东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金
2023年中期报告

2023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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2023年8月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 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

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 19

§7 投资组合报告 38

7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 42
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 43

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 43
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 43
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 43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.12 投资组合报告附注 43

§8 基金份额持有人信息 45

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 46

§9 开放式基金份额变动 46

§10 重大事件揭示 47

10.1 基金份额持有人大会决议 47
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
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 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
10.8 其他重大事件 51

§11 影响投资者决策的其他重要信息 52

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 52

§12 备查文件目录 52

12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 53
12.3 查阅方式 53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金	
基金简称	东方欣益一年持有期混合	
基金主代码	009937	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 月 2 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	185,121,653.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方欣益一年持有期混合 A	东方欣益一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	009937	009938
报告期末下属分级基金的份额总额	157,363,574.07 份	27,758,079.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险的基础上，争取为基金份额持有人谋求长期、稳健的投资回报。
投资策略	本基金根据资本市场实际情况对大类资产比例进行动态调整，以专业的研究分析为根本，挖掘市场中的投资机会，在严格控制投资风险的基础上，争取为基金份额持有人谋求长期、稳健的投资回报。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	韩笑微
	联系电话	010-66295888	010-68858113
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	hanxiaowei@psbcoa.com.cn
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95580
传真		010-66578700	010-68858120
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 3 号
办公地址		北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		100073	100808

法定代表人	崔伟	刘建军

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	http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com
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或办公场所

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	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	东方欣益一年持有期混合 A	东方欣益一年持有期混合 C
本期已实现收益	398,200.36	-3,996.66
本期利润	4,131,204.93	606,555.98
加权平均基金份额本期利润	0.0229	0.0195
本期加权平均净值利润率	2.44%	2.10%
本期基金份额净值增长率	2.17%	1.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-9,461,107.27	-2,038,124.56
期末可供分配基金份额利润	-0.0601	-0.0734
期末基金资产净值	147,902,466.80	25,719,954.59
期末基金份额净值	0.9399	0.9266
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

基金份额累计净值增长率	-1.42%	-2.80%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

东方欣益一年持有期混合 A

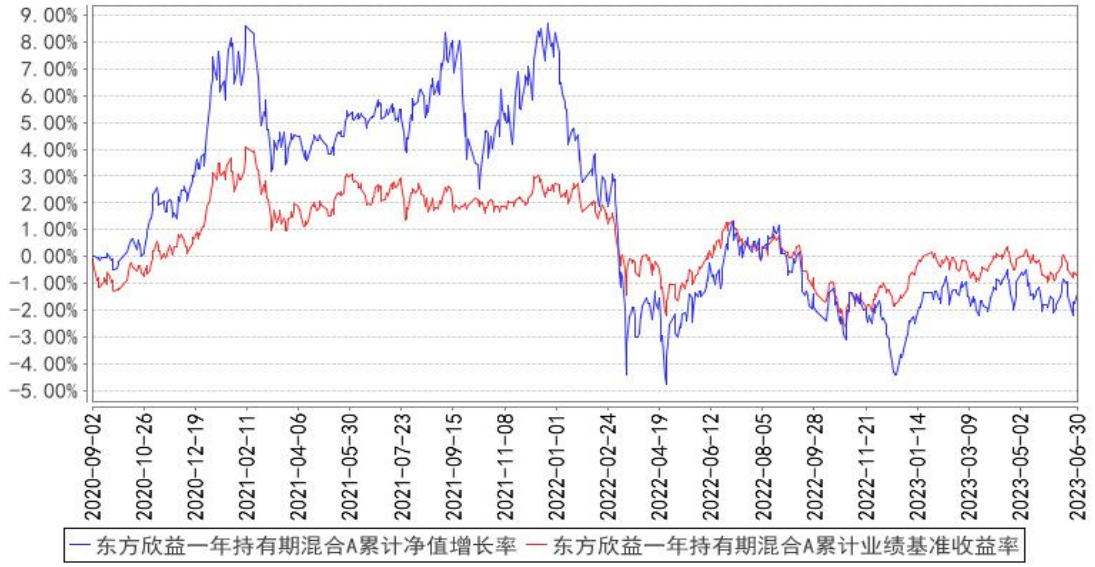
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.50%	0.31%	0.38%	0.17%	0.12%	0.14%
过去三个月	0.16%	0.27%	-0.28%	0.16%	0.44%	0.11%
过去六个月	2.17%	0.26%	0.89%	0.16%	1.28%	0.10%
过去一年	-2.07%	0.29%	-1.81%	0.19%	-0.26%	0.10%
自基金合同生效起至今	-1.42%	0.42%	-0.56%	0.23%	-0.86%	0.19%

