

东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券
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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51

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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	东方鑫享价值成长一年持有期混合	
基金主代码	011458	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 5 月 19 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	329,596,158.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方鑫享价值成长一年持有期混合 A	东方鑫享价值成长一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	011458	011459
报告期末下属分级基金的份额总额	205,910,435.55 份	123,685,723.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过深入的基本面研究挖掘具有较好盈利能力和市场竞争力的公司，力求实现资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）*10%+中债综合全价指数收益率*30%
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。 本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	东方基金管理股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩
	联系电话	010-66295888
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com
客户服务电话	010-66578578 或 400-628-5888	95561
传真	010-66578700	021-62159217
注册地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	100073	200120
法定代表人	崔伟	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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)		
	东方鑫享价值成长一年持有期混合 A	东方鑫享价值成长一年持有期混合 C	
本期已实现收益	-16,485,029.15	-10,201,214.60	
本期利润	-1,412,702.51	-1,281,095.76	
加权平均基金份额本期利润	-0.0060	-0.0091	
本期加权平均净值利润率	-0.74%	-1.13%	
本期基金份额净值增长率	-0.32%	-0.56%	
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	-65,844,521.47	-40,525,477.84
	期末可供分配基金份额利润	-0.3198	-0.3276
	期末基金资产净值	167,000,010.40	99,260,236.74
	期末基金份额净值	0.8110	0.8025

值		
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	-18.90%	-19.75%

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

东方鑫享价值成长一年持有期混合 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	0.93%	2.30%	1.03%	0.63%	-0.10%	1.67%
过去三个月	3.22%	2.20%	-3.06%	0.57%	6.28%	1.63%
过去六个月	-0.32%	1.75%	0.38%	0.57%	-0.70%	1.18%
过去一年	-14.43%	1.57%	-7.66%	0.69%	-6.77%	0.88%
自基金合同生效起至今	-18.90%	1.55%	-14.98%	0.76%	-3.92%	0.79%

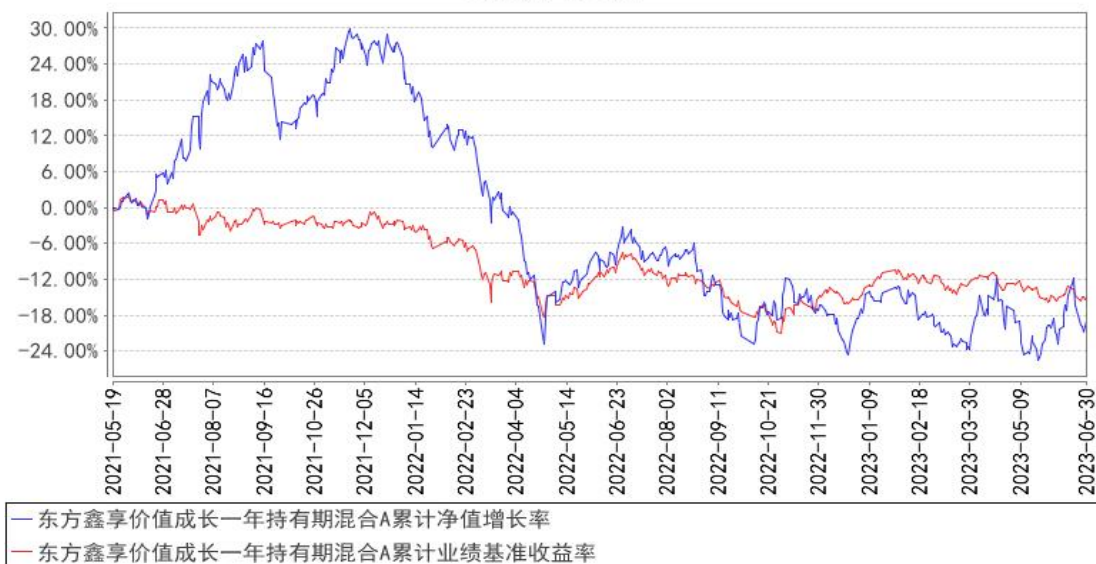
东方鑫享价值成长一年持有期混合 C

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	0.89%	2.30%	1.03%	0.63%	-0.14%	1.67%
过去三个月	3.10%	2.20%	-3.06%	0.57%	6.16%	1.63%
过去六个月	-0.56%	1.75%	0.38%	0.57%	-0.94%	1.18%
过去一年	-14.85%	1.57%	-7.66%	0.69%	-7.19%	0.88%
自基金合同生效起	-19.75%	1.55%	-14.98%	0.76%	-4.77%	0.79%

