

# 东方创新科技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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>62</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	66
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>70</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.....	70

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>71</b>
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方创新科技混合型证券投资基金
基金简称	东方创新科技混合
基金主代码	001702
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 8 日
基金管理人	东方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	729,326,794.42 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	本基金结合自上而下和自下而上的分析，在大类资产配置基础上精选个股，严格控制投资风险，追求基金的长期、稳定增值。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	李申
	联系电话	010-66295888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	021-60637111
传真		010-66578700	021-60635778
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		崔伟	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	-79,564,077.61
本期利润	70,239,177.94
加权平均基金份额本期利润	0.0952
本期加权平均净值利润率	4.49%
本期基金份额净值增长率	7.93%
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	318,515,868.57
期末可供分配基金份额利润	0.4367
期末基金资产净值	1,735,241,567.68
期末基金份额净值	2.3792
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	137.92%

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

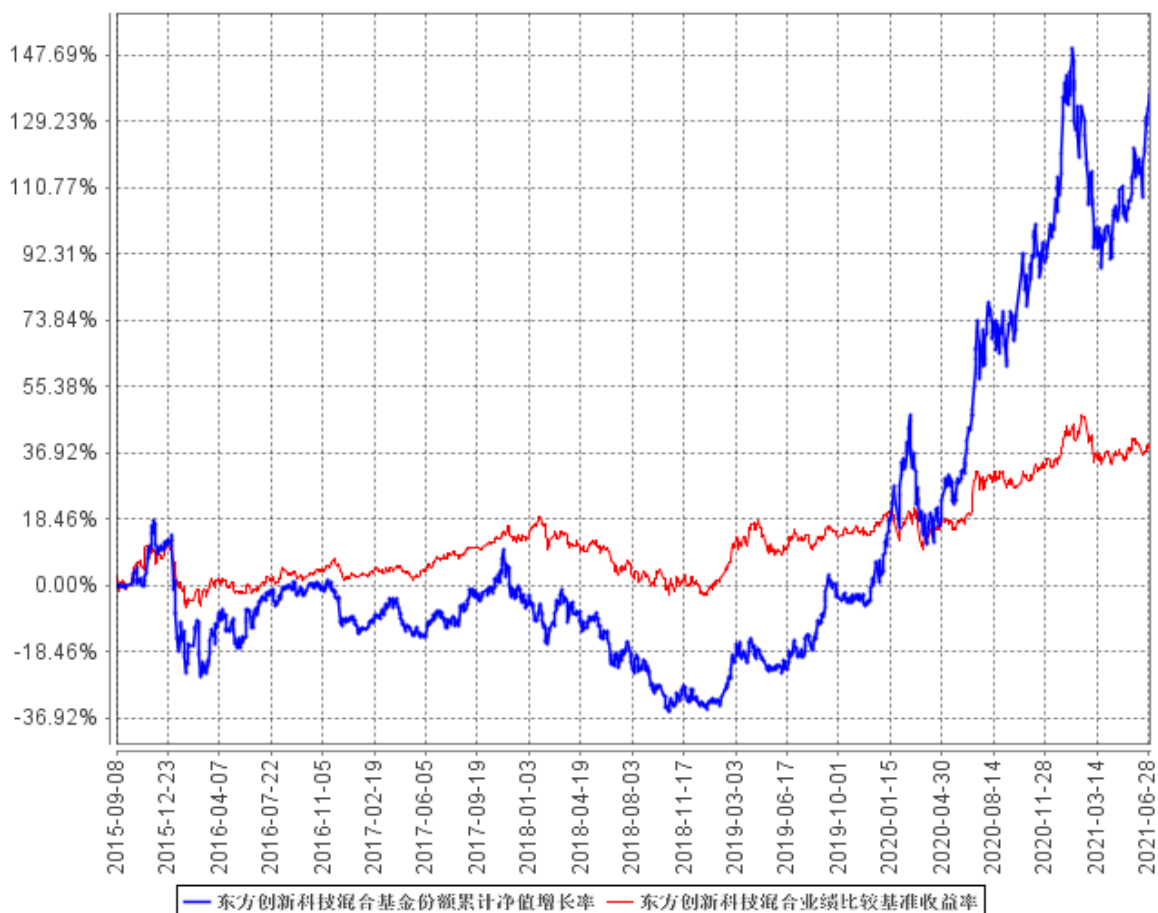
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.41%	1.76%	-1.26%	0.48%	8.67%	1.28%
过去三个月	21.25%	1.54%	2.33%	0.59%	18.92%	0.95%
过去六个月	7.93%	1.91%	0.49%	0.79%	7.44%	1.12%
过去一年	61.29%	1.97%	14.85%	0.79%	46.44%	1.18%
过去三年	193.87%	1.80%	31.34%	0.81%	162.53%	0.99%
自基金合同生效起至今	137.92%	1.72%	38.87%	0.77%	99.05%	0.95%



### 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

东方创新科技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		
蒋茜（先生）	本基金基金经理、权益投资部总经理、公募投资决策委员会委员	2019 年 8 月 29 日	-	11 年	权益投资部总经理，公募投资决策委员会委员。清华大学工商管理硕士，11 年证券从业经历。曾任 GCW Consulting 高级分析师、中信证券高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司投资总监。2017 年 5 月加盟本基金管理人，曾任研究部总经理，东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理，现任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
陈皓（先生）	本基金基金经理助理	2021 年 4 月 8 日	-	5 年	清华大学机械工程专业硕士，5 年证券从业经历。曾任东兴证券股份有限公司研究员、新时代证券股份有限公司分析师。2019 年 10 月加盟本基金管理人，曾任权益研究部研究

