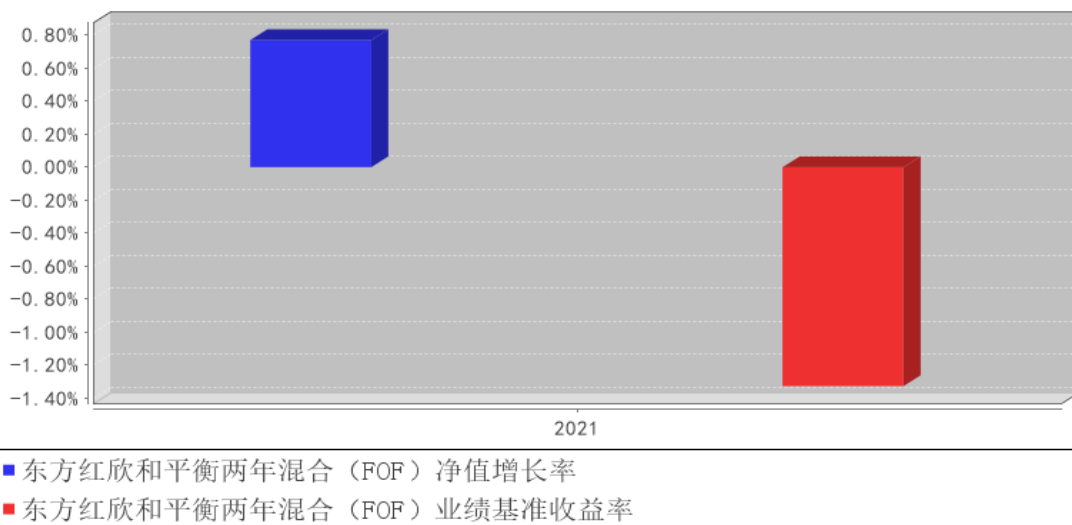


注：1、本基金合同于 2021 年 3 月 9 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2021 年 3 月 9 日起至 2021 年 9 月 8 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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

东方红欣和平衡两年混合（FOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日期为 2021 年 3 月 9 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自基金合同生效以来未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资

基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金、东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红新源三年持有期混合型证券投资基金、东方红新海混合型证券投资基金、东方红智华三年持有期混合型证券投资基金、东方红智选三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿和三年定期开放混合型证券投资基金、东方红启兴三年持有期混合型证券投资基金、东方红中证东方红红利低波动指数证券投资基金共计 78 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈文扬	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2021 年 3 月 9 日	-	12 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2020 年 06 月至今任 东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、2020 年 06 月至今任东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、2020 年 06 月至今任东方红颐和稳健养老目标两年持

					有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、2021 年 03 月至今任东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。上海财经大学金融学硕士。曾任上海国利货币经纪有限公司利率衍生产品部经纪人，宁波银行股份有限公司金融市场部交易员，南京银行股份有限公司金融市场部高级投资经理，上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究员、投资主办人。具备证券投资基金从业资格。
邓 炯 鹏	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金组合投资部总经理、基金经理	2021 年 3 月 9 日	-	18 年	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金组合投资部总经理、基金经理，2021 年 03 月至今任东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。广东商学院金融学学士。曾任招商银行广州分行零售银行部产品经理、招商银行财富管理部产品经理、投资类产品研发团队主管。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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。公司旗下投资组合的交易执

行过程和投资决策过程相互分离，公司的交易实行集中交易制度，各投资组合的所有证券交易活动均须通过交易部集中统一完成。公司建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析，校验公平交易执行情况。对于同向交易，风险管理部侧重于对公司管理的不同产品（包含了公募产品、私募产品）的整体收益率差异、投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差按两两组合进行显著性检验，并根据显著性检验结果，对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录，通过逐笔检查或抽样分析的方法，分析相应交易行为的公平性。对于反向交易，原则上禁止组合间的日内反向交易，完全按照有关指数构成比例进行投资的投资组合除外。如有投资策略或流动性等特殊需要的，需由投资经理提供投资依据，经投资决策委员会审慎审批后留档备查。本年度未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金自 2021 年 3 月 10 日运作至今（2022 年 3 月 7 日）约一年时间，权益市场经历了 2021 年风格差异较大的结构性行情及 2022 年以来的调整行情。在此期间，沪深 300 指数下跌 12.44%、恒生指数下跌 26.82%、中证 500 指数上涨 9.03%，偏股混合基金指数亦下跌 1.35%。如果从 2021 年 2 月 10 日偏股混合基金指数的历史高点算起，截至 2022 年 3 月 7 日下跌 17.35%（如果从 21 年 12 月 13 日至 22 年 3 月 7 日，则下跌 16.03%）。

在本基金 21 年的半年报中曾指出“从更大的宏观面看，上半年全球大宗商品上行带来的物价压力压制需求、后疫情时代美联储进入货币政策收紧的预期管理阶段，均给在相对高位的风险资产带来较大不确定性，造成市场震荡。基于对上述的产品定位和对市场投资性价比的判断，从 3