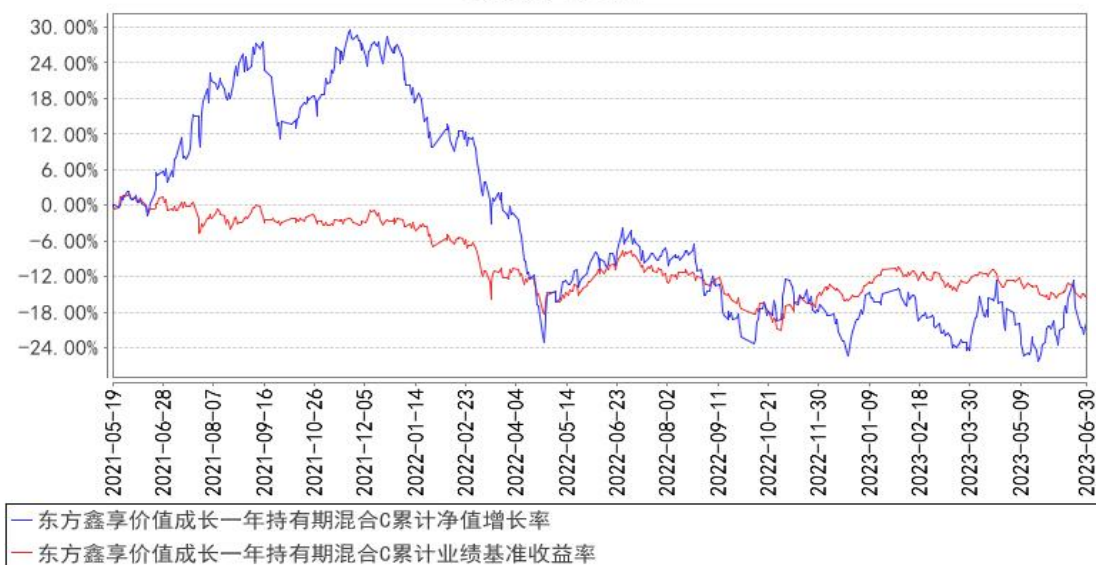
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

东方鑫享价值成长一年持有期混合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



东方鑫享价值成长一年持有期混合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		
陈皓	本基金基金经理	2022 年 7 月 23 日	-	7 年	清华大学机械工程专业硕士，7 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、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。现任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、东方专精特新混合型发起式证券投资基金基金经理。
蒋茜	本基金基金经理、公司总经理助理、权益投资副总监、公募投资决策委员会委员	2021 年 5 月 19 日	2023 年 2 月 24 日	13 年	公司总经理助理、权益投资副总监，公募投资决策委员会委员。清华大学工商管理硕士，13 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，曾任权益投资部总经理、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、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，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、东方创新成长混合型证券投资基金基金经理、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金基金经理、东方匠心优选混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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、《东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、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

根据 Wind 数据显示，截止 2023 年上半年，上证指数上涨 3.7%、沪深 300 下跌 0.8%、创业板指下跌 5.6%、科创 50 上涨 4.7%。申万一级行业分化较为明显，其中通信、传媒、计算机行业指数分别上涨 50.7%、42.8%和 27.6%，实现了非常突出的收益；机械设备、家用电器、电子、建筑装饰分别实现了 13.4%、13.3%、11.0%和 9.6%的涨幅，收益较好；而商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料等分别下跌 23.4%、14.3%、13.6%和 10.5%，排名靠后。

2023 年上半年，权益市场整体表现先扬后抑。2022 年年末至 2023 年年初，经济数据呈现向好态势，2023 年 1 月市场表现活跃，呈现以内需复苏为主导的行情。但 2 月以来随着经济强复苏的预期未能得到验证，同时叠加海外和国内人工智能方向出现了的产业进展信号，因此计算机、通信、电子、传媒等 TMT 板块开始持续走强。3 月起国内经济数据走弱，4 月、5 月国内高频经济数据继续回落，同期美联储加息预期向上修正，全球的流动性和风险偏好均有所抑制。在此背景下，4 月起地产链、大金融消费等总量经济相关的权重板块下跌拖累指数，悲观情绪亦导致人工智能等 TMT 方向有所调整。截止 5 月下旬至月底，国内和海外科技产业链部分公司业绩超预期促进了 TMT 方向情绪有所修复，TMT 方向在 5 月下旬至 6 月出现了明显的超额收益。

本基金整体延续基于价值成长策略进行选股的方式，基于中长期的视角，配置具备核心竞争力和成长良好的个股。针对报告期内的国内和海外宏观背景，以及各行业产业周期的进展变化，本基金在电子、通信、计算机、传媒方向进行了较大幅的加仓，在新能源方向进行了大幅的减仓。

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-0.32%，业绩比较基准收益率为 0.38%，低于业绩比较基准 0.70%；本基金 C 类净值增长率为-0.56%，业绩比较基准收益率为 0.38%，低于业绩比较基准 0.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内政治局会议定调使得市场信心有所恢复，但我们判断市场对于国内经济弱复苏的预期可能无法快速扭转。在潜在的政策窗口期内，顺周期相关的总量板块经过了一段修复行情，我们认为后续需要等待明朗的经济或产业信号重新出现。

成长赛道方面，考虑供给出清的进展，认为新能源汽车板块或更有观察和配置的价值，同时汽车消费作为消费占比较高的细分，也有望受益于经济复苏预期，对新能源汽车板块形成共振支撑。人工智能作为潜在的创新科技方向，若后续出现较明显的商用化产业进展加速，将有望带动 TMT 板块迎来新一轮行情。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：东方鑫享价值成长一年持有期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	上年度末
----	-----	-----	------

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	44,826,059.78	22,713,723.49
结算备付金		1,316,795.96	1,058,921.65
存出保证金		254,553.23	336,788.92
交易性金融资产	6.4.7.2	236,109,260.72	323,772,295.87
其中：股票投资		221,653,960.28	305,351,391.53
基金投资		-	-
债券投资		14,455,300.44	18,420,904.34
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		-	2,633,477.43
应收股利		-	-
应收申购款		4,878.94	1,611.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		282,511,548.63	350,516,818.84
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		14,653,425.40	1,471,274.30
应付赎回款		63,372.90	179,173.79
应付管理人报酬		334,624.04	442,031.27
应付托管费		55,770.66	73,671.85
应付销售服务费		41,476.71	54,866.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,102,631.78	841,754.14