					员。现任东方创新科技混合型证券投资基金基金经理助理、东方新能源汽车主题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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方创新科技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中的公平交易程序；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的同向交易价差、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，未直接或通过与第三

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，市场整体表现尚可。除上证 50 外，主要指数在报告期内都出现不同程度的上涨，其中创业板的上涨幅度最大。从申万一级行业涨跌幅的分布来看，行业行情分化严重，其中电气设备、电子和汽车等板块表现较好，行业指数涨幅较大；但家用电器、农林牧渔和房地产等板块跌幅较大。报告期内，本基金继续聚焦在科技和制造两个方向，在相关领域寻找优质公司，力争获取长期回报。报告期内，本基金重点对消费电子、军工等板块的部分公司进行了减持，增加了安防、半导体和汽车等行业优质个股的配置比例。

#### 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 7.93%，业绩比较基准收益率为 0.49%，高于业绩比较基准 7.44%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于受到第四波疫情阶段性的冲击，海外经济的复苏进程预计将有所放缓，但是经济仍然以复苏为主基调，这将为下半年国内经济提供非常重要的支撑。展望下半年，国内经济预计将保持韧性，因此上市公司的盈利端预计将保持在较好的水平。尽管央行通过降准释放了流动性，我们理解很大程度上是一种风险预防性的措施，因此我们倾向于金融市场的流动性很难大幅度宽松。

因此，展望下半年，国内资本市场处于一个相对较为友好的政策和经济组合阶段，预计下半年国内资本市场的表现不会太差，尽管中间可能因为一些政策或者海外因素的扰动出现短暂的回调，但不会改变全年震荡上行的格局。结构上，我们继续看好科技和制造板块的硬科技产业周期。随着 5G 网络逐步完善，新一轮科技周期刚刚开始。以 5G 建设为先导，智能化、大数据、物联网已经逐步呈现。未来自主可控、智能硬件、信息服务等都将逐步展开。上游电子制造、软件服务、半导体、人工智能、智能驾驶、云计算和智能物联等方向将会有较好的投资机会。从中长期角度来看，新能源汽车具备巨大的成长性和确定性，电动化、智能化、网联化成为不可逆的产业趋势，国内制造业强大的降本能力在进一步提高车型的竞争力的同时，继续分享电动车全球化趋势带来

的产业红利。

#### 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

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东方创新科技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	85,633,210.60	39,857,325.81
结算备付金		6,667,284.31	3,727,037.07
存出保证金		761,438.01	414,834.32
交易性金融资产	6.4.7.2	1,668,541,138.50	679,783,973.57
其中：股票投资		1,608,637,138.50	669,462,973.57
基金投资		-	-
债券投资		59,904,000.00	10,321,000.00
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		4,882,313.15	-
应收利息	6.4.7.5	154,621.59	130,485.31
应收股利		-	-
应收申购款		4,113,053.39	7,698,695.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,770,753,059.55	731,612,351.50
<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		-	-
应付证券清算款		1,934,963.06	9,169,165.57
应付赎回款		27,176,453.15	13,965,435.20
应付管理人报酬		2,093,281.85	857,225.17
应付托管费		348,880.29	142,870.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,656,095.16	2,251,723.80
应交税费		-	0.34

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	301,818.36	239,036.52
负债合计		35,511,491.87	26,625,457.44
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	729,326,794.42	319,823,980.88
未分配利润	6.4.7.10	1,005,914,773.26	385,162,913.18
所有者权益合计		1,735,241,567.68	704,986,894.06
负债和所有者权益总计		1,770,753,059.55	731,612,351.50

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.3792 元，基金份额总额 729,326,794.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方创新科技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>		97,048,887.49	42,167,288.17
1.利息收入		527,445.48	119,333.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	235,740.94	38,587.22
债券利息收入		291,704.54	80,746.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-59,374,099.80	5,816,176.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-62,057,191.56	5,227,879.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	213,313.23	-26,662.45
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	2,469,778.53	614,959.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	149,803,255.55	34,674,612.86
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	6,092,286.26	1,557,164.85
<b>减：二、费用</b>		26,809,709.55	3,205,019.28

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,636,973.37	1,226,148.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,939,495.52	204,358.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	13,116,796.97	1,712,729.76
5. 利息支出		-	429.57
其中：卖出回购金融资产支出		-	429.57
6. 税金及附加		0.12	-
7. 其他费用	6.4.7.20	116,443.57	61,353.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		70,239,177.94	38,962,268.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		70,239,177.94	38,962,268.89

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方创新科技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）	319,823,980.88	385,162,913.18	704,986,894.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,239,177.94	70,239,177.94
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）	409,502,813.54	550,512,682.14	960,015,495.68
其中：1.基金申购款	917,242,671.24	1,185,969,117.52	2,103,211,788.76
2.基金赎回款	-507,739,857.70	-635,456,435.38	-1,143,196,293.08
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）	729,326,794.42	1,005,914,773.26	1,735,241,567.68