东方欣益一年持有期混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.47%	0.31%	0.38%	0.17%	0.09%	0.14%
过去三个月	0.03%	0.27%	-0.28%	0.16%	0.31%	0.11%
过去六个月	1.91%	0.26%	0.89%	0.16%	1.02%	0.10%
过去一年	-2.56%	0.29%	-1.81%	0.19%	-0.75%	0.10%
自基金合同生效起至今	-2.80%	0.42%	-0.56%	0.23%	-2.24%	0.19%

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

东方欣益一年持有期混合A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



东方欣益一年持有期混合C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，于 2004 年 6 月 11 日成立。

截至 2023 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，持股比例 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 2023 年 6 月 30 日，本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长回报平衡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、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉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、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展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、东方睿鑫热点挖掘灵活配置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、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题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、东方新兴成长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、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选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、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方中证 500 指数增强型证券投

资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金。

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		
张博	本基金基金经理	2022 年 5 月 20 日	-	13 年	绝对收益部部门总经理助理，北京邮电大学电磁场与微波技术专业博士，13 年证券从业经历。曾任普天信息技术研究院有限公司产业研究员、渤海证券股份有限公司高级研究员、天安财产保险股份有限公司投资经理、中信保诚人寿股份有限公司股票部主管兼投资经理、金元顺安基金管理有限公司基金部投资副总监兼基金经理。2022 年 1 月加盟本基金管理人，现任东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理。
许文波	本基金基金经理、公司副总经理、权益投资总监、公募投资决策委员会副主任委员	2020 年 9 月 2 日	2023 年 2 月 23 日	22 年	公司副总经理、权益投资总监、公募投资决策委员会副主任委员。吉林大学工商管理硕士，22 年证券从业经历。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师；东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理；德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018 年 4 月加盟本基金管理人，曾任公司总经理助理，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方中国红利混合型证券投资基金基金经理、东方欣利混合型证券投资基金基金经理、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金经理，现任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方创新医疗股票型证券投资基金基金经理。

注：①2023 年 8 月 23 日，公司发布了《东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自 2023 年 8 月 23 日起张博先生担任东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

②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。

③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》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《东方欣益一年持有期偏债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

2023 年上半年市场出现结构分化，根据 WIND 数据显示，上证指数上涨 3.65%、深圳成指上涨 0.10%、创业板指下跌 5.61%、沪深 300 下跌 0.75%、中证 500 上涨 2.29%。分行业看，申万一级行业相对较强的前五行业是通信、传媒、计算机、机械设备、家用电器；相对落后的行业分别是商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料、综合。

报告期内，在各类资产的配置策略方面：债券配置以利率债和中短久期的较高等级信用债为主，结构上增加了利率债的配置占比；可转债投资占比相对稳定，保持谨慎策略，优先选择低价转债品种；股票投资方面，随着二季度市场回落，权益市场投资价值提升，我们适当提高了权益仓位。在权益配置方面，结构上继续坚持适度均衡的行业配置；股票选择上，保持对价格安全边际的考虑权重，并结合业绩确定性、成长空间和估值等因素筛选优质个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日,本基金 A 类净值增长率为 2.17%，业绩比较基准收益率为 0.89%，高于业绩比较基准 1.28%；本基金 C 类净值增长率为 1.91%，业绩比较基准收益率为 0.89%，高于业绩比较基准 1.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年市场经历了经济强复苏预期与弱复苏现实的再平衡过程，在这一过程中 A 股市场形成了一定的市场波动。从下半年国内经济增长看，内生性需求的恢复或是下半年经济主要的驱动力量，需求恢复的斜率则受到政策面的影响。在不考虑潜在促经济政策的背景下，需求恢复过程可能会相对缓慢。另一方面，结合政策面的表态和上半年相比较，出台相关政策的概率在边际改善。