负债合计		16,251,301.49	3,062,771.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	329,596,158.64	428,366,313.30
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-63,335,911.50	-80,912,266.12
净资产合计		266,260,247.14	347,454,047.18
负债和净资产总计		282,511,548.63	350,516,818.84

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 329,596,158.64 份，其中东方鑫享价值成长一年混合 A 基金份额净值 0.8110 元，份额总额 205,910,435.55 份；东方鑫享价值成长一年混合 C 基金份额净值 0.8025 元，份额总额 123,685,723.09 份。

6.2 利润表

会计主体：东方鑫享价值成长一年持有期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	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		347,241.92	-151,204,703.74
1. 利息收入		66,098.84	124,668.75
其中：存款利息收入	6.4.7.9	66,098.84	124,668.75
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-23,711,302.40	-126,557,944.04
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,479,868.82	-128,305,580.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	111,257.55	263,173.38
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	657,308.87	1,484,463.13
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	23,992,445.48	-24,771,428.45
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		3,041,040.19	4,628,118.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,286,583.44	3,521,726.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	381,097.23	586,954.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	283,875.33	427,592.27
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	1,133.44
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,133.44
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	89,484.19	90,711.82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,693,798.27	-155,832,822.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,693,798.27	-155,832,822.11
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,693,798.27	-155,832,822.11

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：东方鑫享价值成长一年持有期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)	428,366,313.30	-	-80,912,266.12	347,454,047.18
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)	428,366,313.30	-	-80,912,266.12	347,454,047.18

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-98,770,154.66	-	17,576,354.62	-81,193,800.04
(一)、综合收益总额	-	-	-2,693,798.27	-2,693,798.27
(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)	-98,770,154.66	-	20,270,152.89	-78,500,001.77
其中：1. 基金申购款	1,907,468.93	-	-359,976.18	1,547,492.75
2. 基金赎回款	-100,677,623.59	-	20,630,129.07	-80,047,494.52
(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)	329,596,158.64	-	-63,335,911.50	266,260,247.14
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)	470,823,905.86	-	128,910,687.19	599,734,593.05
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)	470,823,905.86	-	128,910,687.19	599,734,593.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,152,994.98	-	-153,907,747.01	-163,060,741.99
(一)、综合收益总额	-	-	-155,832,822.11	-155,832,822.11

(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)	-9,152,994.98	-	1,925,075.10	-7,227,919.88
其中：1. 基金申购款	7,490,612.31	-	276,453.96	7,767,066.27
2. 基金赎回款	-16,643,607.29	-	1,648,621.14	-14,994,986.15
(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)	461,670,910.88	-	-24,997,059.82	436,673,851.06

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：

<u>刘鸿鹏</u>	<u>刘鸿鹏</u>	<u>王丹丹</u>
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

东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2020 年 12 月 25 日中国证监会《关于准予东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2020]3630 号）和《关于东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金备案确认的函》（机构部函[2021]1486 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《东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》自 2021 年 4 月 6 日至 2021 年 5 月 14 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 250,156,455.67 元人民币，业经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）“中喜验字[2021]第 00030 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 5 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额

为 250,376,986.31 份基金单位，其中认购资金利息折合 220,530.64 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、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）。

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	44,826,059.78
等于：本金	44,823,721.19
加：应计利息	2,338.59
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	44,826,059.78

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	198,312,833.98	-	221,653,960.28	23,341,126.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	14,196,031.25	256,720.44	14,455,300.44	2,548.75
交易所市				

	场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,196,031.25	256,720.44	14,455,300.44	2,548.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		212,508,865.23	256,720.44	236,109,260.72	23,343,675.05

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,015,851.33
其中：交易所市场	1,015,851.33
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	1,102,631.78

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

东方鑫享价值成长一年持有期混合 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	267,998,385.36	267,998,385.36

本期申购	1,166,602.10	1,166,602.10
本期赎回（以“-”号填列）	-63,254,551.91	-63,254,551.91
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	205,910,435.55	205,910,435.55

东方鑫享价值成长一年持有期混合 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	160,367,927.94	160,367,927.94
本期申购	740,866.83	740,866.83
本期赎回（以“-”号填列）	-37,423,071.68	-37,423,071.68
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	123,685,723.09	123,685,723.09

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东方鑫享价值成长一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-67,210,658.69	17,246,365.97	-49,964,292.72
本期利润	-16,485,029.15	15,072,326.64	-1,412,702.51
本期基金份额交易产生的变动数	17,851,166.37	-5,384,596.29	12,466,570.08
其中：基金申购款	-329,719.39	109,782.02	-219,937.37
基金赎回款	18,180,885.76	-5,494,378.31	12,686,507.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-65,844,521.47	26,934,096.32	-38,910,425.15

东方鑫享价值成长一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-41,262,253.29	10,314,279.89	-30,947,973.40
本期利润	-10,201,214.60	8,920,118.84	-1,281,095.76
本期基金份额交易产生的变动数	10,937,990.05	-3,134,407.24	7,803,582.81
其中：基金申购款	-208,433.81	68,395.00	-140,038.81
基金赎回款	11,146,423.86	-3,202,802.24	7,943,621.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-40,525,477.84	16,099,991.49	-24,425,486.35