月 10 日运作以来的建仓期中，采取了偏防守的建仓策略”。

另外，在本基金发行期里基金经理致投资者的一封信中，曾阐述了产品的定位和基金经理的初心：“东方红欣和平衡两年混合的目标持有人以我身边一批领导和好友为蓝本：他（她）们知道炒股不如买基金，也有长期的闲钱可以投资，有一定风险承受能力，知道需要配置权益基金才能提高资产整体收益率，希望能通过长期投资获得稳健收益；但是，他们同样存在投资困惑，不知道买什么资产、什么基金经理比较靠谱、什么时候该多买一些或少买一些权益资产”。本基金创设为两年持有期产品、投资于权益类资产的比例占基金资产的 30%-80%，目标是以平衡的投资风格进行资产配置，追求资产净值的稳健增值，力争通过拉长投资期限、行稳致远的风格为客户带来实实在在的回报。

根据基金经理对资本市场的理解和产品定位的坚持，本基金在 2021 年缓步逢低建仓，大类配置上较为均衡，净值波动较小，整体处于“进可攻、退可守”的状态。在 2021 年较长的时间内，本基金承受了相对排名落后的压力——基金经理跟踪行业平均仓位和热点做相对收益是容易的，对个人职业生涯也是相对安全的。但考虑到当时市场的整体估值和交易拥挤度，如何通过避免净值“挖坑”、并把握有胜率的机会，给客户争取创造长期价值，是值得我们去坚持的。2022 年以来市场的走势，证明了我们的慎重对客户是有一定价值的，也再次感谢持有人对我们的信任和理解。

过去的一年，我们在大类资产配置的研究之外，还跟踪调研了一批基金经理，并以“弱者思维”进行了一定程度的分散配置，表现各有差异。在这里，我们感谢基金经理对我们的支持。同时在未来的日子，我们会根据大类配置的观点和产品的适配性，进行一定的调仓，争取更好地为客户创造收益。

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 1.0077 元，份额累计净值为 1.0077 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.77%，业绩比较基准收益率为-1.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先，我们认识到，当今世界正处于较大的变局之中。疫情加剧了全球发展不平衡的态势，地缘政治摩擦风险加大。俄乌事件有可能进一步改变世界局势，制裁与反制裁措施对全球供应链及通胀的长期影响乃至尾部风险仍需重视。同时，美联储即将进入加息周期，推动风险资产波动将进一步加大。

其次，2022 年我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力。经济工作将稳字当头、稳中求进，5.5%的经济增长目标具有积极性，我们保持着乐观的态度。新冠疫情防控手段

进步和政策变化将是今年的一个较大变量，关注其变化。

最后，从市场层面，我们对 2022 年的投资线索有如下思考：（1）即使短期内财富效应分化影响居民通过公、私募基金进入资本市场，但在房住不炒、打破刚兑、无风险利率下行的背景下，居民财富配置向权益资产转移是个大趋势。价格下跌是风险的释放，投资估值合理的优质权益资产在长时间维度内仍然是正确的事情；（2）已经调整充分或长期低估值的优质白马股值得关注；（3）景气赛道中利润在上下游转移的机会；（4）相对估值较低的港股板块；（5）受益于人口老龄化（含鼓励生育）、国家安全、自主可控、科技创新、经济稳增长等趋势的企业。本产品将加大在上述方向的研究深度并甄选优秀的选股型基金进行配置。

如 21 年四季报所述，我们认为 2022 年的市场机会将更加均衡，但同时市场波动加大，市场提供的各种机会值得期待和努力挖掘，我们对此并不悲观。在前一阶段做好防守的同时，当下我们会聚焦未来投资机会的把握和标的研究。当合适的资产出现合适的价格时，本基金将进一步加大权益资产配置力度，承担净值的波动并争取为客户带来长期良好收益。

FOF 投资上双重分工的特点，可以让基金经理更好的基于自上而下的思考来进行资产配置，让底层基金经理挖掘个股阿尔法，我们将致力于通过发挥 FOF 的优势努力为客户创造良好的财富管理体验。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P00726 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>上海东方证券资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2021 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金(FOF)不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重</p>

	大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	史曼	何淑婷
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	22,694,340.48
结算备付金		6,380,824.13
存出保证金		99,638.25
交易性金融资产	7.4.7.2	3,956,130,563.74
其中：股票投资		417,922,821.79
基金投资		3,334,411,741.95
债券投资		203,796,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	50,000,000.00
应收证券清算款		371,184.11
应收利息	7.4.7.5	4,581,552.90
应收股利		44,906.58
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	54,943.43
资产总计		4,040,357,953.62
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		19.76
应付赎回款		-

应付管理人报酬		2,300,447.32
应付托管费		545,710.45
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	37,388.94
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	170,000.00
负债合计		3,053,566.47
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	4,006,288,828.66
未分配利润	7.4.7.10	31,015,558.49
所有者权益合计		4,037,304,387.15
负债和所有者权益总计		4,040,357,953.62

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.0077 元，基金份额总额 4,006,288,828.66 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间，无上年度末可比数据。