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)	44,866,463.20	1,702,323.86	46,568,787.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,962,268.89	38,962,268.89
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)	103,538,959.41	29,841,040.64	133,380,000.05
其中：1.基金申购款	323,417,870.13	94,935,172.55	418,353,042.68
2.基金赎回款	-219,878,910.72	-65,094,131.91	-284,973,042.63
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)	148,405,422.61	70,505,633.39	218,911,056.00

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

东方创新科技混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 7 月 7 日中国证监会《关于准予东方创新科技混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]1533 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《东方创新科技混合型证券投资基金基金合同》自 2015 年 8 月 6 日至 2015 年 9 月 2 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 223,128,706.98 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2015]第 01300061 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方创新科技混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 9 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 223,239,423.25 份基金单位，其中认购资金利息折合

110,716.27 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方创新科技混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以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	85,633,210.60
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：	85,633,210.60

##### 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	1,350,488,834.65	1,608,637,138.50	258,148,303.85	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	59,974,200.00	59,904,000.00	-70,200.00
	合计	59,974,200.00	59,904,000.00	-70,200.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,410,463,034.65	1,668,541,138.50	258,078,103.85	

### 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	8,232.11
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	3,000.30
应收债券利息	143,046.58
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	342.60
合计	154,621.59

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	3,654,770.16
银行间市场应付交易费用	1,325.00
合计	3,656,095.16



### 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	30,537.91
应付证券出借违约金	-
预提费用	271,280.45
合计	301,818.36

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和债券账户维护费。

### 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	319,823,980.88	319,823,980.88
本期申购	917,242,671.24	917,242,671.24
本期赎回(以“-”号填列)	-507,739,857.70	-507,739,857.70
- 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	729,326,794.42	729,326,794.42

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	167,735,828.97	217,427,084.21	385,162,913.18
本期利润	-79,564,077.61	149,803,255.55	70,239,177.94
本期基金份额交易产生的变动数	230,344,117.21	320,168,564.93	550,512,682.14
其中：基金申购款	474,860,321.84	711,108,795.68	1,185,969,117.52
基金赎回款	-244,516,204.63	-390,940,230.75	-635,456,435.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	318,515,868.57	687,398,904.69	1,005,914,773.26

**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	167,932.78
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	62,169.40
其他	5,638.76
合计	235,740.94

注：其他包括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	4,022,656,395.44
减：卖出股票成本总额	4,084,713,587.00
买卖股票差价收入	-62,057,191.56

**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	213,313.23
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	213,313.23

**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	121,028,168.26

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	120,277,760.00
减：应收利息总额	537,095.03
买卖债券差价收入	213,313.23

#### 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	2,469,778.53
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	2,469,778.53

#### 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	149,803,255.55
——股票投资	149,805,995.55
——债券投资	-2,740.00
——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	149,803,255.55

#### 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	6,011,149.48
基金转换费收入	81,136.78
合计	6,092,286.26

#### 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	13,115,021.97
银行间市场交易费用	1,775.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	13,116,796.97

#### 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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券账户维护费	9,000.00
银行汇划费用	20,663.12
合计	116,443.57

## 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
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
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
中国建设银行股份有限公司	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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
东北证券股份有限公司	1,643,405,427.13	18.50%	306,357,582.37	26.46%

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	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
东北证券股份有限公司	1,530,511.06	18.50%	786,963.71	21.53%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券股份有限公司	285,311.75	26.46%	225,628.24	36.28%

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，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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	11,636,973.37
其中：支付销售机构的客户维护费	5,210,548.20	485,188.77

注：①计提标准：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 1.5%

其中：H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基

金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 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	1,939,495.52	204,358.15

注：①计提标准：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

本基金年托管费率为 0.25%

其中：H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 9 月 8 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	1,559,374.75	1,559,374.75
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	1,559,374.75	1,559,374.75
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.21%	1.05%

注：上述关联方投资本基金时，按照本基金基金合同、招募说明书约定的费率标准收取相应的手续费，并履行了信息披露义务。

##### 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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		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
中国建设银行股份有限公司	85,633,210.60	167,932.78	9,857,547.68	31,067.16

#### 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，本基金本报告期末进行利润分



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
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	2,149	83,488.65	83,488.65	-
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	-
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	2,469	54,219.24	54,219.24	-
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	2021 年	2021	新股	2.65	5.90	907,763	2,405,571.95	5,355,801.70	-

	能源	6月2日	年12月10日	锁定限售						
688538	和辉光电	2021年5月20日	2021年11月29日	科创板限售	2.65	3.66	375,156	994,163.40	1,373,070.96	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年7月7日	科创板限售	74.46	372.52	1,673	124,571.58	623,225.96	-
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	科创板限售	36.35	99.68	3,486	126,716.10	347,484.48	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	创业板限售	47.33	252.43	853	40,372.49	215,322.79	-
688667	菱电电控	2021年3月3日	2021年9月13日	科创板限售	75.42	103.82	1,191	89,825.22	123,649.62	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	创业板限售	33.22	105.33	925	30,728.50	97,430.25	-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	科创板限售	50.05	72.11	1,301	65,115.05	93,815.11	-
688633	星球石墨	2021年3月17日	2021年9月24日	科创板限售	33.62	53.12	1,558	52,379.96	82,760.96	-
688217	睿昂基因	2021年5月7日	2021年11月17日	科创板限售	18.42	78.01	1,040	19,156.80	81,130.40	-
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	601	29,202.59	63,874.28	-
688328	深科	2021年	2021	科创	16.49	37.78	1,499	24,718.51	56,632.22	-