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	47,618.77
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	16,414.56
其他	2,065.51
合计	66,098.84

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	-24,479,868.82
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	-24,479,868.82

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	1,415,094,624.51
减：卖出股票成本总额	1,435,510,182.42
减：交易费用	4,064,310.91
买卖股票差价收入	-24,479,868.82

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	149,257.95
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-38,000.40
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	111,257.55
----	------------

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	24,104,023.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,688,096.40
减：应计利息总额	453,927.89
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-38,000.40

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本报告期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期本基金无衍生工具收益。

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	657,308.87
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	657,308.87

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	23,992,445.48
股票投资	23,954,456.48
债券投资	37,989.00
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	23,992,445.48

6.4.7.17 其他收入

本报告期本基金无其他收入。

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	-
银行费用	2,703.74
合计	89,484.19

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
兴业银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间,未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间,未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间,未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间,未发生与关联方的佣金费用,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	2,286,583.44	3,521,726.42
其中:支付销售机构的客户维护费	1,074,437.54	1,636,424.05

注:①计提标准:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计算,具体计算方法如下:

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式:基金管理费每日计提,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5个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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	381,097.23	586,954.42

注:①计提标准:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提,具体计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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		
	东方鑫享价值成长一年 持有期混合 A	东方鑫享价值成长一年 持有期混合 C	合计
兴业银行股份有限公司	-	236,223.18	236,223.18
合计	-	236,223.18	236,223.18
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		
	东方鑫享价值成长一年 持有期混合 A	东方鑫享价值成长一年 持有期混合 C	合计
兴业银行股份有限公司	-	356,429.05	356,429.05
合计	-	356,429.05	356,429.05

注：①计提标准：本基金销售服务费按前一日东方鑫享 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：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

份额单位:份

项目	本期	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
	东方鑫享价值成长一年持有期混合 A	东方鑫享价值成长一年持有期混合 C
基金合同生效日(2021年5月19日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	10,013,500.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	10,013,500.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	8.10%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
	东方鑫享价值成长一年持有期混合 A	东方鑫享价值成长一年持有期混合 C
基金合同生效日(2021年5	-	-

月 19 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	10,013,500.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	10,013,500.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	5.97%

注: ①基金管理人投资本基金时按照基金合同、招募说明书及相关公告约定的费率标准支付相应的手续费。

②报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例, 比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

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
兴业银行股份有限公司	44,826,059.78	47,618.77	13,737,944.91	105,008.95

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(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

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	受限期	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
001282	三联锻	2023年	6个月	新股流	27.93	33.12	103	2,876.79	3,411.36	-

	造	5月15日		通受限							
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.93	3,767	36,163.20	37,406.31		-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	25.32	497	5,904.36	12,584.04		-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	20.03	114	2,152.32	2,283.42		-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	16.45	166	2,553.08	2,730.70		-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	42.55	55	2,446.40	2,340.25		-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.85	170	4,902.80	5,244.50		-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	42.45	33.10	226	9,593.70	7,480.60		-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.71	262	10,794.40	11,190.02		-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.92	150	8,475.00	7,938.00		-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	35.61	222	7,548.00	7,905.42		-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.97	221	10,194.73	7,728.37		-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.71	201	11,633.88	9,991.71		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	34.28	302	10,769.32	10,352.56		-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.48	132	9,570.00	7,719.36		-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	348	17,400.00	10,687.08		-
301261	恒工精	2023年	1个月	新股流	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70		-

	密	6月29日	内(含)	通受限							
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.36	316	9,984.68	8,013.76		-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.57	365	13,917.45	11,523.05		-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	32.00	408	13,194.72	13,056.00		-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	67.28	65.42	230	15,474.40	15,046.60		-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.14	694	14,344.98	18,141.16		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	41.11	166	6,483.96	6,824.26		-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.74	616	9,122.96	8,463.84		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	17.23	479	8,406.45	8,253.17		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.86	527	12,526.79	22,587.22		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.81	124	8,913.12	11,508.44		-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.84	277	9,343.21	8,819.68		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.57	329	8,113.14	7,425.53		-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	302	13,940.32	10,787.44		-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.63	236	13,763.52	10,768.68		-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	779	12,650.96	13,204.05		-

301429	森泰股份	2023年 4月10 日	6个月	新股流 通受限	28.75	21.19	483	13,886.25	10,234.77	-
301488	豪恩汽 电	2023年 6月26 日	1个月 内(含)	新股流 通受限	39.78	39.78	2,506	99,688.68	99,688.68	-
601065	江盐集 团	2023年 3月31 日	6个月	新股流 通受限	10.36	12.59	299	3,097.64	3,764.41	-
601133	柏诚股 份	2023年 3月31 日	6个月	新股流 通受限	11.66	13.72	311	3,626.26	4,266.92	-
603125	常青科 技	2023年 3月30 日	6个月	新股流 通受限	25.98	26.51	105	2,727.90	2,783.55	-
603137	恒尚节 能	2023年 4月10 日	6个月	新股流 通受限	15.90	18.25	139	2,210.10	2,536.75	-
603172	万丰股 份	2023年 4月28 日	6个月	新股流 通受限	14.58	16.68	122	1,778.76	2,034.96	-
688334	西高院	2023年 6月9日	6个月	新股流 通受限	14.16	17.20	625	8,850.00	10,750.00	-
688352	硕中科 技	2023年 4月11 日	6个月	新股流 通受限	12.10	12.63	898	10,865.80	11,341.74	-
688361	中科飞 测	2023年 5月12 日	6个月	新股流 通受限	23.60	78.84	299	7,056.40	23,573.16	-
688429	时创能 源	2023年 6月20 日	6个月	新股流 通受限	19.20	27.88	346	6,643.20	9,646.48	-
688484	南芯科 技	2023年 3月28 日	6个月	新股流 通受限	39.99	38.64	280	11,197.20	10,819.20	-
688512	慧智微	2023年 5月8日	6个月	新股流 通受限	20.92	19.23	375	7,845.00	7,211.25	-
688523	航天环 宇	2023年 5月26 日	6个月	新股流 通受限	21.86	25.43	420	9,181.20	10,680.60	-
688531	日联科 技	2023年 3月24 日	6个月	新股流 通受限	152.38	139.16	104	15,847.52	14,472.64	-
688535	华海诚	2023年	6个月	新股流	35.00	54.75	161	5,635.00	8,814.75	-

