

# 东方互联网嘉混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十六日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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的情况.....	59
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>60</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>61</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
10.4 基金投资策略的改变.....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
10.8 其他重大事件.....	63
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>67</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.....	67

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>68</b>
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方互联网嘉混合型证券投资基金
基金简称	东方互联网嘉混合
基金主代码	002174
前端交易代码	002174
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 6 日
基金管理人	东方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	141,802,366.09 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金从国际化视野审视中国经济和资本市场，全面分析影响股票市场和债券市场走势的各种因素，深入详细地评估股票市场和债券市场的运行趋势。根据影响证券市场运行的各种因素的变化趋势，及时调整大类资产的配置比例，控制系统性风险。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债总全价指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	秦一楠
	联系电话	010-66295888	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95599
传真		010-66578700	010-68121816
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区锦什坊街 28	北京市西城区复兴门内大街 28

	号 1-4 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	崔伟	谷澍

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理股份有限公司	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	34,627,514.00
本期利润	25,283,155.77
加权平均基金份额本期利润	0.1708
本期加权平均净值利润率	15.62%
本期基金份额净值增长率	15.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	24,493,758.12
期末可供分配基金份额利润	0.1727
期末基金资产净值	166,296,124.21
期末基金份额净值	1.1727
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	17.27%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

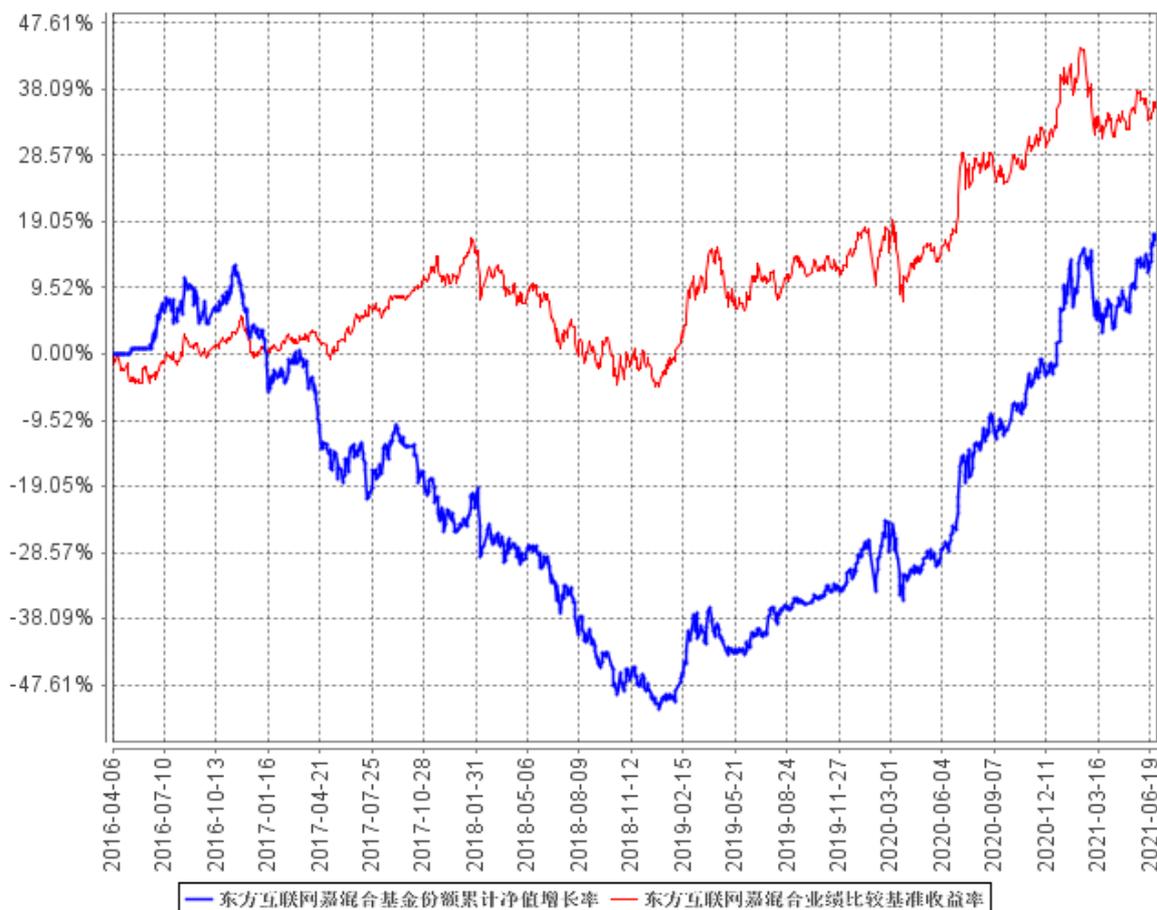
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.27%	0.78%	-1.26%	0.48%	4.53%	0.30%
过去三个月	11.17%	0.91%	2.33%	0.59%	8.84%	0.32%
过去六个月	15.56%	1.21%	0.49%	0.79%	15.07%	0.42%
过去一年	55.02%	1.15%	14.85%	0.79%	40.17%	0.36%
过去三年	76.35%	1.22%	31.34%	0.81%	45.01%	0.41%
自基金合同生效起至今	17.27%	1.14%	35.98%	0.70%	-18.71%	0.44%

### 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

东方互联网嘉混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为东方基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）。本公司经中国证监会“证监基金字[2004]80号”批复批准于2004年6月11日成立。

截至2021年6月30日，本公司注册资本3.3333亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份19200万股，持股比例57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份8100万股，持股比例24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份2700万股，持股比例8.1%；天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持有本公司股份3.37%；天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止2021年6月30日，本公司管理51只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方成长回报平衡混合型证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金证通货币市场基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方卓行18个月定期开放

债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣利混合型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金。

#### 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		
周思越 (先生)	本基金基金经理	2020 年 8 月 28 日	-	12 年	新加坡国立大学经济专业硕士，12 年证券从业经历。曾任长盛基金管理有限公司专户理财部理财经理、东方基金研究部研究员、中信证券股份有限公司资产管理部副总裁（VP）。2017 年 9 月加盟本基金管理人，曾任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理。
王怀勋 (先生)	本基金基金经理助理	2021 年 3 月 17 日	-	6 年	中国人民大学金融专业硕士，6 年证券从业经历。曾任中国人寿保险股份有限公司研发人员。2015 年加盟本基金管理人，曾任产品开发部产品经理助理、专户投资部产品经理、量化投资部研究员，现任东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方量化多策略混合型证券投资基金基金经理助理、东方互联网嘉混合型证券投资