	达	3月1日	年9月9日	板限售						
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	360	10,180.80	52,232.40	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	科创板限售	14.71	29.48	1,259	18,519.89	37,115.32	-
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	-
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	240	6,904.80	23,930.40	-
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	399	8,502.69	19,914.09	-
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	1,162	7,982.94	17,406.76	-
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	-
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	928	4,584.32	16,017.28	-
300932	三友	2021年	2021	创业	24.69	31.70	492	12,147.48	15,596.40	-

	联众	1月15日	年7月22日	板限售						
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	-
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	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	创业板限售	3.40	22.13	576	1,958.40	12,746.88	-
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	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	创业板限售	16.53	46.05	232	3,834.96	10,683.60	-
300987	川网	2021年	2021	创业	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-

	传媒	4月28日	年11月11日	板限售							
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	-	
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	创业板限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-	
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	2021年	2021	创业	5.48	17.07	492	2,696.16	8,398.44	-	

	电子	4月14日	年10月21日	板限售						
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	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	创业板限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
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	295	7,345.50	8,050.55	-
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	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	创业板限售	12.13	27.74	283	3,432.79	7,850.42	-
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	2021年	2021	创业	6.02	28.50	201	1,210.02	5,728.50	-

	方正	5月25日	2021年12月2日	板限售						
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21日	创业板限售	13.87	29.53	183	2,538.21	5,403.99	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	创业板限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
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	-

注：流通受限证券可流通日以上上市公司公告为准。

#### 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	338,000.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	338,000.00

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	85,633,210.60	-	-	-	85,633,210.60
结算备付金	6,667,284.31	-	-	-	6,667,284.31
存出保证金	761,438.01	-	-	-	761,438.01
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	1,608,637,138.50	1,608,637,138.50
交易性金融资产-债券投资	59,904,000.00	0.00	0.00	-	59,904,000.00
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	-	-	-	4,882,313.15	4,882,313.15
应收利息	-	-	-	154,621.59	154,621.59
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	4,113,053.39	4,113,053.39
资产总计	152,965,932.92	0.00	0.00	1,617,787,126.63	1,770,753,059.55
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	27,176,453.15	27,176,453.15
应付管理人报酬	-	-	-	2,093,281.85	2,093,281.85
应付托管费	-	-	-	348,880.29	348,880.29
应付交易费用	-	-	-	3,656,095.16	3,656,095.16

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	-	-	-	301,818.36	301,818.36
应付证券清算款	-	-	-	1,934,963.06	1,934,963.06
负债总计	0.00	0.00	0.00	35,511,491.87	35,511,491.87
利率敏感度缺口	152,965,932.92	0.00	0.00	1,582,275,634.76	1,735,241,567.68
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	39,857,325.81	-	-	-	39,857,325.81
结算备付金	3,727,037.07	-	-	-	3,727,037.07
存出保证金	414,834.32	-	-	-	414,834.32
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	669,462,973.57	669,462,973.57
交易性金融资产-债券投资	9,983,000.00	0.00	338,000.00	-	10,321,000.00
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	-	-	-	130,485.31	130,485.31
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	7,698,695.42	7,698,695.42
资产总计	53,982,197.20	0.00	338,000.00	677,292,154.30	731,612,351.50
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	13,965,435.20	13,965,435.20
应付管理人报酬	-	-	-	857,225.17	857,225.17
应付托管费	-	-	-	142,870.84	142,870.84
应付交易费用	-	-	-	2,251,723.80	2,251,723.80
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	239,036.52	239,036.52
应付证券清算款	-	-	-	9,169,165.57	9,169,165.57
负债总计	0.00	0.00	0.00	26,625,457.44	26,625,457.44
利率敏感度缺口	53,982,197.20	0.00	338,000.00	650,666,696.86	704,986,894.06

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%	131,629.43	5,714.00
市场利率上调 0.25%	-131,629.43	-6,390.00	

#### 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	1,608,637,138.50	92.70	669,462,973.57	94.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	59,904,000.00	3.45	10,321,000.00	1.46
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	1,668,541,138.50	96.16	679,783,973.57	96.43

##### 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%	-85,766,201.79	-40,071,155.92
	沪深 300 指数上涨 5%	85,766,201.79	40,071,155.92

#### 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 52,211,445.68 元，占基金资产净值比例为 3.01%；上年度末本基金风险价值为 21,479,372.99 元，占基金资产净值比例为 3.05%。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止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	1,608,637,138.50	90.84
	其中：股票	1,608,637,138.50	90.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,904,000.00	3.38
	其中：债券	59,904,000.00	3.38
	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	92,300,494.91	5.21
8	其他各项资产	9,911,426.14	0.56
9	合计	1,770,753,059.55	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	14,743.38	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,355,584,846.51	78.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,368,822.09	0.31
E	建筑业	27,168.76	0.00
F	批发和零售业	55,758.08	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	51,220,000.00	2.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,748,616.96	4.31
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	36,510,000.00	2.10
M	科学研究和技术服务业	52,960,000.00	3.05
N	水利、环境和公共设施管理业	47,461.62	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	32,065,000.00	1.85
S	综合	-	-
	合计	1,608,637,138.50	92.70