7.2 利润表

会计主体：东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		61,907,222.17
1. 利息收入		29,032,290.45
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,143,087.87
债券利息收入		6,716,884.43
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		16,172,318.15
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		62,197,639.87
其中：股票投资收益	7.4.7.12	25,056,410.43
基金投资收益	7.4.7.13	278,206.28
债券投资收益	7.4.7.14	263,314.68
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-

衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	36,599,708.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-29,505,559.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	182,851.57
减：二、费用		30,891,663.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	23,807,287.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,756,212.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.20	1,083,001.89
5. 利息支出		6,328.26
其中：卖出回购金融资产支出		6,328.26
6. 税金及附加		11,744.70
7. 其他费用	7.4.7.21	227,088.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,015,558.49
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,015,558.49

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,006,288,828.66	-	4,006,288,828.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,015,558.49	31,015,558.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	4,006,288,828.66	31,015,558.49	4,037,304,387.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张锋

汤琳

陈培

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金(FOF) (以下简称“本基金”)系由基金管理人上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金(FOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2021]328 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 4,006,288,828.66 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第 00117 号验资报告。基金合同于 2021 年 3 月 9 日正式生效。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金(FOF)招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金(含 QDII 基金、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)和香港互认基金,下同),国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分、可交换债、证券公司短期公司债券)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的比例

不低于基金资产的 80%，其中，投资于股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产的比例合计占基金资产的 30%-80%。计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度股票资产占基金资产的比例均不低于 60%的混合型基金。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)×10%+中国债券总指数收益率×55%。

本基金的财务报表于 2022 年 3 月 29 日已经本基金的基金管理人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种

（可转换债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

（2）对于基金投资，按如下方法估值：

（a）对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

（b）对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

（c）对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；

（d）对于境内非上市货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

（e）如遇所投资的证券投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，按以下原则进行估值：（i）以所投资基金的份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的份额净值为基础估值；（ii）以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；（iii）若所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人将根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

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

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

（5）当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同

的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

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

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

- 投资收益

基金投资收益为卖出基金交易日的成交总额扣除应结转的基金投资成本的差额确认。

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

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

的差额确认。

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

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

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

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

- 公允价值变动收益

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红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；选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

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。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

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

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

1) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区

现行税法规定缴纳印花税。

5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2021 年 12 月 31 日
活期存款	22,694,340.48
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	22,694,340.48

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	475,388,122.29	417,922,821.79	-57,465,300.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	203,741,775.20	203,796,000.00	54,224.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	203,741,775.20	203,796,000.00	54,224.80
资产支持证券	-	-	-	
基金	3,306,506,225.97	3,334,411,741.95	27,905,515.98	
其他	-	-	-	
合计	3,985,636,123.46	3,956,130,563.74	-29,505,559.72	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-

银行间市场	-	-
合计	50,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,918.91
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	3,158.54
应收债券利息	4,593,780.96
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-20,354.79
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	49.28
合计	4,581,552.90

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
其他应收款	54,943.43
待摊费用	-
合计	54,943.43

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	37,388.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	37,388.94

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

预提费用	170,000.00
合计	170,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	4,006,288,828.66	4,006,288,828.66
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	4,006,288,828.66	4,006,288,828.66

注：本基金合同生效日为 2021 年 3 月 9 日。本基金在募集期间有效净认购资金共计 4,004,734,228.25 元，折合基金份额 4,004,734,228.25 份，产生的利息收入 1,554,600.41 元，折合基金份额 1,554,600.41 份，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	60,521,118.21	-29,505,559.72	31,015,558.49
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	60,521,118.21	-29,505,559.72	31,015,558.49

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	5,054,888.88
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	448,146.11
其他	1,440.13
合计	6,143,087.87

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,056,410.43
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	25,056,410.43

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	119,505,939.62
减：卖出股票成本总额	94,449,529.19
买卖股票差价收入	25,056,410.43

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	425,095,451.21
减：卖出/赎回基金成本总额	424,817,244.93
基金投资收益	278,206.28

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31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	263,314.68
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	263,314.68

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	487,278,259.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	482,686,822.33
减：应收利息总额	4,328,122.82
买卖债券差价收入	263,314.68

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,191,909.37
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	30,407,799.11
合计	36,599,708.48

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-29,505,559.72
股票投资	-57,465,300.50
债券投资	54,224.80
资产支持证券投资	-
基金投资	27,905,515.98
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	-29,505,559.72

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	182,851.57
合计	182,851.57

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	865,367.94
银行间市场交易费用	2,100.00
交易基金产生的费用	215,533.95
其中：申购费	97,000.00
赎回费	47,535.00

交易费	11,685.67
转换费	59,313.28
合计	1,083,001.89

7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年 12月31日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	277,221.65
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	10,308,187.01
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	2,160,686.21

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年 12月31日
审计费用	70,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	41,588.16
账户维护费	15,500.00
合计	227,088.16

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
东方证券	668,669,653.26	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
东方证券	202,936,404.90	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东方证券	62,826,800,000.00	100.00