					基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	-----------

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方互联网嘉混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A 股市场在三月的大调整后开始企稳反弹，特别是以新兴产业为主科创板、创业板指数走出一波气势如虹的上涨并创出年内新高。行业方面，电力设备、医药生物、电子领涨市场，而金融地产家电农业则表现逊色。报告期内，本基金在 4 月初加回高仓位，并以沪深 300 行业权重为基础均衡配置，获取了一定的超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日，本基金净值增长率为 15.56%，业绩比较基准收益率为 0.49%，高于业绩比较基准 15.07%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度市场，预计在二季度高涨的投资情绪后要有所降温。7 月的经济数据以及外部环境持续友好，上市公司的财务预告同比也会比较靓丽，但之后的业绩真空期，货币收紧的时间窗口临近，伴随指数新高后短线获利资金的了结，预计指数将在 7 月底 8 月开始调整。随后的海内外货币政策以及年报的预期将会左右市场接下来的走势。目前的阶段应适当降低仓位，以防御的策略应对市场变化。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），成员由分管运营高管、分管投研高管、督察长以及运营部、投研部门（包括但不限于权益投资部、固定收益投资部、量化投资部）、风险管理部负责人组成，估值委员会设立委员会主任 1 名，委员会副主任 1-2 名，估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性，熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下：

#### 1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，

进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

## 2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

## 3. 投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种（简称“停牌有价证券”）时，根据估值委员会要求和运营部的估值方案，负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当，对估值方法有失公允性的“停牌有价证券”，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

## 4. 风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东方基金管理股份有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东方互联网嘉混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	12,408,506.95	28,140,235.83
结算备付金		212,239.47	4,434,074.80
存出保证金		164,626.64	59,287.19
交易性金融资产	6.4.7.2	153,938,897.95	174,040,391.41
其中：股票投资		153,938,897.95	138,934,891.41
基金投资		-	-
债券投资		-	35,105,500.00
资产支持证券投资		-	-
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		-	2,937,130.84
应收利息	6.4.7.5	2,445.05	778,288.95
应收股利		-	-
应收申购款		17,256.04	10,778.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		166,743,972.10	210,400,187.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	28,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		33,091.28	54,616.74
应付管理人报酬		160,075.00	191,848.05
应付托管费		26,679.16	31,974.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	94,138.08	196,599.96
应交税费		-	0.04

应付利息		-	-9,665.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	133,864.37	174,544.27
负债合计		447,847.89	28,639,917.97
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	141,802,366.09	179,101,526.30
未分配利润	6.4.7.10	24,493,758.12	2,658,743.59
所有者权益合计		166,296,124.21	181,760,269.89
负债和所有者权益总计		166,743,972.10	210,400,187.86

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1727 元，基金份额总额 141,802,366.09 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方互联网嘉混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		28,570,767.37	9,679,844.94
1.利息收入		137,653.90	104,883.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	70,245.93	31,200.64
债券利息收入		53,353.18	73,682.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,054.79	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		37,674,078.48	7,639,796.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	36,626,688.17	6,885,482.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-17,868.82	-13,626.83
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	1,065,259.13	767,941.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,344,358.23	1,740,974.28
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	103,393.22	194,190.35
<b>减：二、费用</b>		3,287,611.60	1,531,500.85

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	965,554.71	614,673.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	160,925.79	102,445.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,041,694.45	710,174.76
5. 利息支出		22,677.49	25,301.47
其中：卖出回购金融资产支出		22,677.49	25,301.47
6. 税金及附加		0.03	-
7. 其他费用	6.4.7.20	96,759.13	78,905.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		25,283,155.77	8,148,344.09
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		25,283,155.77	8,148,344.09

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方互联网嘉混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	179,101,526.30	2,658,743.59	181,760,269.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,283,155.77	25,283,155.77
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）	-37,299,160.21	-3,448,141.24	-40,747,301.45
其中：1.基金申购款	7,329,297.45	842,124.23	8,171,421.68
2.基金赎回款	-44,628,457.66	-4,290,265.47	-48,918,723.13
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）	141,802,366.09	24,493,758.12	166,296,124.21

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 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)	116,392,088.79	-34,936,676.75	81,455,412.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,148,344.09	8,148,344.09
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)	10,754,819.91	-4,168,824.63	6,585,995.28
其中：1.基金申购款	79,744,690.37	-23,921,665.83	55,823,024.54
2.基金赎回款	-68,989,870.46	19,752,841.20	-49,237,029.26
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)	127,146,908.70	-30,957,157.29	96,189,751.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
刘鸿鹏	刘鸿鹏	王丹丹
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方互联网嘉混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 7 月 8 日中国证监会《关于准予东方互联网嘉混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1538 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方互联网嘉混合型证券投资基金基金合同》自 2016 年 3 月 3 日至 2016 年 3 月 30 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 558,785,681.32 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2016]第 01300007 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方互联网嘉混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 558,871,927.84 份基金单位，其中认购资金利息折合

86,246.52 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方互联网嘉混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

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

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

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、[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]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、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、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。

4、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。

5、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。

6、基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	12,408,506.95
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：	12,408,506.95

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	145,869,395.99	153,938,897.95	8,069,501.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	145,869,395.99	153,938,897.95	8,069,501.96

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,292.41
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	85.95
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	66.69
合计	2,445.05

注：其他为应收结算保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	94,138.08
银行间市场应付交易费用	-
合计	94,138.08

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	21.21
应付证券出借违约金	-
预提费用	133,843.16
合计	133,864.37

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	179,101,526.30	179,101,526.30
本期申购	7,329,297.45	7,329,297.45
本期赎回(以“-”号填列)	-44,628,457.66	-44,628,457.66
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	141,802,366.09	141,802,366.09

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

### 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
上年度末	-7,814,119.04	10,472,862.63	2,658,743.59
本期利润	34,627,514.00	-9,344,358.23	25,283,155.77
本期基金份额交易产生的变动数	-706,560.66	-2,741,580.58	-3,448,141.24
其中：基金申购款	1,026,092.39	-183,968.16	842,124.23
基金赎回款	-1,732,653.05	-2,557,612.42	-4,290,265.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,106,834.30	-1,613,076.18	24,493,758.12

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	53,564.24
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	15,738.07
其他	943.62
合计	70,245.93

