

# 东方红目标优选三年定期开放混合型证券 投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 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。本中期报告由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 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                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 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内容的真实、准确和完整发表意见       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 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                     | 46        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 48        |
| 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      | 48        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 48        |
| 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 ..... | 48        |
| 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 .....    | 48        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 48        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 49        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 49        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 51        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51        |
| 8.4 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 .....      | 51        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>51</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>52</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 52        |
| 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 .....      | 52        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 52        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 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 .....         | 52        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 52        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 55        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>56</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 56        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 56        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>56</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 56        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 56        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 57        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                               |
|--------------|-------------------------------|
| 基金名称         | 东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金        |
| 基金简称         | 东方红目标优选定开混合                   |
| 场内简称         | 东证目优（扩位证券简称：东方红目标优选）          |
| 基金主代码        | 501053                        |
| 基金运作方式       | 契约型，定期开放式，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式 |
| 基金合同生效日      | 2017 年 12 月 18 日              |
| 基金管理人        | 上海东方证券资产管理有限公司                |
| 基金托管人        | 招商银行股份有限公司                    |
| 报告期末基金份额总额   | 990,420,849.60 份              |
| 基金合同存续期      | 不定期                           |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                       |
| 上市日期         | 2018 年 8 月 24 日               |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求资产净值的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                |
| 投资策略   | 本基金主要投资于固定收益类资产，本基金的投资策略将结合基金每三年开放一次，在封闭期封闭运作，在开放期内有大规模申购赎回的流动性需求的特点，做好流动性管理，在临近开放期和开放期内，更多的关注组合资产的流动性；在封闭期内，充分发挥封闭运作的优势，做一些长久期匹配。基于本基金每满三年开放一次，除开放期外封闭运作的特点，基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力，分散投资，做好流动性管理以应对开放期投资者的赎回需求。                                  |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%                                                                                                                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|
|----|-------|-------|

|             |                            |                      |
|-------------|----------------------------|----------------------|
| 名称          | 上海东方证券资产管理有限公司             | 招商银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                         | 李云亮                  |
|             | 联系电话                       | 021-63325888         |
|             | 电子邮箱                       | service@dfham.com    |
| 客户服务电话      | 4009200808                 | 95555                |
| 传真          | 021-63326981               | 0755-83195201        |
| 注册地址        | 上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层      | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 办公地址        | 上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码        | 200010                     | 518040               |
| 法定代表人       | 潘鑫军                        | 李建红                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                           |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报                                                                     |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.dfham.com                                                             |
| 基金中期报告备置地点          | 上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层<br>招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址               |
|--------|----------------|--------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 中国北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# § 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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 48,590,927.98                       |
| 本期利润          | 19,581,410.19                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0198                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.86%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.84%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 54,664,952.85                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0552                              |
| 期末基金资产净值      | 1,045,085,802.45                    |
| 期末基金份额净值      | 1.0552                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 20.48%                              |

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.58%    | 0.17%       | 0.74%      | 0.19%         | -0.16% | -0.02% |
| 过去三个月      | 1.12%    | 0.19%       | 1.66%      | 0.20%         | -0.54% | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.84%    | 0.32%       | 1.20%      | 0.29%         | 0.64%  | 0.03%  |
| 过去一年       | 8.46%    | 0.28%       | 3.55%      | 0.23%         | 4.91%  | 0.05%  |
| 自基金合同生效起至今 | 20.48%   | 0.30%       | 7.50%      | 0.26%         | 12.98% | 0.04%  |

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（benchmark<sub>t</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 80\% * [\text{t 日中债综合指数} / (\text{t-1 日中债综合指数}) - 1] + 20\% * [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1];$$