从主要指数的预期估值水平和股债收益比所处的位置看，目前对于宏观经济的悲观预期正在体现到资产定价当中，A 股目前正在处于价值区间，具备长期投资价值。综合考虑，在企业盈利修复曲线斜率平缓背景下，A 股市场有较大可能会在震荡中实现估值中枢逐步上行。

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》、《资产管理产品相关会计处理规定》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”），成员包括公司总经理、分管运营高级管理人员、分管投研高级管理人员、督察长以及运营部负责人、投研部门指定负责人、合规法务部负责人、风险管理部负责人及总办会其他指定人员。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

负责召集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，由指定的副主任代理其行使召集职责。

2.运营部

（1）自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

（2）征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

（3）根据估值委员会会议决定的估值方法及估值模型而最终确认的具体投资品种公允价值与托管行协商一致后，对相应产品进行估值。

（4）负责编制相应产品持有的投资品种变更估值方法的相关公告，协调相关部门对外发布公告，并根据公告内容协助相关部门做好客户沟通。

（5）负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

3.投研部门

根据现行法律法规及各产品相关法律文件，适时评估各产品持有投资品种的现有估值政策及估值方法是否公允、适当；对估值方法有失公允性时，投研部门必要时可向运营部提交估值方法调整说明，由运营部提请估值委员会召集估值会议进行审议。

4.合规法务部、风险管理部：

在日常合规监控及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召集估值会议。

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）或影子定价（适用货币基金）。

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，本基金本报告期未进行利润分配。

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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,372,095.74	2,490,861.87
结算备付金		324,083.40	232,026.49

存出保证金		44,759.99	49,181.12
交易性金融资产	6.4.7.2	170,747,948.76	223,035,316.30
其中：股票投资		49,782,347.82	49,763,481.58
基金投资		-	-
债券投资		120,965,600.94	173,271,834.72
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		212,446.91	394,894.50
应收股利		-	-
应收申购款		220.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		174,701,554.80	226,202,280.28
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 6 月 30 日**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		259,490.45	430,345.84
应付赎回款		456,026.56	948,373.82
应付管理人报酬		146,349.96	196,413.35
应付托管费		29,269.99	39,282.66
应付销售服务费		10,869.75	13,925.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,299.39	5,290.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	173,827.31	298,738.03
负债合计		1,079,133.41	1,932,369.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	185,121,653.22	244,198,508.98
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-11,499,231.83	-19,928,598.36

净资产合计		173,622,421.39	224,269,910.62
负债和净资产总计		174,701,554.80	226,202,280.28

注： 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 185,121,653.22 份。 其中基金 A 类份额净值 0.9399 元，份额总额 157,363,574.07 份；基金 C 类份额净值 0.9266 元，份额总额 27,758,079.15 份。

6.2 利润表

会计主体：东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,102,024.89	-32,089,131.65
1.利息收入		94,030.02	108,498.50
其中：存款利息收入	6.4.7.9	19,114.08	103,892.77
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		74,915.94	4,605.73
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,664,437.66	-11,029,768.43
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-556,291.13	-11,086,567.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,645,125.64	-904,697.94
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	575,603.15	961,496.89
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,343,557.21	-21,167,861.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、营业总支出		1,364,263.98	2,449,949.74
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	986,279.38	1,832,625.01
2．托管费	6.4.10.2.2	197,255.87	366,525.00
3．销售服务费	6.4.10.2.3	71,747.11	138,697.06
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	230.70
其中：卖出回购金融资产支出		-	230.70
6．信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7．税金及附加		3,601.17	6,641.52
8．其他费用	6.4.7.19	105,380.45	105,230.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,737,760.91	-34,539,081.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,737,760.91	-34,539,081.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,737,760.91	-34,539,081.39

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	244,198,508.98	-	-19,928,598.36	224,269,910.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	244,198,508.98	-	-19,928,598.36	224,269,910.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-59,076,855.76	-	8,429,366.53	-50,647,489.23
（一）、综合收益总额	-	-	4,737,760.91	4,737,760.91