注：其他为结算保证金利息收入。

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	673,835,046.66
减：卖出股票成本总额	637,208,358.49
买卖股票差价收入	36,626,688.17

**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 2021年1月1日至2021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	-17,868.82
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	-17,868.82

**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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	66,827,549.80

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	65,880,886.60
减：应收利息总额	964,532.02
买卖债券差价收入	-17,868.82

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,065,259.13
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	1,065,259.13

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-9,344,358.23
——股票投资	-9,397,494.83
——债券投资	53,136.60
——资产支持证券投资	-
——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	-9,344,358.23

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	103,310.03
基金转换费收入	83.19
合计	103,393.22

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	2,041,694.45
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,041,694.45

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费用	9,000.00
银行汇划费用	8,415.97
合计	96,759.13

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	965,554.71	614,673.62
其中：支付销售机构的客户维护费	72,901.76	112,349.80

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计算。

管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五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、公休假等，支付日期顺延。

③本基金于 2020 年 9 月 30 日，将管理费自 1.50% 调整至 1.20%，详情请见《东方基金管理股份有限公司关于调整东方互联网嘉混合型证券投资基金的基金管理费率、基金托管费率并修改基金合同等法律文件的公告》。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	160,925.79	102,445.50

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人

向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

③本基金于 2020 年 9 月 30 日，将托管费自 0.25%调整至 0.20%，详情请见《东方基金管理股份有限公司关于调整东方互联网嘉混合型证券投资基金的基金管理费率、基金托管费率并修改基金合同等法律文件的公告》。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	12,408,506.95	53,564.24	514,339.35	26,378.03

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

#### 6.4.12 期末（2021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
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	1,323	51,398.55	51,398.55	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	1,753	38,495.88	38,495.88	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股锁定限售	2.65	5.90	907,763	2,405,571.95	5,355,801.70	-
688680	海优新材	2021年1月15日	2021年7月22日	科创板限售	69.94	243.14	1,175	82,179.50	285,689.50	-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	科创板限售	18.94	124.87	1,941	36,762.54	242,372.67	-
688700	东威科技	2021年6月7日	2021年12月15日	科创板限售	9.41	48.57	3,049	28,691.09	148,089.93	-
688315	诺禾致源	2021年4月2日	2021年10月13日	科创板限售	12.76	42.87	2,869	36,608.44	122,994.03	-
688317	之江生物	2021年1月8日	2021年7月19日	科创板限售	43.22	63.78	1,927	83,284.94	122,904.06	-
688097	博众精工	2021年4月29日	2021年11月12日	科创板限售	11.27	30.45	3,211	36,187.97	97,774.95	-
688636	智明达	2021年3月30日	2021年10月8日	科创板限售	34.50	96.32	918	31,671.00	88,421.76	-
688117	圣诺生物	2021年5月26日	2021年12月3日	科创板限售	17.90	45.87	1,672	29,928.80	76,694.64	-
688663	新风光	2021年4月6日	2021年10月13日	科创板限售	14.48	20.36	3,070	44,453.60	62,505.20	-

301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	创业板限售	7.64	54.81	462	3,529.68	25,322.22	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	创业板限售	28.28	145.09	156	4,411.68	22,634.04	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	创业板限售	28.77	99.71	195	5,610.15	19,443.45	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	创业板限售	8.72	35.33	471	4,107.12	16,640.43	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	创业板限售	9.19	49.61	329	3,023.51	16,321.69	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	创业板限售	15.83	50.96	317	5,018.11	16,154.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	创业板限售	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	创业板限售	21.31	49.91	284	6,052.04	14,174.44	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	创业板限售	4.94	17.26	806	3,981.64	13,911.56	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	创业板限售	48.59	106.28	129	6,268.11	13,710.12	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	创业板限售	12.76	43.35	307	3,917.32	13,308.45	-

300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	创业板限售	12.25	53.66	244	2,989.00	13,093.04	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	创业板限售	24.69	31.70	399	9,851.31	12,648.30	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	创业板限售	5.31	28.49	443	2,352.33	12,621.07	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	创业板限售	20.81	50.60	241	5,015.21	12,194.60	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	创业板限售	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	创业板限售	13.75	41.07	275	3,781.25	11,294.25	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	创业板限售	8.24	39.27	286	2,356.64	11,231.22	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	创业板限售	6.87	14.98	718	4,932.66	10,755.64	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	创业板限售	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	创业板限售	8.42	16.77	593	4,993.06	9,944.61	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	创业板限售	14.79	37.24	264	3,904.56	9,831.36	-

300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	创业板限售	12.10	23.23	410	4,961.00	9,524.30	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	创业板限售	7.81	28.94	312	2,436.72	9,029.28	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板限售	4.56	18.87	474	2,161.44	8,944.38	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	创业板限售	8.67	27.39	324	2,808.00	8,874.36	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	创业板限售	4.31	13.10	672	2,896.32	8,803.20	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	创业板限售	13.06	34.14	254	3,317.24	8,671.56	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	创业板限售	8.41	39.12	219	1,841.79	8,567.28	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	创业板限售	5.48	17.07	492	2,696.16	8,398.44	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	创业板限售	18.24	33.37	245	4,468.80	8,175.65	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	创业板限售	10.76	22.16	359	3,862.84	7,955.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	创业板限售	4.54	15.34	507	2,301.78	7,777.38	-

300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	创业板限售	7.19	16.20	430	3,091.70	6,966.00	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	创业板限售	13.39	30.08	217	2,905.63	6,527.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	创业板限售	9.79	23.00	255	2,496.45	5,865.00	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	创业板限售	5.29	19.12	303	1,602.87	5,793.36	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	创业板限售	6.02	28.50	201	1,210.02	5,728.50	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	创业板限售	14.72	28.81	191	2,811.52	5,502.71	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	创业板限售	8.05	32.12	170	1,368.50	5,460.40	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月20日	创业板限售	13.87	29.53	183	2,538.21	5,403.99	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	创业板限售	9.36	26.89	200	1,872.00	5,378.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	创业板限售	7.83	22.62	218	1,706.94	4,931.16	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	创业板限售	24.90	27.29	180	4,482.00	4,912.20	-

注：流通受限证券可流通日以上市日公告为准。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的股票市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

**6.4.13.3 流动性风险**

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

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大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，除在本报告（6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通

暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,408,506.95	-	-	-	12,408,506.95