	科	3月28日		通受限							
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.72	202	8,821.34	10,851.44		-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	24.18	430	9,103.10	10,397.40		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.08	71	8,931.80	8,383.68		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	89.31	75	9,441.00	6,698.25		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	30.89	254	6,421.12	7,846.06		-

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	0.00	0.00

AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 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	44,826,059.78	-	-	-	44,826,059.78
结算备付金	1,316,795.96	-	-	-	1,316,795.96
存出保证金	254,553.23	-	-	-	254,553.23
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-221,653,960.28	221,653,960.28
交易性金融资产-债券投资	14,455,300.44	-	-	-	14,455,300.44
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	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,878.94	4,878.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	60,852,709.41	-	-	-221,658,839.22	282,511,548.63

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	-	-	-	14,653,425.40	14,653,425.40
应付赎回款	-	-	-	63,372.90	63,372.90
应付管理人报酬	-	-	-	334,624.04	334,624.04
应付托管费	-	-	-	55,770.66	55,770.66
应付销售服务费	-	-	-	41,476.71	41,476.71
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,102,631.78	1,102,631.78
负债总计	-	-	-	16,251,301.49	16,251,301.49
利率敏感度缺口	60,852,709.41	-	-	-205,407,537.73	266,260,247.14
上年度末 2022 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	22,713,723.49	-	-	-	22,713,723.49
结算备付金	1,058,921.65	-	-	-	1,058,921.65
存出保证金	336,788.92	-	-	-	336,788.92
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-305,351,391.53	305,351,391.53
交易性金融资产-债券投资	18,420,904.34	-	-	-	18,420,904.34
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	-	-	-	2,633,477.43	2,633,477.43
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,611.48	1,611.48
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	42,530,338.40	-	-	-307,986,480.44	350,516,818.84
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	-	-	-	1,471,274.30	1,471,274.30
应付赎回款	-	-	-	179,173.79	179,173.79

应付管理人报酬	-	-	-	442,031.27	442,031.27
应付托管费	-	-	-	73,671.85	73,671.85
应付销售服务费	-	-	-	54,866.31	54,866.31
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	841,754.14	841,754.14
负债总计	-	-	-	3,062,771.66	3,062,771.66
利率敏感度缺口	42,530,338.40	-	-	-304,923,708.78	347,454,047.18

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上调0.25%	-1,680.43	-1,639.46
	市场利率下调0.25%	1,680.43	1,639.46

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金可投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				

交易性金融资产	0.00	7,251,372.70	0.00	7,251,372.70
资产合计	0.00	7,251,372.70	0.00	7,251,372.70
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	0.00	7,251,372.70	0.00	7,251,372.70
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	10,741,571.75	-	10,741,571.75
资产合计	-	10,741,571.75	-	10,741,571.75
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	10,741,571.75	-	10,741,571.75

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	362,568.64	537,078.59
	所有外币相对人民币贬值 5%	-362,568.64	-537,078.59

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	221,653,960.28	83.25	305,351,391.53	87.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	14,455,300.44	5.43	18,420,904.34	5.30
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	236,109,260.72	88.68	323,772,295.87	93.18

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%	12,898,669.92	9,327,406.47
沪深 300 指数下跌	-12,898,669.92	-9,327,406.47	

	5%		
--	----	--	--

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	220,982,943.31	304,833,687.11
第二层次	14,627,792.82	18,420,904.34
第三层次	498,524.59	517,704.42
合计	236,109,260.72	323,772,295.87

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	221,653,960.28	78.46
	其中：股票	221,653,960.28	78.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,455,300.44	5.12
	其中：债券	14,455,300.44	5.12
	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	46,142,855.74	16.33
8	其他各项资产	259,432.17	0.09
9	合计	282,511,548.63	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	175,124,373.23	65.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,406.31	0.01
E	建筑业	6,803.67	0.00
F	批发和零售业	2,818,355.62	1.06
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	36,397,170.38	13.67
J	金融业	-	-
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	10,750.00	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	7,728.37	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	214,402,587.58	80.52

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	7,251,372.70	2.72
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	7,251,372.70	2.72