（二）、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）	-59,076,855.76	-	3,691,605.62	-55,385,250.14
其中：1.基金申购款	102,989.33	-	-6,203.33	96,786.00
2.基金赎回款	-59,179,845.09	-	3,697,808.95	-55,482,036.14
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	185,121,653.22	-	-11,499,231.83	173,622,421.39
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	463,699,172.28	-	14,803,433.30	478,502,605.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	463,699,172.28	-	14,803,433.30	478,502,605.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-137,021,259.13	-	-28,386,859.58	-165,408,118.71
（一）、综合收益总额	-	-	-34,539,081.39	-34,539,081.39
（二）、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）	-137,021,259.13	-	6,152,221.81	-130,869,037.32
其中：1.基金申购款	605,765.04	-	-22,446.05	583,318.99

2.基金赎回款	-137,627,024.17	-	6,174,667.86	-131,452,356.31
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	326,677,913.15	-	-13,583,426.28	313,094,486.87

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

东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2020 年 7 月 15 日中国证监会《关于准予东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2020]1508 号）和《关于东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金备案确认的函》（证券基金机构监管部部函[2020]2389 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《东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金合同》自 2020 年 8 月 3 日至 2020 年 8 月 28 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 1,630,336,649.15 元人民币，业经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）“中喜验字[2020]第 00104 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金合同》于 2020 年 9 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,631,260,607.90 份基金单位，其中认购资金利息折合 923,958.75 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方欣益一年持有期偏债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，包括国内依法公开发行

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（包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款）、同业存单、股指期货、国债期货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）。本基金买入信用债的债项评级不低于 AA。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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,372,095.74
等于：本金	3,371,531.42
加：应计利息	564.32
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,372,095.74

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		49,220,059.66	-	49,782,347.82	562,288.16
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	98,902,842.96	721,301.15	100,445,105.05	820,960.94
	银行间市场	20,009,994.25	283,495.89	20,520,495.89	227,005.75
	合计	118,912,837.21	1,004,797.04	120,965,600.94	1,047,966.69
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		168,132,896.87	1,004,797.04	170,747,948.76	1,610,254.85

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	206.72
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	77,840.14
其中：交易所市场	77,840.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,780.45
合计	173,827.31

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。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东方欣益一年持有期混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	209,448,392.61	209,448,392.61
本期申购	94,125.87	94,125.87
本期赎回（以“-”号填列）	-52,178,944.41	-52,178,944.41
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	157,363,574.07	157,363,574.07

东方欣益一年持有期混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,750,116.37	34,750,116.37
本期申购	8,863.46	8,863.46
本期赎回（以“-”号填列）	-7,000,900.68	-7,000,900.68
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	27,758,079.15	27,758,079.15

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东方欣益一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,942,126.01	-13,829,692.35	-16,771,818.36
本期利润	398,200.36	3,733,004.57	4,131,204.93
本期基金份额交易产生的变动数	620,281.46	2,559,224.70	3,179,506.16
其中：基金申购款	-764.04	-4,783.83	-5,547.87
基金赎回款	621,045.50	2,564,008.53	3,185,054.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,923,644.19	-7,537,463.08	-9,461,107.27

东方欣益一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-883,935.33	-2,272,844.67	-3,156,780.00
本期利润	-3,996.66	610,552.64	606,555.98
本期基金份额交易产生的变动数	167,960.72	344,138.74	512,099.46
其中：基金申购款	-210.32	-445.14	-655.46
基金赎回款	168,171.04	344,583.88	512,754.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-719,971.27	-1,318,153.29	-2,038,124.56

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,147.96
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	4,558.31

其他	407.81
合计	19,114.08

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-556,291.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-556,291.13

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	100,999,023.57
减：卖出股票成本总额	101,272,947.24
减：交易费用	282,367.46
买卖股票差价收入	-556,291.13

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,554,291.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	90,833.98
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	1,645,125.64

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	89,988,822.79

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	88,495,288.48
减：应计利息总额	1,401,290.48
减：交易费用	1,409.85
买卖债券差价收入	90,833.98

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	575,603.15
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	575,603.15

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	4,343,557.21
股票投资	1,945,554.01
债券投资	2,398,003.20
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,343,557.21

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-
账户维护费	18,600.00
合计	105,380.45

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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，期末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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	986,279.38	1,832,625.01
其中：支付销售机构的客户维护费	492,163.89	733,082.13