结算备付金	212,239.47	-	-	-	212,239.47
存出保证金	164,626.64	-	-	-	164,626.64
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	153,938,897.95	153,938,897.95
交易性金融资产-债券投资	0.00	0.00	0.00	-	0.00
交易性金融资产-资产支持证券投资	0.00	0.00	0.00	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	2,445.05	2,445.05
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	17,256.04	17,256.04
资产总计	12,785,373.06	0.00	0.00	153,958,599.04	166,743,972.10
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	33,091.28	33,091.28
应付管理人报酬	-	-	-	160,075.00	160,075.00
应付托管费	-	-	-	26,679.16	26,679.16
应付交易费用	-	-	-	94,138.08	94,138.08
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	133,864.37	133,864.37
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	447,847.89	447,847.89
利率敏感度缺口	12,785,373.06	0.00	0.00	153,510,751.15	166,296,124.21
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	28,140,235.83	-	-	-	28,140,235.83
结算备付金	4,434,074.80	-	-	-	4,434,074.80
存出保证金	59,287.19	-	-	-	59,287.19
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	138,934,891.41	138,934,891.41
交易性金融资产-债券投资	34,996,500.00	0.00	109,000.00	-	35,105,500.00
交易性金融资产-资产支持证券投资	0.00	0.00	0.00	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	2,937,130.84	2,937,130.84
应收利息	-	-	-	778,288.95	778,288.95
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	10,778.84	10,778.84
资产总计	67,630,097.82	0.00	109,000.00	142,661,090.04	210,400,187.86
负债					
卖出回购金融资产款	28,000,000.00	-	-	-	28,000,000.00

应付赎回款	-	-	-	54,616.74	54,616.74
应付管理人报酬	-	-	-	191,848.05	191,848.05
应付托管费	-	-	-	31,974.66	31,974.66
应付交易费用	-	-	-	196,599.96	196,599.96
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.04	0.04
应付利息	-	-	-	-9,665.75	-9,665.75
其他负债	-	-	-	174,544.27	174,544.27
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	28,000,000.00	0.00	0.00	639,917.97	28,639,917.97
利率敏感度缺口	39,630,097.82	0.00	109,000.00	142,021,172.07	181,760,269.89

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	0.00	2,524.48
	市场利率上调 0.25%	0.00	-2,742.48

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
----	-------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	153,938,897.95	92.57	138,934,891.41	76.44
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	35,105,500.00	19.31
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	153,938,897.95	92.57	174,040,391.41	95.75

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-7,764,455.27	-7,161,899.50
	沪深 300 指数上涨 5%	7,764,455.27	7,161,899.50

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 3,122,943.84 元，占基金资产净值比例为 1.88%；上年度末本基金风险价值为 2,448,657.14 元，占基金资产净值比例为 1.35%。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	153,938,897.95	92.32
	其中：股票	153,938,897.95	92.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,620,746.42	7.57
8	其他各项资产	184,327.73	0.11
9	合计	166,743,972.10	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	1,885,444.38	1.13
B	采矿业	2,722,406.00	1.64
C	制造业	83,634,017.13	50.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,796,070.09	3.49
E	建筑业	2,188,737.76	1.32
F	批发和零售业	1,062,582.60	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	4,209,861.00	2.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,110,036.00	2.47
J	金融业	35,573,869.90	21.39
K	房地产业	3,058,703.00	1.84
L	租赁和商务服务业	2,899,711.00	1.74
M	科学研究和技术服务业	1,908,120.03	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	30,600.04	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	219,345.00	0.13

Q	卫生和社会工作	3,974,549.02	2.39
R	文化、体育和娱乐业	664,845.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	153,938,897.95	92.57

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,400	6,992,780.00	4.21
2	600905	三峡能源	907,763	5,355,801.70	3.22
3	600036	招商银行	88,500	4,795,815.00	2.88
4	601318	中国平安	73,900	4,750,292.00	2.86
5	000858	五粮液	14,100	4,200,249.00	2.53
6	601012	隆基股份	30,380	2,698,959.20	1.62
7	000333	美的集团	37,300	2,662,101.00	1.60
8	601166	兴业银行	114,500	2,352,975.00	1.41
9	300059	东方财富	66,920	2,194,306.80	1.32
10	600276	恒瑞医药	30,840	2,096,194.80	1.26
11	601888	中国中免	6,900	2,070,690.00	1.25
12	000651	格力电器	38,300	1,995,430.00	1.20
13	002415	海康威视	30,000	1,935,000.00	1.16
14	600030	中信证券	75,300	1,877,982.00	1.13
15	603259	药明康德	11,400	1,785,126.00	1.07
16	002594	比亚迪	7,000	1,757,000.00	1.06
17	002475	立讯精密	37,600	1,729,600.00	1.04
18	000002	万科A	70,400	1,676,224.00	1.01
19	600887	伊利股份	42,600	1,568,958.00	0.94
20	000725	京东方A	244,600	1,526,304.00	0.92
21	000568	泸州老窖	6,300	1,486,422.00	0.89
22	300015	爱尔眼科	19,449	1,380,490.02	0.83
23	601229	上海银行	163,100	1,337,420.00	0.80
24	603501	韦尔股份	4,100	1,320,200.00	0.79
25	000001	平安银行	57,800	1,307,436.00	0.79
26	600436	片仔癀	2,900	1,300,070.00	0.78
27	002714	牧原股份	21,000	1,277,220.00	0.77
28	601398	工商银行	239,100	1,236,147.00	0.74
29	600309	万华化学	11,300	1,229,666.00	0.74