### 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	603501	韦尔股份	450,000	144,900,000.00	8.35
2	002415	海康威视	2,050,000	132,225,000.00	7.62
3	002460	赣锋锂业	1,008,400	122,107,156.00	7.04
4	300750	宁德时代	223,400	119,474,320.00	6.89
5	300382	斯莱克	7,000,000	104,790,000.00	6.04
6	002129	中环股份	2,620,000	101,132,000.00	5.83
7	002371	北方华创	350,000	97,083,000.00	5.59
8	000625	长安汽车	3,000,000	78,840,000.00	4.54
9	600570	恒生电子	800,000	74,600,000.00	4.30
10	688665	四方光电	500,030	68,079,084.50	3.92
11	002466	天齐锂业	1,000,000	62,020,000.00	3.57
12	300825	阿尔特	2,000,000	52,960,000.00	3.05
13	601238	广汽集团	3,999,943	51,799,261.85	2.99
14	002245	蔚蓝锂芯	2,600,000	51,220,000.00	2.95
15	300680	隆盛科技	1,680,000	44,940,000.00	2.59
16	603068	博通集成	500,000	41,150,000.00	2.37
17	603348	文灿股份	1,155,000	40,425,000.00	2.33
18	002738	中矿资源	900,000	39,960,000.00	2.30
19	002497	雅化集团	1,746,000	39,773,880.00	2.29
20	300280	紫天科技	1,000,000	36,510,000.00	2.10
21	300772	运达股份	2,000,000	36,420,000.00	2.10
22	600136	当代文体	5,300,000	32,065,000.00	1.85
23	300258	精锻科技	600,000	8,022,000.00	0.46
24	600905	三峡能源	907,763	5,355,801.70	0.31
25	688208	道通科技	40,000	3,479,600.00	0.20
26	300035	中科电气	69,500	1,699,275.00	0.10
27	688598	金博股份	6,100	1,640,900.00	0.09
28	688538	和辉光电	375,156	1,373,070.96	0.08



29	601012	隆基股份	14,420	1,281,072.80	0.07
30	688005	容百科技	10,200	1,236,240.00	0.07
31	300014	亿纬锂能	11,500	1,195,195.00	0.07
32	300124	汇川技术	15,600	1,158,456.00	0.07
33	002179	中航光电	13,000	1,027,260.00	0.06
34	002706	良信股份	44,900	1,012,046.00	0.06
35	601100	恒立液压	11,000	945,120.00	0.05
36	600438	通威股份	20,000	865,400.00	0.05
37	600031	三一重工	29,500	857,565.00	0.05
38	002459	晶澳科技	13,000	637,000.00	0.04
39	688617	惠泰医疗	1,673	623,225.96	0.04
40	603583	捷昌驱动	10,980	555,807.60	0.03
41	300724	捷佳伟创	4,000	464,040.00	0.03
42	300763	锦浪科技	2,550	460,530.00	0.03
43	688276	百克生物	3,486	347,484.48	0.02
44	300957	贝泰妮	853	215,322.79	0.01
45	688667	菱电电控	1,191	123,649.62	0.01
46	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
47	300979	华利集团	925	97,430.25	0.01
48	688109	品茗股份	1,301	93,815.11	0.01
49	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
50	688633	星球石墨	1,558	82,760.96	0.00
51	688217	睿昂基因	1,040	81,130.40	0.00
52	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
53	300981	中红医疗	601	63,874.28	0.00
54	688328	深科达	1,499	56,632.22	0.00
55	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
56	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
57	300973	立高食品	360	52,232.40	0.00
58	688067	爱威科技	1,259	37,115.32	0.00
59	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
60	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
61	301015	百洋医药	462	25,322.22	0.00
62	300953	震裕科技	240	23,930.40	0.00
63	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
64	300941	创识科技	399	19,914.09	0.00
65	300968	格林精密	1,162	17,406.76	0.00
66	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
67	301013	利和兴	471	16,640.43	0.00

68	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.00
69	300982	苏文电能	317	16,154.32	0.00
70	300997	欢乐家	928	16,017.28	0.00
71	300932	三友联众	492	15,596.40	0.00
72	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.00
73	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
74	300940	南极光	307	13,308.45	0.00
75	300937	药易购	244	13,093.04	0.00
76	300962	中金辐照	576	12,746.88	0.00
77	300942	易瑞生物	443	12,621.07	0.00
78	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
79	300996	普联软件	241	12,194.60	0.00
80	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
81	301016	雷尔伟	275	11,294.25	0.00
82	300966	共同药业	286	11,231.22	0.00
83	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
84	300955	嘉亨家化	232	10,683.60	0.00
85	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.00
86	300978	东箭科技	593	9,944.61	0.00
87	300986	志特新材	264	9,831.36	0.00
88	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.00
89	301004	嘉益股份	312	9,029.28	0.00
90	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.00
91	300948	冠中生态	324	8,874.36	0.00
92	300931	通用电梯	672	8,803.20	0.00
93	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
94	300991	创益通	254	8,671.56	0.00
95	300950	德固特	219	8,567.28	0.00
96	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
97	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
98	300971	博亚精工	245	8,175.65	0.00
99	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
100	300985	致远新能	295	8,050.55	0.00
101	300926	博俊科技	359	7,955.44	0.00
102	300963	中洲特材	283	7,850.42	0.00
103	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
104	300972	万辰生物	430	6,966.00	0.00
105	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
106	300943	春晖智控	255	5,865.00	0.00