7.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
东方证券	290,667,652.49	100.00

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
东方证券	487,251.75	100.00	37,388.94	100.00

注：1、上述佣金按照市场佣金率计算，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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,807,287.99
其中：支付销售机构的客户维护费	14,125,137.18

注：本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人管理的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额（若为负数，则取0）的1.0%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金部分（若为负数，则取0）

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5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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,756,212.68

注：本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人托管的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.2%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中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分（若为负数，则取0）

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 5 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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 3 月 9 日）持有的基金份额	10,003,950.00
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,003,950.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.2497%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	22,694,340.48	638,612.75

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有基金管理人东证资管所管理的基金合计 1,319,715,599.39 元，占本基金资产净值的比例为 32.69%。

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

项目	本期费用 2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	169,349.10
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	3,595,721.92
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	901,013.03
当期持有基金产生的应支付交易费用（元）	2,793.04

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-

		日	7日							
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股锁定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年	2022	新股锁	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-

	王	9月30日	2021年4月14日	定						
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股锁定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股锁定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股锁定	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股锁定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股锁定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-

301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股锁定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688167	炬光科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	78.69	176.67	2,014	158,481.66	355,813.38	-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年1月7日	新股未上市	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688206	概伦电子	2021年12月20日	2022年6月28日	新股锁定	28.28	33.01	6,000	169,680.00	198,060.00	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688622	禾信仪器	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-
688786	悦安新材	2021年8月18日	2022年2月28日	新股锁定	11.76	54.01	1,513	17,792.88	81,717.13	-

7.4.12.1.2 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
113052	兴业转债	2021年12月29日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	37,560	3,756,000.00	3,756,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管人招商银行，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。

7.4.13.2.1 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 2021 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	200,040,000.00
合计	200,040,000.00

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	3,756,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	3,756,000.00

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不得持有其他基金中基金；本基金管理人管理的全部基金中基金（ETF 联接基金除外）持有单只基金不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算，且不含本基金所投资的基金份额），其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算，且不含本基金所投资的基金份额），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参

见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金时，不得超过基金资产净值的 10%，但不包括 ETF、LOF 等可上市交易的基金；本基金持有的货币市场基金占本基金资产的比例不得高于 15%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	22,694,340.48	-	-	-	-	-	22,694,340.48
结算备付金	6,380,824.13	-	-	-	-	-	6,380,824.13
存出保证金	99,638.25	-	-	-	-	-	99,638.25
交易性金融资产	200,040,000.00	-	-	-	3,756,000.00	3,752,334,563.74	3,956,130,563.74
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	-	-	50,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	4,581,552.90	4,581,552.90
应收股利	-	-	-	-	-	44,906.58	44,906.58
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-371,184.11	371,184.11
其他资产	-	-	-	-	-	54,943.43	54,943.43
资产总计	279,214,802.86	-	-	-	3,756,000.00	3,757,387,150.76	4,040,357,953.62
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,300,447.32	2,300,447.32
应付托管费	-	-	-	-	-	-545,710.45	545,710.45
应付证券清算款	-	-	-	-	-	19.76	19.76
应付交易费用	-	-	-	-	-	37,388.94	37,388.94
其他负债	-	-	-	-	-	-170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,053,566.47	3,053,566.47
利率敏感度缺口	279,214,802.86	-	-	-	3,756,000.00	3,754,333,584.29	4,037,304,387.15

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

7.4.13.4.1.2 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（2021 年 12 月 31 日）	

分析	1. 市场利率下降 25 个基点	83,219.80
	2. 市场利率上升 25 个基点	-82,317.95

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	89,489,470.00	-	89,489,470.00
资产合计	-	89,489,470.00	-	89,489,470.00
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	89,489,470.00	-	89,489,470.00

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1、港币相对人民币升值 5%	4,474,473.50
	2、港币相对人民币贬值 5%	-4,474,473.50

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	417,922,821.79	10.35
交易性金融资产—基金投资	3,334,411,741.95	82.59
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	3,752,334,563.74	92.94

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	71,035,754.76
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-71,035,754.76

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 3,748,029,142.25 元，属于第二层次的余额为人民币 205,049,239.55 元，属于第三层次的余额为人民币 3,052,181.94 元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具为人民币 3,052,181.94 元。本基金本期净转入第三层次的金额为人民币 2,556,696.45 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为人民币 495,485.49 元。

于 2021 年 12 月 31 日本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为交易所市场上市交易但尚在限售期内的股票投资)公允价值为人民币 3,052,181.94 元，采用平均价格亚式期权模型作为估值技术进行估值，不可观察输入值为该流通受限股票在剩余限售期内的股价的预期平均波动率，与公允价值之间呈负相关关系。