30	600763	通策医疗	2,900	1,191,900.00	0.72
31	600016	民生银行	264,700	1,167,327.00	0.70
32	600809	山西汾酒	2,600	1,164,800.00	0.70
33	000661	长春高新	3,000	1,161,000.00	0.70
34	300122	智飞生物	6,200	1,157,726.00	0.70
35	600031	三一重工	39,800	1,156,986.00	0.70
36	000063	中兴通讯	33,500	1,113,205.00	0.67
37	000166	申万宏源	236,200	1,105,416.00	0.66
38	300014	亿纬锂能	10,200	1,060,086.00	0.64
39	601919	中远海控	34,100	1,041,414.00	0.63
40	002371	北方华创	3,700	1,026,306.00	0.62
41	002352	顺丰控股	15,100	1,022,270.00	0.61
42	603288	海天味业	7,910	1,019,994.50	0.61
43	601668	中国建筑	218,900	1,017,885.00	0.61
44	002230	科大讯飞	14,600	986,668.00	0.59
45	000776	广发证券	64,500	976,530.00	0.59
46	601328	交通银行	187,800	920,220.00	0.55
47	601899	紫金矿业	93,900	909,891.00	0.55
48	002812	恩捷股份	3,700	866,170.00	0.52
49	002460	赣锋锂业	7,000	847,630.00	0.51
50	300124	汇川技术	11,400	846,564.00	0.51
51	601601	中国太保	28,900	837,233.00	0.50
52	002271	东方雨虹	15,000	829,800.00	0.50
53	002027	分众传媒	88,100	829,021.00	0.50
54	000338	潍柴动力	45,200	807,724.00	0.49
55	600000	浦发银行	79,600	796,000.00	0.48
56	002142	宁波银行	20,000	779,400.00	0.47
57	002304	洋河股份	3,700	766,640.00	0.46
58	600570	恒生电子	8,100	755,325.00	0.45
59	603986	兆易创新	3,920	736,568.00	0.44
60	600438	通威股份	17,000	735,590.00	0.44
61	300347	泰格医药	3,700	715,210.00	0.43
62	600585	海螺水泥	17,000	697,850.00	0.42
63	600690	海尔智家	26,500	686,615.00	0.41
64	002049	紫光国微	4,400	678,436.00	0.41
65	600019	宝钢股份	87,800	670,792.00	0.40
66	601009	南京银行	63,200	664,864.00	0.40
67	000100	TCL 科技	83,800	641,070.00	0.39
68	603799	华友钴业	5,600	639,520.00	0.38

69	002241	歌尔股份	14,800	632,552.00	0.38
70	601688	华泰证券	39,900	630,420.00	0.38
71	300274	阳光电源	5,400	621,324.00	0.37
72	000783	长江证券	84,800	620,736.00	0.37
73	601006	大秦铁路	94,200	619,836.00	0.37
74	600196	复星医药	8,500	613,105.00	0.37
75	002311	海大集团	7,500	612,000.00	0.37
76	300498	温氏股份	41,300	593,481.00	0.36
77	688036	传音控股	2,800	586,600.00	0.35
78	600919	江苏银行	82,500	585,750.00	0.35
79	600048	保利地产	48,400	582,736.00	0.35
80	002129	中环股份	15,000	579,000.00	0.35
81	600588	用友网络	16,600	552,116.00	0.33
82	300601	康泰生物	3,700	551,300.00	0.33
83	601211	国泰君安	31,200	534,768.00	0.32
84	000538	云南白药	4,500	520,740.00	0.31
85	600132	重庆啤酒	2,600	514,670.00	0.31
86	300413	芒果超媒	7,500	514,500.00	0.31
87	688012	中微公司	3,100	514,352.00	0.31
88	002410	广联达	7,500	511,500.00	0.31
89	601766	中国中车	82,500	501,600.00	0.30
90	600104	上汽集团	22,700	498,719.00	0.30
91	000625	长安汽车	18,800	494,064.00	0.30
92	002601	龙佰集团	14,200	491,036.00	0.30
93	000563	陕国投 A	151,800	488,796.00	0.29
94	002493	荣盛石化	28,200	487,014.00	0.29
95	600999	招商证券	25,600	486,912.00	0.29
96	601169	北京银行	99,600	485,052.00	0.29
97	000999	华润三九	17,900	478,825.00	0.29
98	000768	中航西飞	18,200	478,296.00	0.29
99	300408	三环集团	11,200	475,104.00	0.29
100	600660	福耀玻璃	8,500	474,725.00	0.29
101	600406	国电南瑞	20,400	474,096.00	0.29
102	002673	西部证券	56,100	462,825.00	0.28
103	002841	视源股份	3,700	459,873.00	0.28
104	600893	航发动力	8,500	452,115.00	0.27
105	603882	金域医学	2,800	447,356.00	0.27
106	300433	蓝思科技	15,000	441,150.00	0.27
107	601988	中国银行	142,200	437,976.00	0.26

108	000728	国元证券	54,100	431,177.00	0.26
109	600900	长江电力	20,700	427,248.00	0.26
110	000157	中联重科	46,200	426,888.00	0.26
111	002007	华兰生物	11,200	410,816.00	0.25
112	601818	光大银行	108,100	408,618.00	0.25
113	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.25
114	600028	中国石化	90,500	394,580.00	0.24
115	002001	新和成	13,560	388,900.80	0.23
116	603160	汇顶科技	3,000	388,890.00	0.23
117	601628	中国人寿	11,400	386,346.00	0.23
118	601633	长城汽车	8,600	374,874.00	0.23
119	000069	华侨城 A	50,200	373,488.00	0.22
120	600346	恒力石化	14,200	372,608.00	0.22
121	300003	乐普医疗	11,200	359,744.00	0.22
122	002050	三花智控	15,000	359,700.00	0.22
123	600584	长电科技	9,500	357,960.00	0.22
124	601377	兴业证券	37,000	357,420.00	0.21
125	601390	中国中铁	68,200	357,368.00	0.21
126	601857	中国石油	65,400	345,966.00	0.21
127	000963	华东医药	7,500	345,075.00	0.21
128	001979	招商蛇口	30,100	329,595.00	0.20
129	601225	陕西煤业	27,100	321,135.00	0.19
130	002202	金风科技	26,300	319,808.00	0.19
131	300529	健帆生物	3,700	319,532.00	0.19
132	300558	贝达药业	2,900	313,896.00	0.19
133	601939	建设银行	45,500	302,575.00	0.18
134	600741	华域汽车	11,400	299,478.00	0.18
135	600926	杭州银行	20,000	295,000.00	0.18
136	000786	北新建材	7,500	294,375.00	0.18
137	600111	北方稀土	14,200	293,940.00	0.18
138	002179	中航光电	3,700	292,374.00	0.18
139	002414	高德红外	10,500	289,590.00	0.17
140	300450	先导智能	4,800	288,672.00	0.17
141	688680	海优新材	1,175	285,689.50	0.17
142	601877	正泰电器	8,500	283,730.00	0.17
143	600958	东方证券	28,400	283,716.00	0.17
144	600745	闻泰科技	2,875	278,587.50	0.17
145	000876	新希望	18,800	275,796.00	0.17
146	603806	福斯特	2,600	273,338.00	0.16