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计算。

管理费的计算方法如下：

H=E×1.00%÷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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	197,255.87	366,525.00

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×0.20%÷当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

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五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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方欣益一年持有期混合 A	东方欣益一年持有期混合 C	合计
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	69,000.64	69,000.64
合计	-	69,000.64	69,000.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方欣益一年持有期混合 A	东方欣益一年持有期混合 C	合计
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	134,998.94	134,998.94
合计	-	134,998.94	134,998.94

注：①计提标准：本基金销售服务费按前一日东方欣益一年 C 类基金资产净值的 0.50%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	3,372,095.74	14,147.96	49,333,738.16	99,786.46

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，本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末(2023 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

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 2023 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 2023 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、风控部门组成的风险管理组织体系，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。本基金投资于具有良好信用等级的证券，并在法律法规规定和本基金基金合同约定的基础上，进一步进行分散化投资管理。

除通过上述措施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。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	42,220,277.30	77,062,626.16
AAA 以下	30,523,696.58	26,997,615.68
未评级	20,270,771.50	30,433,698.08
合计	93,014,745.38	134,493,939.92

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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（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 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 2023 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	3,372,095.74	-	-	-	3,372,095.74
结算备付金	324,083.40	-	-	-	324,083.40
存出保证金	44,759.99	-	-	-	44,759.99
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	49,782,347.82	49,782,347.82
交易性金融资产-债券投资	23,488,187.86	96,314,573.65	1,162,839.43	-	120,965,600.94
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	212,446.91	212,446.91
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	220.00	220.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	27,229,126.99	96,314,573.65	1,162,839.43	49,995,014.73	174,701,554.80
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	259,490.45	259,490.45
应付赎回款	-	-	-	456,026.56	456,026.56
应付管理人报酬	-	-	-	146,349.96	146,349.96
应付托管费	-	-	-	29,269.99	29,269.99
应付销售服务费	-	-	-	10,869.75	10,869.75
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,299.39	3,299.39
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	173,827.31	173,827.31
负债总计	-	-	-	1,079,133.41	1,079,133.41
利率敏感度缺口	27,229,126.99	96,314,573.65	1,162,839.43	48,915,881.32	173,622,421.39
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	2,490,861.87	-	-	-	2,490,861.87
结算备付金	232,026.49	-	-	-	232,026.49
存出保证金	49,181.12	-	-	-	49,181.12
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	49,763,481.58	49,763,481.58
交易性金融资产-债券投资	62,063,068.61	111,208,766.11	-	-	173,271,834.72
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	394,894.50	394,894.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	64,835,138.09	111,208,766.11	-	50,158,376.08	226,202,280.28
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	430,345.84	430,345.84
应付赎回款	-	-	-	948,373.82	948,373.82
应付管理人报酬	-	-	-	196,413.35	196,413.35
应付托管费	-	-	-	39,282.66	39,282.66
应付销售服务费	-	-	-	13,925.79	13,925.79
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,290.17	5,290.17
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	298,738.03	298,738.03
负债总计	-	-	-	1,932,369.66	1,932,369.66
利率敏感度缺口	64,835,138.09	111,208,766.11	-	48,226,006.42	224,269,910.62

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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

	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 （2023 年 6 月 30 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日 ）
分析	市场利率上调 0.25%	-516,781.23	-475,240.69
	市场利率下调 0.25%	406,704.14	304,926.35

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。

本基金按照基金合同的约定和法律法规的规定进行投资，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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022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	49,782,347.82	28.67	49,763,481.58	22.19
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	120,965,600.94	69.67	173,271,834.72	77.26
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	170,747,948.76	98.34	223,035,316.30	99.45

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）	
		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 （2023 年 6 月 30 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日 ）
	沪深 300 指数上涨 5%	1,947,897.18	1,807,312.76
	沪深 300 指数下跌 5%	-1,947,897.18	-1,807,312.76

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	87,758,546.34	95,194,499.24
第二层次	82,989,402.42	127,840,817.06