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

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

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	417,922,821.79	10.34
	其中：股票	417,922,821.79	10.34
2	基金投资	3,334,411,741.95	82.53
3	固定收益投资	203,796,000.00	5.04
	其中：债券	203,796,000.00	5.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	50,000,000.00	1.24
	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	29,075,164.61	0.72
8	其他各项资产	5,152,225.27	0.13
9	合计	4,040,357,953.62	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 89,489,470.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 2.22%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	174,572,888.60	4.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,154,713.80	0.50
F	批发和零售业	56,433,066.96	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,328,589.12	0.06
J	金融业	71,272,420.00	1.77
K	房地产业	3,359,200.00	0.08
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	287,458.48	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	11,992.19	0.00
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	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	328,433,351.79	8.13

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	1,491,470.00	0.04
25 可选消费	-	-
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 通信服务	87,998,000.00	2.18
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	89,489,470.00	2.22

注：以上分类采用中证行业分类标准。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00941	中国移动	2,300,000	87,998,000.00	2.18
2	002221	东华能源	4,461,000	56,163,990.00	1.39
3	601658	邮储银行	7,297,700	37,218,270.00	0.92
4	002841	视源股份	413,299	33,642,538.60	0.83
5	000538	云南白药	303,826	31,795,390.90	0.79
6	002595	豪迈科技	1,020,156	28,319,530.56	0.70
7	601318	中国平安	515,000	25,961,150.00	0.64
8	300482	万孚生物	586,450	23,094,401.00	0.57
9	601668	中国建筑	4,030,000	20,150,000.00	0.50
10	600019	宝钢股份	1,750,000	12,530,000.00	0.31
11	000581	威孚高科	565,500	12,180,870.00	0.30
12	688798	艾为电子	43,592	9,415,872.00	0.23
13	600276	恒瑞医药	171,000	8,671,410.00	0.21
14	000001	平安银行	450,000	7,416,000.00	0.18

15	688139	海尔生物	62,089	5,638,922.98	0.14
16	002078	太阳纸业	310,597	3,568,759.53	0.09
17	000002	万科A	170,000	3,359,200.00	0.08
18	688235	百济神州	19,217	2,777,048.67	0.07
19	601728	中国电信	394,073	1,682,695.43	0.04
20	01072	东方电气	139,000	1,491,470.00	0.04
21	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.02
22	002966	苏州银行	100,000	677,000.00	0.02
23	688167	炬光科技	2,014	355,813.38	0.01
24	688211	中科微至	4,501	337,575.00	0.01
25	688553	汇宇制药	8,928	300,248.64	0.01
26	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
27	301189	奥尼电子	4,345	259,307.90	0.01
28	688206	概伦电子	6,000	198,060.00	0.00
29	688265	南模生物	2,374	166,298.70	0.00
30	301166	优宁维	1,528	155,233.50	0.00
31	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.00
32	688737	中自科技	2,186	127,902.86	0.00
33	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.00
34	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
35	688786	悦安新材	1,513	81,717.13	0.00
36	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
37	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.00
38	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
39	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
40	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
41	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
42	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
43	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
44	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
45	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
46	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
47	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
48	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
49	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
50	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
51	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
52	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
53	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
54	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
55	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
56	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00

57	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
58	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
59	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
60	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
61	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
62	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
63	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
64	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
65	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
66	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
67	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
68	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
69	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
70	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
71	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
72	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
73	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
74	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
75	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
76	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
77	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
78	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
79	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
80	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
81	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
82	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	00941	中国移动	94,417,649.47	2.34
2	002221	东华能源	57,064,482.00	1.41
3	002841	视源股份	43,829,888.70	1.09
4	300482	万孚生物	41,436,981.02	1.03
5	601318	中国平安	38,128,557.00	0.94
6	601658	邮储银行	35,744,638.00	0.89
7	600900	长江电力	33,329,346.00	0.83
8	000538	云南白药	32,360,503.35	0.80
9	002595	豪迈科技	29,041,291.07	0.72

10	000776	广发证券	15,150,763.00	0.38
10	01776	广发证券	11,830,176.54	0.29
11	601668	中国建筑	19,990,000.00	0.50
12	600019	宝钢股份	14,493,313.00	0.36
13	000581	威孚高科	12,289,785.34	0.30
14	600276	恒瑞医药	10,854,154.20	0.27
15	688798	艾为电子	9,663,756.74	0.24
16	000001	平安银行	9,526,500.00	0.24
17	688389	普门科技	7,759,297.67	0.19
18	600060	海信视像	6,319,325.00	0.16
19	688139	海尔生物	6,313,535.72	0.16
20	01072	东方电气	5,073,456.76	0.13

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	35,670,110.98	0.88
2	000776	广发证券	15,342,000.00	0.38
2	01776	广发证券	13,490,673.11	0.33
3	688389	普门科技	7,874,622.44	0.20
4	600060	海信视像	7,737,492.00	0.19
5	01072	东方电气	6,279,550.97	0.16
6	688303	大全能源	3,506,016.75	0.09
7	688187	时代电气	1,999,303.62	0.05
8	000591	太阳能	1,316,000.00	0.03
9	600309	万华化学	1,277,900.00	0.03
10	301177	迪阿股份	1,176,144.00	0.03
11	688425	铁建重工	1,113,458.46	0.03
12	601728	中国电信	1,048,248.00	0.03
13	300866	安克创新	976,185.00	0.02
14	688779	长远锂科	896,465.96	0.02
15	688315	诺禾致源	857,902.39	0.02
16	600216	浙江医药	810,451.00	0.02
17	688728	格科微	734,783.70	0.02
18	688778	厦钨新能	602,256.50	0.01
19	301050	雷电微力	563,370.00	0.01
20	688385	复旦微电	491,793.01	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	569,837,651.48
卖出股票收入（成交）总额	119,505,939.62