107	301007	德迈仕	303	5,793.36	0.00
108	300998	宁波方正	201	5,728.50	0.00
109	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
110	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.00
111	300929	华骐环保	183	5,403.99	0.00
112	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
113	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.00
114	301010	晶雪节能	218	4,931.16	0.00
115	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	600570	恒生电子	149,768,398.88	21.24
2	300750	宁德时代	142,359,266.40	20.19
3	002415	海康威视	131,688,364.81	18.68
4	000625	长安汽车	116,381,229.22	16.51
5	002371	北方华创	113,357,807.25	16.08
6	300280	紫天科技	111,153,486.00	15.77
7	002466	天齐锂业	101,476,104.40	14.39
8	002460	赣锋锂业	100,750,384.16	14.29
9	603501	韦尔股份	92,164,745.71	13.07
10	002475	立讯精密	86,198,586.54	12.23
11	000725	京东方 A	85,115,473.00	12.07
12	300382	斯莱克	84,742,870.37	12.02
13	002129	中环股份	78,649,601.44	11.16
14	600031	三一重工	76,408,709.06	10.84
15	002738	中矿资源	72,314,626.72	10.26
16	600703	三安光电	71,946,007.80	10.21
17	300680	隆盛科技	70,737,966.78	10.03
18	603068	博通集成	70,109,057.81	9.94
19	300014	亿纬锂能	67,434,429.56	9.57
20	688665	四方光电	66,144,418.42	9.38
21	000063	中兴通讯	65,381,102.42	9.27

22	600745	闻泰科技	64,033,575.64	9.08
23	600136	当代文体	60,872,612.16	8.63
24	000550	江铃汽车	59,060,872.04	8.38
25	300825	阿尔特	56,911,764.75	8.07
26	603678	火炬电子	56,899,066.53	8.07
27	002456	欧菲光	53,683,089.09	7.61
28	600166	福田汽车	52,263,027.00	7.41
29	002402	和而泰	51,800,197.34	7.35
30	601238	广汽集团	50,193,631.60	7.12
31	603799	华友钴业	50,062,269.58	7.10
32	002497	雅化集团	48,701,105.13	6.91
33	688111	金山办公	48,653,019.01	6.90
34	600006	东风汽车	48,469,655.00	6.88
35	002074	国轩高科	48,047,839.08	6.82
36	300772	运达股份	47,296,785.00	6.71
37	002099	海翔药业	46,770,779.55	6.63
38	600460	士兰微	46,265,073.83	6.56
39	601012	隆基股份	46,027,460.40	6.53
40	300059	东方财富	44,963,672.81	6.38
41	300408	三环集团	44,549,850.88	6.32
42	002595	豪迈科技	42,492,522.37	6.03
43	300083	创世纪	42,324,575.95	6.00
44	300751	迈为股份	41,438,776.20	5.88
45	300035	中科电气	41,279,982.03	5.86
46	000155	川能动力	41,171,460.78	5.84
47	600699	均胜电子	40,457,228.64	5.74
48	688567	孚能科技	40,314,525.36	5.72
49	002430	杭氧股份	40,052,828.47	5.68
50	002240	盛新锂能	39,525,559.60	5.61
51	000977	浪潮信息	39,034,496.29	5.54
52	000762	西藏矿业	38,523,517.44	5.46
53	002636	金安国纪	38,164,615.00	5.41
54	300487	蓝晓科技	36,381,080.75	5.16
55	002610	爱康科技	36,317,453.00	5.15
56	002245	蔚蓝锂芯	36,283,641.82	5.15
57	600499	科达制造	36,026,082.00	5.11

58	603348	文灿股份	35,527,208.33	5.04
59	002405	四维图新	34,624,592.02	4.91
60	688599	天合光能	33,956,395.33	4.82
61	002192	融捷股份	33,915,513.97	4.81
62	600316	洪都航空	33,625,361.75	4.77
63	600418	江淮汽车	33,538,619.27	4.76
64	002709	天赐材料	32,734,395.38	4.64
65	300496	中科创达	32,319,347.20	4.58
66	002594	比亚迪	31,252,224.72	4.43
67	300454	深信服	30,649,676.00	4.35
68	002756	永兴材料	28,510,172.50	4.04
69	300331	苏大维格	27,109,462.20	3.85
70	688116	天奈科技	26,721,127.73	3.79
71	300383	光环新网	25,908,782.30	3.68
72	002013	中航机电	25,391,775.64	3.60
73	002859	洁美科技	23,972,074.08	3.40
74	002444	巨星科技	23,506,909.51	3.33
75	002409	雅克科技	23,442,664.48	3.33
76	002555	三七互娱	23,050,952.63	3.27
77	002179	中航光电	22,977,461.00	3.26
78	603444	吉比特	22,927,091.00	3.25
79	688012	中微公司	22,902,060.55	3.25
80	300782	卓胜微	22,556,200.01	3.20
81	300316	晶盛机电	22,310,985.96	3.16
82	300920	润阳科技	20,371,677.71	2.89
83	603993	洛阳钼业	20,311,395.79	2.88
84	603076	乐惠国际	20,201,211.75	2.87
85	601808	中海油服	19,181,467.21	2.72
86	600323	瀚蓝环境	18,813,552.46	2.67
87	300776	帝尔激光	18,742,264.55	2.66
88	300775	三角防务	18,357,138.30	2.60
89	002353	杰瑞股份	18,051,197.49	2.56
90	002085	万丰奥威	17,772,347.00	2.52
91	603986	兆易创新	17,350,221.33	2.46
92	002624	完美世界	17,329,594.50	2.46
93	002436	兴森科技	17,034,592.90	2.42