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	601138	工业富联	593,400	14,953,680.00	5.62
2	300308	中际旭创	97,300	14,346,885.00	5.39
3	688120	华海清科	54,682	13,782,598.10	5.18
4	688153	唯捷创芯	147,325	10,778,297.00	4.05
5	300161	华中数控	194,400	10,404,288.00	3.91
6	002555	三七互娱	288,500	10,062,880.00	3.78
7	688226	威腾电气	431,130	9,407,256.60	3.53
8	688012	中微公司	57,366	8,974,910.70	3.37
9	688072	拓荆科技	20,515	8,738,774.55	3.28
10	688037	芯源微	48,589	8,306,289.55	3.12
11	300567	精测电子	85,000	8,087,750.00	3.04
12	300502	新易盛	117,040	7,955,208.80	2.99
13	002472	双环传动	213,200	7,739,160.00	2.91
14	688036	传音控股	51,704	7,600,488.00	2.85
15	09668	渤海银行	6,500,000	7,251,372.70	2.72
16	000977	浪潮信息	126,200	6,120,700.00	2.30
17	603019	中科曙光	112,900	5,746,610.00	2.16
18	002558	巨人网络	300,400	5,386,172.00	2.02

19	688111	金山办公	10,678	5,042,365.16	1.89
20	300394	天孚通信	47,000	5,021,010.00	1.89
21	002517	恺英网络	294,600	4,637,004.00	1.74
22	000063	中兴通讯	100,300	4,567,662.00	1.72
23	300533	冰川网络	90,500	4,521,380.00	1.70
24	300002	神州泰岳	291,900	4,086,600.00	1.53
25	300570	太辰光	69,300	3,791,403.00	1.42
26	300476	胜宏科技	132,800	3,201,808.00	1.20
27	688676	金盘科技	104,106	3,153,370.74	1.18
28	002919	名臣健康	67,100	3,026,210.00	1.14
29	688361	中科飞测	35,233	2,923,444.50	1.10
30	603108	润达医疗	149,900	2,785,142.00	1.05
31	300750	宁德时代	11,800	2,699,722.00	1.01
32	002709	天赐材料	64,800	2,669,112.00	1.00
33	600602	云赛智联	171,234	2,578,784.04	0.97
34	301291	明阳电气	3,649	118,581.45	0.04
35	301383	天键股份	3,013	112,178.84	0.04
36	301210	金杨股份	2,007	102,693.69	0.04
37	301488	豪恩汽电	2,506	99,688.68	0.04
38	688429	时创能源	3,452	99,565.18	0.04
39	301355	南王科技	4,790	84,988.97	0.03
40	301170	锡南科技	2,215	82,045.02	0.03
41	688631	莱斯信息	2,531	81,985.18	0.03
42	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.03
43	001286	陕西能源	3,767	37,406.31	0.01
44	301358	湖南裕能	527	22,587.22	0.01
45	301363	美好医疗	421	18,519.79	0.01
46	301317	鑫磊股份	694	18,141.16	0.01
47	301310	鑫宏业	230	15,046.60	0.01
48	301280	珠城科技	409	14,625.84	0.01
49	688531	日联科技	104	14,472.64	0.01
50	301408	华人健康	779	13,204.05	0.00
51	301307	美利信	408	13,056.00	0.00
52	001287	中电港	497	12,584.04	0.00
53	301360	荣旗科技	124	11,508.44	0.00
54	688352	顾中科技	898	11,341.74	0.00
55	301141	中科磁业	262	11,190.02	0.00
56	688543	国科军工	202	10,851.44	0.00
57	688484	南芯科技	280	10,819.20	0.00
58	301387	光大同创	236	10,768.68	0.00
59	688334	西高院	625	10,750.00	0.00
60	301246	宏源药业	348	10,687.08	0.00
61	688523	航天环宇	420	10,680.60	0.00

62	688552	航天南湖	430	10,397.40	0.00
63	301225	恒勃股份	302	10,352.56	0.00
64	301429	森泰股份	483	10,234.77	0.00
65	301265	华新环保	770	8,947.40	0.00
66	301373	凌玮科技	277	8,819.68	0.00
67	688535	华海诚科	161	8,814.75	0.00
68	301332	德尔玛	616	8,463.84	0.00
69	688581	安杰思	71	8,383.68	0.00
70	301281	科源制药	316	8,013.76	0.00
71	301157	华塑科技	150	7,938.00	0.00
72	301203	国泰环保	221	7,728.37	0.00
73	301232	飞沃科技	132	7,719.36	0.00
74	300804	广康生化	226	7,480.60	0.00
75	301376	致欧科技	329	7,425.53	0.00
76	688512	慧智微	375	7,211.25	0.00
77	301323	新莱福	166	6,824.26	0.00
78	688623	二元科技	75	6,698.25	0.00
79	001380	华纬科技	170	5,244.50	0.00
80	601133	柏诚股份	311	4,266.92	0.00
81	601065	江盐集团	299	3,764.41	0.00
82	001282	三联锻造	103	3,411.36	0.00
83	603125	常青科技	105	2,783.55	0.00
84	001360	南矿集团	166	2,730.70	0.00
85	603137	恒尚节能	139	2,536.75	0.00
86	001367	海森药业	55	2,340.25	0.00
87	001324	长青科技	114	2,283.42	0.00
88	603172	万丰股份	122	2,034.96	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	300274	阳光电源	19,489,464.60	5.61
2	000977	浪潮信息	17,678,826.88	5.09
3	002121	科陆电子	16,885,855.00	4.86
4	002645	华宏科技	16,798,826.00	4.83
5	688120	华海清科	16,114,228.03	4.64
6	688072	拓荆科技	15,367,290.44	4.42
7	688012	中微公司	15,043,740.95	4.33
8	002865	钧达股份	14,729,379.00	4.24
9	002555	三七互娱	13,722,551.00	3.95
10	688410	山外山	13,701,094.55	3.94
11	002407	多氟多	13,435,150.84	3.87