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	200,040,000.00	4.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,756,000.00	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	203,796,000.00	5.05

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019649	21 国债 01	2,000,000	200,040,000.00	4.95
2	113052	兴业转债	37,560	3,756,000.00	0.09

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：根据本基金合同，本基金不参与股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金将根据基金产品特征，综合定量和定性两个维度优选拟投资基金标的。首先，对全市场基金进行筛选，构建基础基金池，再通过对基础基金池中基金管理人和基金经理的调研情况进行进一步筛选，构建精选基金池，最后结合市场情况和基金风格构建投资组合，努力获取基金经理优秀管理能力所产生的超额收益。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	005057	东方红货币B	契约型开放式	521,744,907.82	521,744,907.82	12.92	是
2	002650	东方红稳添利纯债债券A	契约型开放式	293,471,073.45	317,535,701.47	7.87	是
3	006567	中泰星元灵活配置混合A	契约型开放式	46,372,149.29	107,254,144.09	2.66	否

4	001324	华宝新价值混合	契约型开放式	57,750,478.13	93,197,721.61	2.31	否
5	001202	东方红领先精选混合	契约型开放式	52,420,497.46	82,614,704.00	2.05	是
6	001564	东方红京东大数据混合	契约型开放式	31,439,186.34	82,307,789.84	2.04	是
7	008837	融通通益混合	契约型开放式	65,566,820.25	80,522,611.95	1.99	否
8	003669	东方红益鑫纯债债券C	契约型开放式	68,658,577.96	70,251,456.97	1.74	是
9	007549	中泰开阳价值优选混合A	契约型开放式	28,581,669.06	65,680,675.50	1.63	否
10	161834	银华鑫锐灵活配置混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	33,075,570.03	64,761,966.12	1.60	否
11	005498	银华积极成长	契约型开放式	27,409,843.96	62,477,998.32	1.55	否

		混合					
12	012243	东方红内需增长混合 B	契约型开放式	15,131,179.82	61,944,023.95	1.53	是
13	007147	博时中债 1-3 年国开行债券指数 A	契约型开放式	58,578,388.57	59,855,397.44	1.48	否
14	501054	东方红睿泽三年定开混合 A	上市契约型开放式 (LOF)	42,413,258.00	58,699,949.07	1.45	是
15	169105	东方红睿华沪港深混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	28,222,466.99	56,185,287.28	1.39	是
16	002057	中银新机遇混合 A	契约型开放式	44,551,877.55	51,769,281.71	1.28	否
17	002434	中银宏利混合 A	契约型开放式	44,433,093.10	49,587,331.90	1.23	否
18	001605	国富沪港	契约型开	18,854,127.90	47,078,757.37	1.17	否

		深成长精选股票	放式				
19	159920	恒生ETF	交易型开放式(ETF)	35,870,400.00	43,474,924.80	1.08	否
20	005652	国富天颐混合A	契约型开放式	38,520,195.22	41,921,528.46	1.04	否
21	002282	平安安享灵活配置混合A	契约型开放式	29,752,305.86	41,203,968.39	1.02	否
22	011616	国投瑞银瑞祥灵活配置混合C	契约型开放式	23,882,022.81	40,876,470.24	1.01	否
23	002049	融通新机遇灵活配置混合	契约型开放式	27,434,156.38	40,739,722.22	1.01	否
24	001327	鹏华弘华混合A	契约型开放式	28,206,050.35	40,591,327.06	1.01	否
25	003327	万家鑫璟	契约型开	34,140,491.64	40,517,935.48	1.00	否

		纯债 债券 A	放式				
26	005974	东方 红配 置精 选混 合 A	契约 型开 放式	29,180,162.60	40,216,100.10	1.00	是
27	005802	添富 智能 制造 股票	契约 型开 放式	18,637,269.06	39,753,294.90	0.98	否
28	001503	南方 利鑫 混合 C	契约 型开 放式	25,518,343.90	38,430,625.91	0.95	否
29	200012	长城 中小 盘成 长混 合	契约 型开 放式	10,505,324.82	37,522,919.19	0.93	否
30	000339	长城 医疗 保健 混合	契约 型开 放式	8,757,695.03	37,448,779.72	0.93	否
31	512880	国泰 中证 全指 证券 公司 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	31,257,700.00	36,759,055.20	0.91	否
32	009560	上银 中债 1-3 年国 开行 债券	契约 型开 放式	34,986,165.91	36,672,499.11	0.91	否