第三层次	-	-
合计	170,747,948.76	223,035,316.30

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至中期报告报出日，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	49,782,347.82	28.50
	其中：股票	49,782,347.82	28.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	120,965,600.94	69.24
	其中：债券	120,965,600.94	69.24
	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	3,696,179.14	2.12
8	其他各项资产	257,426.90	0.15
9	合计	174,701,554.80	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,532,847.00	0.88
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,653,145.56	21.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	702,075.00	0.40
E	建筑业	1,860,334.00	1.07
F	批发和零售业	381,080.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,572,876.26	3.79
J	金融业	1,449,690.00	0.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	630,300.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	49,782,347.82	28.67

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601668	中国建筑	324,100	1,860,334.00	1.07
2	600519	贵州茅台	1,100	1,860,100.00	1.07
3	000650	仁和药业	302,900	1,859,806.00	1.07
4	600398	海澜之家	242,500	1,668,400.00	0.96
5	000997	新 大 陆	87,000	1,644,300.00	0.95
6	688278	特宝生物	33,412	1,467,120.92	0.85
7	002142	宁波银行	57,300	1,449,690.00	0.83
8	000596	古井贡酒	5,600	1,385,328.00	0.80
9	000568	泸州老窖	6,500	1,362,205.00	0.78
10	000400	许继电气	57,000	1,313,850.00	0.76
11	002908	德生科技	83,240	1,287,722.80	0.74
12	600760	中航沈飞	27,300	1,228,500.00	0.71

13	000657	中钨高新	114,530	1,109,795.70	0.64
14	000951	中国重汽	65,500	1,103,675.00	0.64
15	300896	爱美客	2,400	1,067,880.00	0.62
16	600690	海尔智家	42,500	997,900.00	0.57
17	600552	凯盛科技	82,600	977,984.00	0.56
18	000999	华润三九	14,400	873,504.00	0.50
19	300232	洲明科技	92,800	848,192.00	0.49
20	688290	景业智能	12,420	828,538.20	0.48
21	300119	瑞普生物	45,600	811,680.00	0.47
22	002315	焦点科技	19,800	792,000.00	0.46
23	300009	安科生物	79,000	790,000.00	0.46
24	605009	豪悦护理	16,049	770,352.00	0.44
25	300773	拉卡拉	41,900	730,736.00	0.42
26	688697	纽威数控	27,771	717,324.93	0.41
27	300761	立华股份	38,100	702,183.00	0.40
28	600886	国投电力	55,500	702,075.00	0.40
29	688677	海泰新光	12,001	680,936.74	0.39
30	603712	七一二	22,200	670,662.00	0.39
31	600761	安徽合力	33,500	667,655.00	0.38
32	002311	海大集团	14,100	660,444.00	0.38
33	002020	京新药业	50,400	646,128.00	0.37
34	000888	峨眉山 A	55,000	630,300.00	0.36
35	688308	欧科亿	15,683	627,320.00	0.36
36	603611	诺力股份	23,600	621,624.00	0.36
37	300740	水羊股份	39,100	606,050.00	0.35
38	688687	凯因科技	20,456	603,452.00	0.35
39	688111	金山办公	1,243	586,969.46	0.34
40	002085	万丰奥威	83,900	581,427.00	0.33
41	603515	欧普照明	28,600	580,580.00	0.33
42	600195	中牧股份	49,600	579,328.00	0.33
43	002429	兆驰股份	96,500	530,750.00	0.31
44	600975	新五丰	53,400	510,504.00	0.29
45	001215	千味央厨	7,500	498,675.00	0.29
46	600262	北方股份	23,000	492,890.00	0.28
47	688488	艾迪药业	39,200	482,944.00	0.28
48	301302	华如科技	12,400	456,320.00	0.26
49	603551	奥普家居	31,500	407,295.00	0.23
50	601698	中国卫通	20,000	397,600.00	0.23
51	300145	中金环境	134,900	396,606.00	0.23
52	688059	华锐精密	4,614	386,422.50	0.22
53	002840	华统股份	24,600	384,744.00	0.22
54	300592	华凯易佰	14,000	381,080.00	0.22
55	300366	创意信息	30,700	379,452.00	0.22

56	300866	安克创新	4,300	376,250.00	0.22
57	688523	航天环宇	13,597	365,623.33	0.21
58	600118	中国卫星	12,200	344,162.00	0.20
59	600422	昆药集团	16,300	337,736.00	0.19
60	603477	巨星农牧	9,600	320,160.00	0.18
61	300260	新莱应材	7,740	305,884.80	0.18
62	600228	返利科技	29,600	297,776.00	0.17
63	600580	卧龙电驱	18,600	271,746.00	0.16
64	301383	天键股份	6,800	254,320.00	0.15
65	688576	西山科技	1,874	249,354.44	0.14