147	600050	中国联通	62,600	270,432.00	0.16
148	600009	上海机场	5,600	269,528.00	0.16
149	300595	欧普康视	2,600	269,230.00	0.16
150	600015	华夏银行	42,600	263,694.00	0.16
151	000425	徐工机械	41,300	263,081.00	0.16
152	601336	新华保险	5,700	261,687.00	0.16
153	301015	百洋医药	4,614	258,498.54	0.16
154	601989	中国重工	62,500	257,500.00	0.15
155	600143	金发科技	12,300	256,578.00	0.15
156	600176	中国巨石	16,231	251,742.81	0.15
157	601816	京沪高铁	47,200	249,688.00	0.15
158	603993	洛阳钼业	48,300	249,228.00	0.15
159	688269	凯立新材	1,941	242,372.67	0.15
160	601600	中国铝业	45,600	241,680.00	0.15
161	601100	恒立液压	2,800	240,576.00	0.14
162	002044	美年健康	26,300	239,593.00	0.14
163	000895	双汇发展	7,500	238,500.00	0.14
164	600010	包钢股份	153,600	238,080.00	0.14
165	603899	晨光文具	2,800	236,768.00	0.14
166	600352	浙江龙盛	17,000	233,580.00	0.14
167	601186	中国铁建	31,300	232,559.00	0.14
168	600600	青岛啤酒	2,000	231,300.00	0.14
169	688396	华润微	2,500	227,550.00	0.14
170	600426	华鲁恒升	7,100	219,745.00	0.13
171	002607	中公教育	10,500	219,345.00	0.13
172	000066	中国长城	15,000	219,000.00	0.13
173	600547	山东黄金	11,300	217,186.00	0.13
174	000977	浪潮信息	7,600	213,788.00	0.13
175	000630	铜陵有色	73,400	199,648.00	0.12
176	601669	中国电建	51,200	198,144.00	0.12
177	600989	宝丰能源	14,100	192,888.00	0.12
178	300628	亿联网络	2,300	192,740.00	0.12
179	600029	南方航空	31,200	187,824.00	0.11
180	688008	澜起科技	3,000	187,140.00	0.11
181	002236	大华股份	8,800	185,680.00	0.11
182	002157	正邦科技	15,000	179,250.00	0.11
183	002463	沪电股份	11,200	173,264.00	0.10
184	002508	老板电器	3,700	172,050.00	0.10
185	600161	天坛生物	4,900	167,825.00	0.10

186	002555	三七互娱	6,900	165,738.00	0.10
187	002008	大族激光	4,100	165,599.00	0.10
188	002056	横店东磁	12,700	165,100.00	0.10
189	601088	中国神华	8,300	162,016.00	0.10
190	601021	春秋航空	2,800	159,320.00	0.10
191	600115	中国东航	31,300	159,004.00	0.10
192	300033	同花顺	1,400	157,892.00	0.09
193	000860	顺鑫农业	3,700	156,066.00	0.09
194	601111	中国国航	20,000	155,600.00	0.09
195	002938	鹏鼎控股	4,300	154,284.00	0.09
196	002422	科伦药业	7,600	151,620.00	0.09
197	002120	韵达股份	11,200	151,536.00	0.09
198	002821	凯莱英	400	149,040.00	0.09
199	688700	东威科技	3,049	148,089.93	0.09
200	601800	中国交建	22,800	147,744.00	0.09
201	600183	生益科技	6,300	147,483.00	0.09
202	603338	浙江鼎力	2,500	146,725.00	0.09
203	601618	中国中冶	48,300	143,934.00	0.09
204	601788	光大证券	7,600	135,964.00	0.08
205	603517	绝味食品	1,600	134,864.00	0.08
206	002032	苏泊尔	2,100	133,959.00	0.08
207	600177	雅戈尔	19,900	131,141.00	0.08
208	600079	人福医药	4,500	127,215.00	0.08
209	000938	紫光股份	5,800	126,904.00	0.08
210	300136	信维通信	4,100	126,608.00	0.08
211	600362	江西铜业	5,600	125,328.00	0.08
212	688315	诺禾致源	2,869	122,994.03	0.07
213	688317	之江生物	1,927	122,904.06	0.07
214	600489	中金黄金	14,200	122,404.00	0.07
215	002153	石基信息	5,180	121,781.80	0.07
216	688161	威高骨科	1,127	119,518.35	0.07
217	603233	大参林	2,320	118,575.20	0.07
218	002739	万达电影	7,500	118,425.00	0.07
219	301016	雷尔伟	2,747	117,936.33	0.07
220	603939	益丰药房	2,100	117,789.00	0.07
221	601138	工业富联	9,300	115,413.00	0.07
222	002624	完美世界	4,800	114,768.00	0.07
223	002958	青农商行	26,300	112,564.00	0.07
224	600018	上港集团	22,800	108,756.00	0.07

225	601238	广汽集团	8,300	107,485.00	0.06
226	601607	上海医药	5,000	105,650.00	0.06
227	600521	华海药业	5,000	104,400.00	0.06
228	600760	中航沈飞	1,680	101,304.00	0.06
229	688097	博众精工	3,211	97,774.95	0.06
230	600848	上海临港	5,400	96,660.00	0.06
231	000723	美锦能源	12,500	94,500.00	0.06
232	002456	欧菲光	10,000	88,800.00	0.05
233	688636	智明达	918	88,421.76	0.05
234	002602	世纪华通	13,500	86,670.00	0.05
235	601933	永辉超市	18,300	86,559.00	0.05
236	601901	方正证券	9,200	86,112.00	0.05
237	600233	圆通速递	8,500	85,085.00	0.05
238	688126	沪硅产业	2,900	84,622.00	0.05
239	601216	君正集团	16,600	84,494.00	0.05
240	601995	中金公司	1,300	79,950.00	0.05
241	601066	中信建投	2,500	78,575.00	0.05
242	688117	圣诺生物	1,672	76,694.64	0.05
243	601658	邮储银行	13,000	65,260.00	0.04
244	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.04
245	600872	中炬高新	1,500	63,030.00	0.04
246	688663	新风光	3,070	62,505.20	0.04
247	601117	中国化学	6,700	58,692.00	0.04
248	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
249	002384	东山精密	2,700	56,268.00	0.03
250	688499	利元亨	1,323	51,398.55	0.03
251	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.03
252	300919	中伟股份	290	47,270.00	0.03
253	002773	康弘药业	2,000	46,260.00	0.03
254	300894	火星人	628	42,704.00	0.03
255	688087	英科再生	1,753	38,495.88	0.02
256	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
257	300144	宋城演艺	1,900	31,920.00	0.02
258	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
259	300973	立高食品	156	22,634.04	0.01
260	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
261	300953	震裕科技	195	19,443.45	0.01
262	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
263	301013	利和兴	471	16,640.43	0.01