94	000733	振华科技	16,740,523.01	2.37
95	688667	菱电电控	16,467,586.06	2.34
96	300567	精测电子	15,126,947.48	2.15
97	002049	紫光国微	14,628,776.71	2.08
98	300323	华灿光电	14,530,351.00	2.06
99	002959	小熊电器	14,406,833.77	2.04

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	300750	宁德时代	111,763,986.32	15.85
2	000725	京东方 A	107,394,943.40	15.23
3	002475	立讯精密	92,652,090.93	13.14
4	603678	火炬电子	84,504,018.11	11.99
5	600703	三安光电	83,321,080.56	11.82
6	601012	隆基股份	80,508,528.90	11.42
7	600745	闻泰科技	76,238,638.78	10.81
8	300014	亿纬锂能	75,885,371.73	10.76
9	600570	恒生电子	75,796,541.24	10.75
10	002466	天齐锂业	72,376,486.59	10.27
11	688111	金山办公	71,991,561.61	10.21
12	000063	中兴通讯	67,618,392.90	9.59
13	600031	三一重工	66,953,544.10	9.50
14	000550	江铃汽车	64,359,969.36	9.13
15	600460	士兰微	59,157,692.41	8.39
16	002402	和而泰	58,199,908.86	8.26
17	002371	北方华创	52,778,593.35	7.49
18	600499	科达制造	52,132,440.18	7.39
19	600166	福田汽车	51,970,582.66	7.37
20	002179	中航光电	51,187,769.31	7.26
21	002456	欧菲光	50,707,267.30	7.19
22	300751	迈为股份	48,714,879.80	6.91
23	002074	国轩高科	48,065,191.39	6.82

24	002460	赣锋锂业	47,690,362.74	6.76
25	300059	东方财富	47,176,472.69	6.69
26	603799	华友钴业	45,758,814.94	6.49
27	300408	三环集团	45,066,665.86	6.39
28	300280	紫天科技	44,695,456.69	6.34
29	002099	海翔药业	44,674,188.00	6.34
30	002430	杭氧股份	44,260,826.28	6.28
31	002738	中矿资源	43,667,548.90	6.19
32	002610	爱康科技	43,089,790.80	6.11
33	002240	盛新锂能	42,756,641.89	6.06
34	600006	东风汽车	42,528,237.00	6.03
35	002595	豪迈科技	41,387,747.11	5.87
36	002444	巨星科技	41,235,040.30	5.85
37	000155	川能动力	39,539,236.79	5.61
38	000762	西藏矿业	38,455,094.47	5.45
39	300487	蓝晓科技	38,013,059.09	5.39
40	000625	长安汽车	37,339,667.34	5.30
41	300680	隆盛科技	36,662,107.64	5.20
42	600884	杉杉股份	36,594,631.02	5.19
43	002409	雅克科技	36,441,803.92	5.17
44	300035	中科电气	36,018,670.74	5.11
45	600316	洪都航空	35,469,490.78	5.03
46	002192	融捷股份	33,987,483.00	4.82
47	688396	华润微	33,920,359.79	4.81
48	300083	创世纪	33,748,466.94	4.79
49	002636	金安国纪	33,506,293.91	4.75
50	600699	均胜电子	33,414,490.28	4.74
51	000977	浪潮信息	33,095,369.16	4.69
52	688567	孚能科技	32,805,547.59	4.65
53	002405	四维图新	32,697,727.72	4.64
54	600418	江淮汽车	32,419,642.66	4.60
55	002555	三七互娱	32,265,316.23	4.58
56	300454	深信服	32,227,873.10	4.57
57	002709	天赐材料	30,415,909.42	4.31
58	002756	永兴材料	30,338,586.71	4.30
59	300382	斯莱克	30,288,765.54	4.30
60	603068	博通集成	29,386,915.00	4.17
61	688599	天合光能	28,753,061.86	4.08

62	300496	中科创达	28,174,861.14	4.00
63	600136	当代文体	27,917,870.49	3.96
64	688008	澜起科技	26,544,242.05	3.77
65	002594	比亚迪	26,502,220.00	3.76
66	300383	光环新网	26,343,083.00	3.74
67	002049	紫光国微	26,198,837.33	3.72
68	688116	天奈科技	25,387,468.60	3.60
69	300782	卓胜微	25,360,585.35	3.60
70	002013	中航机电	24,091,391.71	3.42
71	000066	中国长城	23,607,574.34	3.35
72	688200	华峰测控	23,327,987.22	3.31
73	603444	吉比特	23,276,055.56	3.30
74	300331	苏大维格	21,995,208.00	3.12
75	002859	洁美科技	21,673,463.06	3.07
76	002415	海康威视	21,627,591.89	3.07
77	300316	晶盛机电	21,207,156.40	3.01
78	688012	中微公司	20,814,551.32	2.95
79	603076	乐惠国际	19,706,525.15	2.80
80	002353	杰瑞股份	19,550,272.48	2.77
81	300772	运达股份	19,082,563.00	2.71
82	603993	洛阳钼业	19,019,830.16	2.70
83	600323	瀚蓝环境	18,919,451.20	2.68
84	300920	润阳科技	17,672,192.25	2.51
85	601808	中海油服	17,592,403.55	2.50
86	002624	完美世界	17,315,981.00	2.46
87	002085	万丰奥威	17,163,263.00	2.43
88	603986	兆易创新	17,081,171.48	2.42
89	002436	兴森科技	16,675,351.48	2.37
90	300776	帝尔激光	16,535,161.12	2.35
91	300567	精测电子	15,930,116.00	2.26
92	000733	振华科技	15,490,931.00	2.20
93	688667	菱电电控	15,463,223.22	2.19
94	300775	三角防务	15,390,272.82	2.18
95	300323	华灿光电	15,047,882.81	2.13