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	002299	圣农发展	1,981,151.00	0.88
2	002179	中航光电	1,791,561.00	0.80
3	688410	山外山	1,569,523.86	0.70
4	000596	古井贡酒	1,564,840.00	0.70
5	002142	宁波银行	1,558,736.00	0.70
6	688677	海泰新光	1,547,163.94	0.69
7	000915	华特达因	1,376,061.00	0.61
8	600398	海澜之家	1,364,311.00	0.61
9	688278	特宝生物	1,350,780.71	0.60
10	300119	瑞普生物	1,344,633.00	0.60
11	688202	美迪西	1,336,283.89	0.60
12	000997	新 大 陆	1,332,886.00	0.59
13	000661	长春高新	1,275,733.00	0.57
14	002311	海大集团	1,237,627.00	0.55
15	300122	智飞生物	1,215,738.00	0.54
16	000657	中钨高新	1,207,516.00	0.54
17	600325	华发股份	1,179,639.00	0.53
18	603288	海天味业	1,170,073.00	0.52
19	000650	仁和药业	1,141,374.00	0.51
20	300896	爱美客	1,130,663.00	0.50

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	688410	山外山	2,267,965.34	1.01
2	002154	报 喜 鸟	2,088,638.30	0.93
3	600048	保利发展	1,938,145.00	0.86
4	605376	博迁新材	1,934,196.00	0.86
5	600276	恒瑞医药	1,866,484.80	0.83
6	002311	海大集团	1,861,176.00	0.83
7	300699	光威复材	1,751,934.25	0.78
8	002179	中航光电	1,699,703.50	0.76
9	600195	中牧股份	1,675,297.00	0.75
10	002299	圣农发展	1,662,727.00	0.74
11	600559	老白干酒	1,600,216.30	0.71
12	002987	京北方	1,521,916.72	0.68
13	601369	陕鼓动力	1,391,467.00	0.62
14	300122	智飞生物	1,351,539.00	0.60
15	600325	华发股份	1,322,697.00	0.59
16	603868	飞科电器	1,292,222.00	0.58
17	601088	中国神华	1,267,438.00	0.57
18	603613	国联股份	1,218,672.00	0.54
19	603516	淳中科技	1,215,200.00	0.54
20	000661	长春高新	1,200,827.00	0.54

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	99,346,259.47
卖出股票收入（成交）总额	100,999,023.57

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	27,950,855.56	16.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,383,392.88	5.98
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	34,518,050.97	19.88
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	10,137,103.01	5.84
7	可转债（可交换债）	37,976,198.52	21.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	120,965,600.94	69.67

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	019694	23 国债 01	111,000	11,223,170.47	6.46
2	2120105	21 厦门银行二级 02	100,000	10,383,392.88	5.98
3	149489	21 广铁 03	100,000	10,256,153.43	5.91
4	102280139	22 华电 MTN001A	100,000	10,137,103.01	5.84
5	148055	22 深新 01	100,000	10,133,668.49	5.84

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金所持有的宁波银行（002142），宁波银行股份有限公司、分支行及高管受到行政处罚。在开展业务过程当中，因未依法履行其他职责，公司及分支行高管多次受到主管部门行政处罚。

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。

本基金投资宁波银行主要基于以下原因：公司战略布局清晰，拥有公司银行、零售公司、财富管理、私人银行、个人信贷、信用卡、金融市场、机构业务、投资银行、资产托管、票据业务等多个利润中心。同时公司管理能力突出且占据区位优势，具有良好的未来发展前景。

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是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，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	44,759.99
2	应收清算款	212,446.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	220.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	257,426.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123091	长海转债	2,807,423.76	1.62
2	110079	杭银转债	2,668,343.87	1.54
3	113044	大秦转债	2,336,892.01	1.35
4	110068	龙净转债	2,228,694.06	1.28
5	113042	上银转债	2,172,980.58	1.25
6	123107	温氏转债	2,110,013.26	1.22
7	113052	兴业转债	2,037,312.76	1.17