12	601138	工业富联	13,319,891.00	3.83
13	688226	威腾电气	12,810,887.41	3.69
14	688037	芯源微	12,270,929.86	3.53
15	300118	东方日升	12,027,950.46	3.46
16	002737	葵花药业	11,874,330.00	3.42
17	688153	唯捷创芯	11,650,119.46	3.35
18	300474	景嘉微	11,648,617.51	3.35
19	002368	太极股份	11,523,799.12	3.32
20	688099	晶晨股份	11,126,952.75	3.20
21	300502	新易盛	10,826,945.54	3.12
22	002459	晶澳科技	10,699,816.28	3.08
23	688036	传音控股	10,556,229.81	3.04
24	600602	云赛智联	10,281,857.64	2.96
25	300033	同花顺	10,214,877.00	2.94
26	603993	洛阳钼业	10,178,623.00	2.93
27	300567	精测电子	10,129,855.00	2.92
28	300750	宁德时代	10,082,349.00	2.90
29	301030	仕净科技	10,043,114.00	2.89
30	300533	冰川网络	9,880,424.00	2.84
31	300260	新莱应材	9,651,803.50	2.78
32	002602	世纪华通	9,630,351.00	2.77
33	300308	中际旭创	9,430,151.00	2.71
34	300161	华中数控	9,422,538.00	2.71
35	688256	寒武纪	9,413,976.71	2.71
36	002155	湖南黄金	9,276,439.98	2.67
37	600536	中国软件	9,147,862.00	2.63
38	002174	游族网络	9,029,683.00	2.60
39	688111	金山办公	8,974,981.69	2.58
40	002812	恩捷股份	8,826,854.00	2.54
41	002335	科华数据	8,741,891.00	2.52
42	003035	南网能源	8,619,053.00	2.48
43	300068	南都电源	8,515,461.00	2.45
44	600761	安徽合力	8,408,508.68	2.42
45	01167	加科思-B	8,014,127.46	2.31
46	002222	福晶科技	7,871,981.00	2.27
47	000066	中国长城	7,835,715.00	2.26
48	002324	普利特	7,796,244.38	2.24
49	688381	帝奥微	7,786,236.03	2.24
50	300624	万兴科技	7,742,677.00	2.23
51	688508	芯朋微	7,592,197.10	2.19
52	002965	祥鑫科技	7,559,076.75	2.18
53	688123	聚辰股份	7,488,702.22	2.16
54	002230	科大讯飞	7,352,496.00	2.12

55	600586	金晶科技	7,232,946.00	2.08
56	688019	安集科技	7,215,583.22	2.08
57	600422	昆药集团	7,212,873.00	2.08
58	300476	胜宏科技	7,196,143.00	2.07
59	688676	金盘科技	7,094,634.79	2.04
60	688390	固德威	7,045,048.60	2.03
61	300982	苏文电能	7,042,743.00	2.03
62	002056	横店东磁	7,009,421.00	2.02
63	300174	元力股份	6,995,582.15	2.01

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	002865	钧达股份	24,618,950.00	7.09
2	300274	阳光电源	23,976,920.00	6.90
3	002368	太极股份	22,803,806.40	6.56
4	001269	欧晶科技	20,804,326.50	5.99
5	603613	国联股份	19,326,497.00	5.56
6	600212	绿能慧充	18,765,436.00	5.40
7	688410	山外山	18,006,157.93	5.18
8	002645	华宏科技	16,019,490.00	4.61
9	002737	葵花药业	15,516,655.00	4.47
10	002121	科陆电子	15,323,148.00	4.41
11	688111	金山办公	13,845,193.51	3.98
12	688687	凯因科技	12,454,859.08	3.58
13	688072	拓荆科技	12,363,081.14	3.56
14	688256	寒武纪	12,340,147.31	3.55
15	300118	东方日升	12,239,106.00	3.52
16	002407	多氟多	11,891,615.00	3.42
17	002311	海大集团	11,772,990.08	3.39
18	688099	晶晨股份	11,173,702.03	3.22
19	688390	固德威	11,045,868.38	3.18
20	002324	普利特	11,042,159.00	3.18
21	601369	陕鼓动力	10,742,962.00	3.09
22	300750	宁德时代	10,710,428.00	3.08
23	002602	世纪华通	10,594,993.00	3.05
24	002049	紫光国微	10,507,843.00	3.02
25	000977	浪潮信息	10,386,783.98	2.99
26	300068	南都电源	10,359,288.00	2.98
27	300474	景嘉微	10,252,616.00	2.95