264	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.01
265	300982	苏文电能	317	16,154.32	0.01
266	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
267	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.01
268	300941	创识科技	284	14,174.44	0.01
269	300997	欢乐家	806	13,911.56	0.01
270	300981	中红医疗	129	13,710.12	0.01
271	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
272	300940	南极光	307	13,308.45	0.01
273	300937	药易购	244	13,093.04	0.01
274	300932	三友联众	399	12,648.30	0.01
275	300942	易瑞生物	443	12,621.07	0.01
276	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
277	300996	普联软件	241	12,194.60	0.01
278	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
279	300966	共同药业	286	11,231.22	0.01
280	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
281	300968	格林精密	718	10,755.64	0.01
282	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.01
283	300978	东箭科技	593	9,944.61	0.01
284	300986	志特新材	264	9,831.36	0.01
285	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.01
286	301004	嘉益股份	312	9,029.28	0.01
287	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.01
288	300948	冠中生态	324	8,874.36	0.01
289	300931	通用电梯	672	8,803.20	0.01
290	300991	创益通	254	8,671.56	0.01
291	300950	德固特	219	8,567.28	0.01
292	300975	商络电子	492	8,398.44	0.01
293	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.01
294	300971	博亚精工	245	8,175.65	0.00
295	300926	博俊科技	359	7,955.44	0.00
296	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
297	300972	万辰生物	430	6,966.00	0.00
298	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
299	601360	三六零	500	6,105.00	0.00
300	300943	春晖智控	255	5,865.00	0.00
301	301007	德迈仕	303	5,793.36	0.00
302	300998	宁波方正	201	5,728.50	0.00

303	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
304	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.00
305	300929	华骐环保	183	5,403.99	0.00
306	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.00
307	600068	葛洲坝	700	5,243.00	0.00
308	301010	晶雪节能	218	4,931.16	0.00
309	300985	致远新能	180	4,912.20	0.00
310	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000100	TCL 科技	19,790,718.00	10.89
2	002142	宁波银行	18,186,735.20	10.01
3	600036	招商银行	15,850,131.67	8.72
4	601088	中国神华	14,154,704.00	7.79
5	000651	格力电器	13,613,745.99	7.49
6	601318	中国平安	13,185,030.00	7.25
7	600048	保利地产	12,730,103.00	7.00
8	601012	隆基股份	12,356,396.00	6.80
9	600585	海螺水泥	11,765,974.00	6.47
10	600887	伊利股份	11,502,153.30	6.33
11	603501	韦尔股份	11,484,254.00	6.32
12	000002	万 科A	10,966,070.95	6.03
13	000001	平安银行	10,690,983.39	5.88
14	000333	美的集团	10,414,874.00	5.73
15	002352	顺丰控股	9,185,029.15	5.05
16	600438	通威股份	8,852,685.00	4.87
17	600519	贵州茅台	8,661,904.00	4.77
18	601398	工商银行	8,315,000.00	4.57
19	600030	中信证券	8,060,096.15	4.43
20	002594	比亚迪	8,046,684.00	4.43
21	002202	金风科技	8,014,611.73	4.41
22	002371	北方华创	8,007,239.00	4.41

23	002475	立讯精密	7,598,986.30	4.18
24	601111	中国国航	7,586,801.00	4.17
25	600028	中国石化	7,552,829.00	4.16
26	002607	中公教育	7,316,831.35	4.03
27	600588	用友网络	7,265,144.01	4.00
28	000858	五粮液	7,264,907.00	4.00
29	600276	恒瑞医药	7,154,898.40	3.94
30	000725	京东方A	6,940,860.00	3.82
31	601166	兴业银行	6,815,328.00	3.75
32	000776	广发证券	6,794,381.00	3.74
33	000625	长安汽车	6,719,239.00	3.70
34	600460	士兰微	6,332,650.82	3.48
35	600000	浦发银行	6,318,280.00	3.48
36	300122	智飞生物	5,755,287.00	3.17
37	600019	宝钢股份	5,655,195.00	3.11
38	002230	科大讯飞	5,591,374.00	3.08
39	002572	索菲亚	5,142,187.00	2.83
40	000998	隆平高科	4,828,902.00	2.66
41	002027	分众传媒	4,754,940.00	2.62
42	600900	长江电力	4,438,528.00	2.44
43	000723	美锦能源	4,307,919.43	2.37
44	603259	药明康德	4,161,799.00	2.29
45	600893	航发动力	4,062,626.00	2.24
46	600031	三一重工	4,046,608.00	2.23
47	000338	潍柴动力	3,777,961.00	2.08
48	601888	中国中免	3,745,330.87	2.06
49	000661	长春高新	3,736,104.00	2.06
50	600104	上汽集团	3,671,237.00	2.02

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

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	000001	平安银行	21,060,209.46	11.59
2	600036	招商银行	20,246,693.99	11.14
3	000100	TCL 科技	19,296,987.00	10.62
4	603501	韦尔股份	17,242,358.12	9.49
5	002142	宁波银行	16,782,589.21	9.23
6	601318	中国平安	16,727,205.86	9.20
7	000651	格力电器	15,509,343.29	8.53
8	601088	中国神华	14,712,192.00	8.09
9	000002	万 科 A	13,915,702.00	7.66
10	600585	海螺水泥	13,725,482.00	7.55
11	600048	保利地产	11,670,220.00	6.42
12	000858	五 粮 液	11,477,800.00	6.31
13	000333	美的集团	10,381,134.00	5.71
14	600030	中信证券	10,216,198.00	5.62
15	002371	北方华创	10,202,411.00	5.61
16	600887	伊利股份	10,027,022.00	5.52
17	002230	科大讯飞	9,481,388.04	5.22
18	002352	顺丰控股	9,308,544.00	5.12
19	000725	京东方 A	9,285,430.00	5.11
20	601012	隆基股份	9,157,685.00	5.04
21	601166	兴业银行	8,887,346.00	4.89
22	601111	中国国航	8,472,414.00	4.66
23	600588	用友网络	8,341,751.83	4.59
24	600031	三一重工	8,066,155.95	4.44
25	600309	万华化学	7,977,860.00	4.39
26	300059	东方财富	7,540,774.28	4.15
27	600438	通威股份	7,249,943.00	3.99
28	002202	金风科技	7,103,908.00	3.91
29	600028	中国石化	7,096,396.00	3.90
30	601398	工商银行	7,005,184.00	3.85
31	002241	歌尔股份	6,951,760.76	3.82
32	600460	士兰微	6,712,391.81	3.69
33	002607	中公教育	6,667,447.32	3.67
34	688981	中芯国际	6,256,185.89	3.44
35	000625	长安汽车	6,031,813.00	3.32
36	600519	贵州茅台	5,853,645.00	3.22
37	002594	比亚迪	5,820,193.00	3.20
38	002475	立讯精密	5,750,109.04	3.16