8	110061	川投转债	1,773,513.78	1.02
9	128136	立讯转债	1,507,738.63	0.87
10	113633	科沃转债	1,292,317.73	0.74
11	110081	闻泰转债	1,123,985.33	0.65
12	123128	首华转债	1,090,624.76	0.63
13	110047	山鹰转债	946,171.17	0.54
14	110075	南航转债	905,945.56	0.52
15	113606	荣泰转债	888,374.16	0.51
16	128142	新乳转债	787,068.90	0.45
17	113542	好客转债	764,723.11	0.44
18	110082	宏发转债	758,177.25	0.44
19	113627	太平转债	699,167.52	0.40
20	127068	顺博转债	599,999.24	0.35
21	113652	伟 22 转债	562,840.19	0.32
22	127016	鲁泰转债	562,379.28	0.32
23	110067	华安转债	561,152.76	0.32
24	123124	晶瑞转 2	549,142.06	0.32
25	113046	金田转债	465,501.56	0.27
26	127020	中金转债	462,546.30	0.27
27	113043	财通转债	426,279.47	0.25
28	127056	中特转债	379,089.60	0.22
29	113605	大参转债	378,892.80	0.22
30	127017	万青转债	376,772.92	0.22
31	127031	洋丰转债	375,361.40	0.22
32	113584	家悦转债	310,353.60	0.18
33	123117	健帆转债	216,983.42	0.12
34	110076	华海转债	202,801.52	0.12
35	113579	健友转债	182,263.03	0.10

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

份额级别	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（%）
东方欣益一年持有	3,288	47,859.97	-	-	157,363,574.07	100.00

期混合 A						
东方欣益一年持有期混合 C	1,741	15,943.76	-	-	27,758,079.15	100.00
合计	5,029	36,810.83	-	-	185,121,653.22	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	东方欣益一年持有期混合 A	53,095.93	0.03
	东方欣益一年持有期混合 C	0.00	0.00
	合计	53,095.93	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情况

项目	份额级别	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	东方欣益一年持有期混合 A	0
	东方欣益一年持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方欣益一年持有期混合 A	0~10
	东方欣益一年持有期混合 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方欣益一年持有期混合 A	东方欣益一年持有期混合 C
基金合同生效日（2020 年 9 月 2 日）基金份额总额	1,455,541,894.16	175,718,713.74
本报告期期初基金份额总额	209,448,392.61	34,750,116.37
本报告期基金总申购份额	94,125.87	8,863.46
减：本报告期基金总赎回份额	52,178,944.41	7,000,900.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	157,363,574.07	27,758,079.15

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中信建投证券股份有限公司	2	103,362,704.95	51.67	75,588.67	45.64	-
华西证券股份有限	2	67,958,910.70	33.97	63,289.93	38.21	-

公司						
华鑫证券有限责任公司	2	28,714,019.19	14.35	26,741.69	16.15	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限	2	-	-	-	-	-

公司						

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）本报告期本基金新租用 2 个交易单元，分别是中泰证券股份有限公司上海、深证交易单元各一个。

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(%)
中信建投证券股份有限公司	39,548,750.45	71.27	486,868,000.00	100.00	-	-
华西证券股份有限公司	13,900,124.46	25.05	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	2,041,482.13	3.68	-	-	-	-

长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金 2022 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	2023 年 1 月 19 日
2	关于增加和合期货有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 10 日
3	东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金经理变更公告	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	2023 年 2 月 23 日
4	东方欣益一年持有期偏债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	2023 年 2 月 24 日
5	东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 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	2023 年 2 月 24 日
6	关于增加平安银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 24 日
7	关于增加泛华普益基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 2 日
8	关于增加深圳新华信通基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 9 日

9	关于增加嘉实财富管理有限公司等 3 家机构为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 17 日
10	东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金 2022 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	2023 年 3 月 29 日
11	东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金 2023 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	2023 年 4 月 22 日
12	关于增加华西证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
13	关于增加平安银行股份有限公司行 E 通平台为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
14	关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司行 E 通平台费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
15	关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 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、《东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金合同》

二、《东方欣益一年持有期偏债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）查阅。

东方基金管理股份有限公司

2023 年 8 月 31 日