28	301030	仕净科技	9,677,761.00	2.79
29	002459	晶澳科技	9,649,903.65	2.78
30	603993	洛阳钼业	9,575,103.00	2.76
31	603985	恒润股份	9,492,616.32	2.73
32	300260	新莱应材	9,335,484.90	2.69
33	600536	中国软件	9,155,929.80	2.64
34	002230	科大讯飞	8,918,026.00	2.57
35	688665	四方光电	8,730,534.53	2.51
36	300033	同花顺	8,498,329.00	2.45
37	300624	万兴科技	8,462,416.00	2.44
38	600602	云赛智联	8,418,365.00	2.42
39	002812	恩捷股份	8,274,198.00	2.38
40	600761	安徽合力	8,194,323.00	2.36
41	003035	南网能源	7,949,349.05	2.29
42	002174	游族网络	7,912,791.00	2.28
43	688226	威腾电气	7,816,194.16	2.25
44	002335	科华数据	7,771,212.00	2.24
45	002155	湖南黄金	7,769,266.00	2.24
46	603979	金诚信	7,755,096.00	2.23
47	000066	中国长城	7,592,993.00	2.19
48	002056	横店东磁	7,535,510.00	2.17
49	002965	祥鑫科技	7,345,063.00	2.11
50	688019	安集科技	7,219,328.81	2.08
51	01167	加科思-B	7,209,783.14	2.08
52	600586	金晶科技	7,090,692.00	2.04
53	000938	紫光股份	7,011,456.80	2.02

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	1,327,858,294.69
卖出股票收入（成交）总额	1,415,094,624.51

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	14,455,300.44	5.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,455,300.44	5.43

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	019679	22 国债 14	142,000	14,455,300.44	5.43
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 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

本基金所持有的华中数控（002368），其持股 5% 以上股东武汉华中科大资产管理有限公司收到深圳交易所出具监管函的措施，违规类型为未依法履行其他职责。武汉华中科大资产管理有限公司于 2022 年 10 月 18 日通过集中竞价方式减持华中数控股票 4.9 万股，占华中数控总股本的 0.02%，成交金额为 112.04 万元。该减持行为距离 2022 年 9 月 26 日华中数控披露《关于持股 5%

以上股东股份减持计划的预披露公告》的减持计划公告日不足十五个交易日。该行为违反了深圳证券交易所《创业板股票上市规则（2020 年 12 月修订）》第 1.4 条、第 2.3.1 条和《上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》第十三条的规定。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的三七互娱（002555），其公司本身、公司实际控制人兼董事长李卫伟先生和公司副董事长曾开天先生于 2023 年 6 月 27 日分别收到中国证券监督管理委员会下发的《中国证券监督管理委员会立案告知书》。因涉嫌信息披露违法违规，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，证监会决定对公司、李卫伟和曾开天立案。根据公司公告，目前公司各项经营活动正常有序开展。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

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

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

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

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

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

本基金投资华中数控主要基于以下原因：公司为国内高档机床数控系统的优质企业，未来将受益于国内工业母机、数控系统国产化率的持续提升。

本基金投资三七互娱主要基于以下原因：公司为国内网络游戏研发领先企业，随着游戏版号的发行以及公司在研产品的储备，公司经营业绩有望持续增长。

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	254,553.23
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,878.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	259,432.17

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

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 (%)
东方鑫享价值成长一年持有期混合 A	4,075	50,530.17	-	-	205,910,435.55	100.00
东方鑫享价值成长一年持有期混合 C	3,148	39,290.26	10,013,500.00	8.10	113,672,223.09	91.90
合计	7,223	45,631.48	10,013,500.00	3.04	319,582,658.64	96.96

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	东方鑫享价值成长一年持有期混合 A	31,770.74	0.02
	东方鑫享价值成长一年持有期混合 C	206,866.82	0.17

	合计	238,637.56	0.07
--	----	------------	------

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	东方鑫享价值成长一年持有期混合 A	0
	东方鑫享价值成长一年持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东方鑫享价值成长一年持有期混合 A	0~10
	东方鑫享价值成长一年持有期混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方鑫享价值成长一年持有期混合 A	东方鑫享价值成长一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2021年5月19日) 基金份额总额	166,239,559.90	84,137,426.41
本报告期期初基金份额总额	267,998,385.36	160,367,927.94
本报告期基金总申购份额	1,166,602.10	740,866.83
减：本报告期基金总赎回份额	63,254,551.91	37,423,071.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	205,910,435.55	123,685,723.09

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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，基金托管人及其高级管理人员未受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 (%)	
中国国际金融股份有限公司	2	1,003,667,115.20	36.67	935,223.10	39.11	-
安信证券股份有限公司	2	798,943,306.06	29.19	585,082.66	24.47	-
华安证券股份有限公司	2	606,571,896.66	22.16	565,456.98	23.65	-
西南证券股份有限公司	2	247,618,388.12	9.05	230,606.87	9.64	-

公司						
华创证券 有限责任 公司	2	80,282,403.3 2	2.93	74,768.14	3.13	-

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

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

（3）本报告期内本基金新增西南证券深圳交易单元一个。

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(%)
中国国际金融股份有限公司	3,396,394.00	13.38	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2,299,432.00	9.06	-	-	-	-
华安证券股份	1,397,648.00	5.51	-	-	-	-

有限公司						
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	18,295,115.00	72.06	-	-	-	-

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	东方鑫享价值成长一年持有期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	关于增加平安银行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、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 9 日
3	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
4	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变更公告	证券时报、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
5	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
6	东方鑫享价值成长一年持有期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 27 日
7	东方鑫享价值成长一年持有期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 27 日
8	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
9	关于增加深圳新华信通基金销售有限	证券时报、证券日报、	2023 年 3 月 9 日

	公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	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	
10	东方鑫享价值成长一年持有期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	东方鑫享价值成长一年持有期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	东方鑫享价值成长一年持有期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 6 月 30 日
16	东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金 招募说明书(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 6 月 30 日
17	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、《东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方鑫享价值成长一年持有期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）查阅。

东方基金管理股份有限公司

2023 年 8 月 31 日