		指数					
33	002776	招商安荣混合 A	契约型开放式	21,337,932.99	32,442,193.32	0.80	否
34	003234	信诚至利混合 A	契约型开放式	24,617,593.96	31,778,852.04	0.79	否
35	003432	信诚至瑞混合 A	契约型开放式	21,077,862.59	30,805,296.18	0.76	否
36	161722	招商丰泰灵活配置混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	21,306,107.95	30,616,877.12	0.76	否
37	005865	浦银安盛量化多策略混合 A	契约型开放式	20,414,426.68	30,372,584.01	0.75	否
38	166002	中欧新蓝筹混合 A	契约型开放式	13,589,548.45	30,285,667.68	0.75	否
39	003434	博时鑫泽混合 A	契约型开放式	13,428,379.59	30,227,282.46	0.75	否
40	007497	中庚价值灵动	契约型开放式	14,000,880.62	30,145,296.06	0.75	否

		灵活配置混合					
41	007097	添富中债1-3年国开债A	契约型开放式	29,124,582.43	29,514,851.83	0.73	否
42	007169	易方达中债1-3年国开行债券指数A	契约型开放式	26,882,109.82	27,347,170.32	0.68	否
43	310358	申万菱信新经济混合	契约型开放式	12,638,845.58	23,283,281.33	0.58	否
44	206009	鹏华新兴产业混合	契约型开放式	5,497,251.24	21,235,881.54	0.53	否
45	001447	天弘惠利混合	契约型开放式	11,473,895.58	20,764,308.83	0.51	否
46	001765	前海开源嘉鑫混合A	契约型开放式	15,551,321.93	20,543,296.27	0.51	否
47	002472	光大保德	契约型开	10,959,391.43	20,478,718.83	0.51	否

		信先 先进服 务业混 合 A	放式				
48	002161	银华 万物互 联灵活 配置混 合	契约 型开 放式	15,229,169.84	20,376,629.25	0.50	否
49	002485	国联 安通盈 混合 C	契约 型开 放式	17,235,436.06	20,272,319.89	0.50	否
50	005623	广发 中债 1-3 年农 发债 指数 A	契约 型开 放式	19,249,099.18	20,271,226.35	0.50	否
51	003396	东方 红优 享红 利混 合	契约 型开 放式	9,033,423.67	20,237,579.05	0.50	是
52	006973	太平 睿盈 混合 A	契约 型开 放式	17,483,171.61	20,049,701.20	0.50	否
53	002728	华富 益鑫 灵活 配置 混合 A	契约 型开 放式	15,278,074.87	19,494,823.53	0.48	否

54	004119	广发 创新 驱动 混合	契约 型开 放式	9,273,047.34	19,454,853.32	0.48	否
55	512290	国泰 中证 生物 医药 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	11,903,900.00	19,200,990.70	0.48	否
56	512170	华宝 中证 医疗 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	28,000,000.00	18,956,000.00	0.47	否
57	005062	博时 中证 500 指数 增强 A	契约 型开 放式	12,397,098.93	18,482,834.79	0.46	否
58	004496	前海 开源 多元 策略 混合 A	契约 型开 放式	7,441,478.11	17,863,268.20	0.44	否
59	005689	中银 医疗 保健 混合 A	契约 型开 放式	6,169,089.37	17,691,714.50	0.44	否
60	110023	易方 达医 疗保 健行 业混 合	契约 型开 放式	4,631,420.56	17,085,310.45	0.42	否

61	006113	添富 创新 医药 混合	契约 型开 放式	6,315,557.16	16,501,919.30	0.41	否
62	020019	国泰 双利 债券 A	契约 型开 放式	8,790,704.74	14,917,825.94	0.37	否
63	003751	万家 瑞隆 混合	契约 型开 放式	4,206,385.93	11,255,026.83	0.28	否
64	519915	富国 消费 主题 混合 A	契约 型开 放式	3,517,059.44	10,948,606.04	0.27	否
65	005457	景顺 长城 量化 小盘 股票	契约 型开 放式	5,735,344.72	10,531,239.97	0.26	否
66	159992	创新 药	交易 型开 放式 (ETF)	8,218,000.00	10,321,808.00	0.26	否
67	360005	光大 保德 信红 利混 合	契约 型开 放式	3,911,206.73	10,241,885.94	0.25	否
68	002659	兴业 中债 1-3 年政 策性 金融 债 A	契约 型开 放式	9,030,888.73	9,970,101.16	0.25	否

69	008467	博道嘉瑞混合 A	契约型开放式	4,972,895.01	9,935,844.23	0.25	否
70	001222	鹏华外延成长混合	契约型开放式	4,190,695.73	9,848,134.97	0.24	否
71	005821	万家新机遇龙头企业混合	契约型开放式	3,667,742.65	9,781,136.10	0.24	否
72	006593	博道中证 500 增强 A	契约型开放式	4,308,242.49	9,609,965.70	0.24	否
73	001566	南方利达灵活配置混合 A	契约型开放式	7,221,388.02	9,590,003.29	0.24	否
74	161606	融通行业景气混合 A	契约型开放式	3,459,861.59	9,050,997.92	0.22	否
75	008704	广发高股息优享混合 A	契约型开放式	7,433,648.06	8,941,935.25	0.22	否
76	001815	华泰柏瑞	契约型开	2,753,028.63	8,743,618.93	0.22	否