39	000776	广发证券	5,617,132.00	3.09
40	600000	浦发银行	5,438,240.12	2.99
41	300122	智飞生物	5,406,759.00	2.97
42	600019	宝钢股份	5,347,749.72	2.94
43	601899	紫金矿业	5,225,417.00	2.87
44	002572	索菲亚	5,116,981.50	2.82
45	600276	恒瑞医药	4,888,016.80	2.69
46	000998	隆平高科	4,809,661.00	2.65
47	300750	宁德时代	4,444,449.00	2.45
48	603259	药明康德	4,318,066.00	2.38
49	601628	中国人寿	4,297,282.00	2.36
50	601668	中国建筑	4,248,282.00	2.34
51	000723	美锦能源	4,032,463.00	2.22
52	600900	长江电力	3,976,815.00	2.19
53	002236	大华股份	3,884,034.22	2.14
54	002027	分众传媒	3,860,604.00	2.12
55	600893	航发动力	3,661,443.25	2.01

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

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	661,609,859.86
卖出股票收入（成交）总额	673,835,046.66

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

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有的贵州茅台（600519）公司因未依法履行其他职责受到上海证券交易所的监管关注。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的招商银行（600036）公司因业务违规受到中国人民银行、各地银保监会的行政处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的兴业银行（601166）公司因业务违规受到各地银保监会的行政处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

（1）研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

（2）投资决策委员会定期召开会议，讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

（3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

（4）交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

（5）投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资贵州茅台基于以下原因：公司是国内白酒龙头企业，业绩确定性强，长期看好公司内生价值增长。

本基金投资招商银行主要基于以下原因：公司是国内领先的零售银行，通过多年来零售战略的执行，公司的零售客户不仅存在规模优势，而且客户质量优质，客户结构中私行客户占比高，客户潜在价值空间大。公司在零售领域建立了强大的护城河，创新能力行业领先，业务结构稳健，业绩稳定，资产质量好于行业竞争对手。

本基金投资兴业银行主要基于以下原因：基本面向好，贷款利率和业绩增速均已迎来拐点，在经济数据改善的催化下，有望重启上涨行情。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	164,626.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,445.05
5	应收申购款	17,256.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	184,327.73

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,355,801.70	3.22	新股锁定限售

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,024	70,060.46	120,760,793.57	85.16%	21,041,572.52	14.84%

### 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	0.00	0.00%

### 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的情况

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	0
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（2016年4月6日）基金份额总额	558,871,927.84
本报告期期初基金份额总额	179,101,526.30
本报告期基金总申购份额	7,329,297.45
减：本报告期基金总赎回份额	44,628,457.66
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	141,802,366.09

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 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	
兴业证券股份有限公司	2	596,881,095.17	44.99%	555,871.55	44.99%	-
长江证券股份有限公司	2	427,130,194.46	32.20%	397,787.37	32.20%	-
浙商证券股份有限公司	2	302,564,094.45	22.81%	281,779.79	22.81%	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

司						
光大证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

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

（2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

（3）本报告期内，本基金交易单元未发生变更。

**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
兴业证券股份有限公司	10,535,505.60	15.82%	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	53,537,524.60	80.40%	133,000,000.00	81.60%	-	-
浙商证券股份有限公司	2,512,250.00	3.77%	30,000,000.00	18.40%	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
-------	--	--	--	--	--	--

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方基金管理股份有限公司年度最后一日基金净值公告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 1 日
2	关于旗下部分基金参与中国银行申购以及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 4 日
3	东方互联网嘉混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 21 日
4	关于旗下部分基金与农业银行基金定投手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 28 日
5	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021 年 2 月 8 日
6	关于旗下部分基金参与济安财富（北京）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 6 日
7	关于增加招商银行股份有限公司招赢通平台为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 9 日
8	关于增加北京度小满基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 11 日
9	关于旗下部分基金参与宁波银行同业易管家平台费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 17 日

10	关于增加宁波银行股份有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 17 日
11	关于旗下部分基金参与安信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 17 日
12	东方基金关于开展直销中心基金转换申购补差费用优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 23 日
13	关于东方基金在直销中心（含网上交易）开展部分基金赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 24 日
14	东方基金管理股份有限公司上海分公司迁址公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 26 日
15	东方互联网嘉混合型证券投资基金 2020 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 26 日
16	东方基金管理股份有限公司关于对旗下基金持有的债券调整估值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 27 日
17	关于旗下部分基金继续参与中国银行部分渠道申购费率和全渠道定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
18	东方互联网嘉混合型证券投资基金基金合同(2021 年 4 月修订)	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
19	东方互联网嘉混合型证券投资基金托管协议(2021 年 4 月修订)	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日

20	东方基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告（二）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
21	关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务并参与定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 1 日
22	东方互联网嘉混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 2 日
23	东方互联网嘉混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021 年第 1 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 2 日
24	关于增加中国中金财富证券有限公司为旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 9 日
25	东方互联网嘉混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
26	关于增加上海爱建基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 13 日
27	关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 17 日
28	东方互联网嘉混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2021 年第 2 号）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 20 日
29	东方互联网嘉混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 20 日
30	关于旗下部分基金参与吉林银行基金申购及定投手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 28 日

		露网站	
31	关于增加展恒为东方基金旗下部分产品的销售机构同时开通定期定额投资、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 22 日
32	关于旗下部分基金继续参与交通银行基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 29 日
33	关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 29 日
34	关于旗下部分基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品	1	20210101 - 20210209	45,216,662.56	-	20,000,000.00	25,216,662.56	17.78%
产品	2	20210101 - 20210630	38,499,826.62	-	-	38,499,826.62	27.15%
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、《东方互联网嘉混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方互联网嘉混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2021 年 8 月 26 日