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	4,874,081,756.38
卖出股票收入（成交）总额	4,022,656,395.44

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

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,904,000.00	3.45
	其中：政策性金融债	59,904,000.00	3.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,904,000.00	3.45

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210404	21 农发 04	600,000	59,904,000.00	3.45
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 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

本基金所持有的斯莱克（300382）收到中国证监会江苏监管局行政监管措施决定书(2020)40号，违规类型为信息披露虚假或严重误导性陈述，未及时披露公司重大事项；公司收到深圳交易所公开批评，违规类型为信息披露虚假或严重误导性陈述，未及时披露公司重大事项。上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条和第三十六条规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条规定，我局决定对你公司采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。你公司及相关责任人应充分吸取教训，加强内部管理，依法履行信息披露义务。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的韦尔股份（603501）公司因业务违规受到上海证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施。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。

公司 2021 年 5 月 6 日公告关于收到中国证监会上海证监局警示函的公告，主要内容为：

“你公司（统一社会信用代码：9131000066244468X3）于 2019 年 1 月 17 日完成深圳市芯能投资有限公司（以下简称“芯能投资”）、深圳市芯力投资有限公司（以下简称“芯力投资”）100% 股权的收购，收购价款合计 16.87 亿元。其中，芯能投资、芯力投资主要资产分别为其持有的北京豪威科技有限公司 6.31% 股权、4.24% 股权。2019 年 7 月，你公司与兴业银行签订借款合同，借款金额为 10 亿元，借款期限为 2019 年 7 月 5 日至 2024 年 7 月 4 日，借款用途为用于支付（或置换）芯能投资和芯力投资 100% 股权的股权并购款。你公司以持有的芯能投资、芯力投资 100% 股权及芯能投资、芯力投资持有的北京豪威科技有限公司 10.55% 股权提供质押担保。上述质押资产的账面值约占最近一期经审计总资产 37%。你公司对于上述资产质押情况未及时在临时公告中披露，直至 2020 年 4 月 10 日才在 2019 年年度报告中披露。上海证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施。”

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。

本基金投资斯莱克主要基于以下原因：公司作为我国易拉罐设备的龙头，推出高效电池壳生产工艺，有望引领电池壳行业发展，未来将长期受益于新能源汽车产业的发展。

本基金投资韦尔股份主要基于以下原因：公司作为 cis 芯片行业龙头，客户在规模和质量方面均有较大优势，公司在 cis 业务方面有强大的护城河，业务结构和公司业绩相对稳定，创新能力突出，具备一定投资价值。

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	761,438.01
2	应收证券清算款	4,882,313.15
3	应收股利	-
4	应收利息	154,621.59
5	应收申购款	4,113,053.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,911,426.14

#### **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可转换债券。

#### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
54,717	13,329.07	42,655,905.65	5.85%	686,670,888.77	94.15%

### 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	200,141.26	0.03%

### 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（2015年9月8日）基金份额总额	223,239,423.25
本报告期期初基金份额总额	319,823,980.88
本报告期基金总申购份额	917,242,671.24
减：本报告期基金总赎回份额	507,739,857.70
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	729,326,794.42

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门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

本基金本报告期内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	
华西证券股份有限公司	2	4,940,233,877.22	55.61%	4,600,847.44	55.61%	-
华创证券有限责任公司	1	2,126,334,779.44	23.94%	1,980,283.74	23.94%	-
东北证券股份有限公司	2	1,643,405,427.13	18.50%	1,530,511.06	18.50%	-
安信证券股份有限公司	1	163,749,770.12	1.84%	152,500.57	1.84%	-
国盛证券有限责任公司	2	9,227,335.30	0.10%	8,593.44	0.10%	-
招商证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

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资金雄厚，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, 本基金新增租用 1 个交易单元, 为东兴证券股份有限公司上海交易所交易单元。

### 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
华西证券股份有限公司	583,056.20	100.00%	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
------------	---	---	---	---	---	---

## 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	东方创新科技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

		露网站	
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	东方创新科技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	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

19	东方创新科技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 4 月 9 日
20	东方创新科技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 4 月 9 日
21	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（三）	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
22	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
23	东方创新科技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 12 日
24	东方创新科技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 12 日
25	东方创新科技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	东方创新科技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 4 月 21 日
27	东方创新科技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 21 日
28	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
29	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
30	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	2021 年 6 月 22 日

		中国证监会基金电子披露网站	
31	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
32	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
33	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
34	关于增加西部证券股份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 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、《东方创新科技混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方创新科技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