		激励动力混合 A	放式				
77	501049	东方红睿玺三年定开混合 A	上市契约型开放式 (LOF)	7,477,132.00	7,978,099.84	0.20	是
78	512010	易方达沪深 300 医药 ETF	交易型开放式 (ETF)	11,111,100.00	7,033,326.30	0.17	否
79	515210	国泰中证钢铁 ETF	交易型开放式 (ETF)	200,000.00	332,600.00	0.01	否

8.13 投资组合报告附注

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

本基金持有的兴业转债（代码：113052 SH）的发行主体兴业银行股份有限公司因违规办理内保外贷业务、未按规定报送财务会计报告等违法违规行为，被国家外汇管理局福建省分局于 2021 年 7 月 21 日处以责令改正、警告、没收违法所得和罚款共计 300 余万元；因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定被中国人民银行于 2021 年 8 月 13 日罚款 5 万元。

本基金持有的邮储银行（代码：601658）发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司因违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费等六项行为于 2021 年 6 月 22 日被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得 11.401116 万元，罚款 437.677425 万元，罚没合计 449.078541 万元。

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。

8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	99,638.25
2	应收证券清算款	371,184.11
3	应收股利	44,906.58
4	应收利息	4,581,552.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	54,943.43
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,152,225.27

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
45,194	88,646.48	149,707,323.43	3.74	3,856,581,505.23	96.26

9.2 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	7,588,842.90	0.19

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研部	>100

门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 3 月 9 日）基金份额总额	4,006,288,828.66
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	4,006,288,828.66

注：本基金合同生效日为 2021 年 3 月 9 日。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

饶刚同志于 2021 年 3 月 12 日起不再担任本基金管理人的副总经理职务；张锋同志自 2021 年 8 月 20 日起担任本基金管理人的总经理职务，同时任莉同志不再担任总经理职务；胡雅丽同志于 2021 年 9 月 24 日起担任本基金管理人的联席总经理职务。

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金所持有的博道嘉瑞混合型证券投资基金自 2021 年 9 月 28 日起至 2021 年 10 月 25 日

止以通讯方式召开基金份额持有人大会，于 2021 年 10 月 26 日表决通过《关于博道嘉瑞混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》。其他本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 7 万元人民币。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	6	668,669,653.26	100.00%	487,251.75	100.00%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	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（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

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

(2) 选择程序

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

3、本基金合同生效日为 2021 年 3 月 9 日，上述交易单元均为本报告期新增。

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券	202,936,404.90	100.00%	62,826,800,000.00	100.00%	-	-	290,667,652.49	100.00%
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江	-	-	-	-	-	-	-	-

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								
华兴								
证券								
汇丰								
前海								
开源								
证券								
民生								
证券								
申万								
宏源								
天风								
证券								
西部								

证券								
西南证券								
兴业证券								
野村东方国际证券								
银河证券								
招商证券								
中金公司								
中泰证券								
中信建投证券								
中信证券								

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）基金份额发售公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年2月9日
2	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年2月9日
3	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）基金合同	中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年2月9日
4	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）招募说明书	中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年2月9日
5	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）托管协议	中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年2月9日
6	关于东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）增加代理销售机构的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年2月19日
7	关于东方红欣和平衡配置两年持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）增加代理销售机构的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021年2月22日
8	关于东方红欣和平衡配置两年持有期	上海证券报、中国证监	2021年2月23日

	混合型基金中基金（FOF）增加代理销售机构的公告	会基金电子披露网站、公司官网	
9	关于东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）增加代理销售机构的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 2 月 24 日
10	关于东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）增加代理销售机构的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 2 月 26 日
11	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）合同生效公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 3 月 10 日
12	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 3 月 13 日
13	关于上海东方证券资产管理有限公司直销中心变更汇款账户的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 6 月 22 日
14	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 7 月 19 日
15	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2021 年第 2 季度报告/提示性公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 7 月 21 日
16	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 8 月 21 日
17	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2021 年中期报告/提示性公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 8 月 31 日
18	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 9 月 25 日
19	东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）2021 年第 3 季度报告/提示性公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 10 月 27 日
20	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金在直销平台开展机构客户费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 11 月 3 日

21	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所基金销售有限公司开通定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 11 月 17 日
22	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金可投资北京证券交易所股票的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 11 月 19 日
23	上海东方证券资产管理有限公司关于设立北京分公司的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 12 月 2 日
24	上海东方证券资产管理有限公司关于提醒直销平台投资者及时完善、更新身份资料信息的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 12 月 10 日
25	上海东方证券资产管理有限公司关于公司网上直销平台暂停服务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 12 月 22 日
26	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2021 年底及 2022 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、公司官网	2021 年 12 月 28 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）的文件；
- 2、《东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）财务报表及报表附注；

5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

13.3 查阅方式

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

上海东方证券资产管理有限公司

2022 年 3 月 31 日