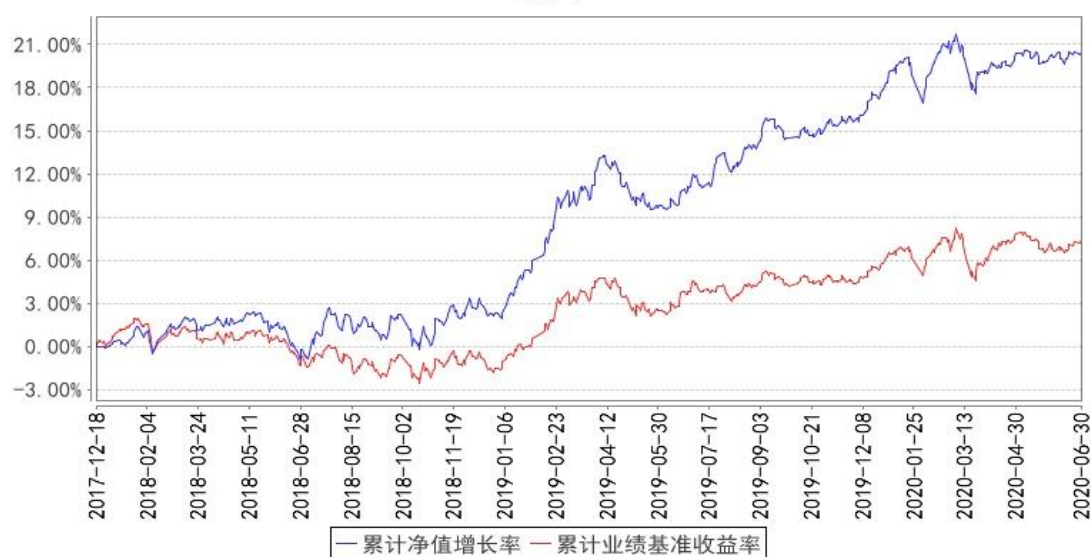
期间 T 日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

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

$\prod (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $(1 + \text{benchmark}_t)$  的数学连乘。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红目标优选定开混合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

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方



红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）及东方红智远三年持有期混合型证券投资基金共计 49 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                                    | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|----|---------------------------------------|------------------|------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                       | 任职日期             | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 饶刚 | 上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼固定收益研究部总经理、本基金基金经理 | 2017 年 12 月 18 日 | -    | 21 年   | 上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼固定收益研究部总经理、2016 年 07 月至今任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2016 年 07 月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016 年 07 月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2017 年 12 月至今任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 03 月至今任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理。复旦大学理学硕士。历任兴业证券股份有限公司职员，富国基金管理有限公司研究员、固定 |

|          |                                      |                 |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|----------|--------------------------------------|-----------------|---|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|          |                                      |                 |   |      | 收益部总经理兼基金经理、总经理助理，富国资产管理（上海）有限公司总经理。具备证券投资基金从业资格。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 徐 觅      | 上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部总经理助理、本基金基金经理 | 2018 年 3 月 30 日 | - | 13 年 | 上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部总经理助理、2016 年 12 月至今任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2017 年 09 月至今任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2017 年 09 月至 2020 年 05 月任东方红货币市场基金基金经理、2018 年 03 月至今任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 05 月至今任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018 年 10 月至今任东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至今任东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。复旦大学工商管理硕士。历任长信基金管理有限责任公司基金事务部基金会计、交易管理部债券交易员，广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员，富国基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司私募固定收益投资部投资经理。具备证券投资基金从业资格。 |
| 孔 令<br>超 | 上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部总经理助理、本基金基金经理   | 2018 年 3 月 30 日 | - | 9 年  | 上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部总经理助理、2016 年 08 月至今任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2018 年 03 月至今任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 05 月至今任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018 年 06 月至今任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 06 月至今任东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2018 年 07 月至今任东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理、2019 年 09 月至今任东方红聚利债券型证                                                                                                                                                     |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                        |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 券投资基金基金经理、2020 年 01 月至今任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。北京大学金融学硕士。历任平安证券有限责任公司总部综合研究所策略研究员，国信证券股份有限公司经济研究所策略研究研究员，上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部基金经理。具备证券投资基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债券方面，上半年疫情防治进展对市场影响较大；一季度标志性的 10Y 国债收益率曾突破 2008 年金融危机时的水平，央行也采取下调存款准备金率、降低商业银行超额准备金利率等措施，以应对经济下行压力。二季度随着疫情得到有效防控，我国经济的韧性与活力逐步体现。虽然部分政策工具适时退出，但在央行努力下，市场流动性仍然保持充裕，信贷和社融明显增长，前期过于乐观的债券定价水平也得到一定修正。组合配置以投资级信用债为主，久期较短，较好的规避了后续收益率上行的冲击。

权益方面，上半年市场整体走势分化，上证综指下跌 2.15%，创业板表现更加突出，创业板指上半年上涨 35.6%。新冠疫情的出现超出了市场预期，在这种环境下，多数上市公司的盈利受到了一定程度的冲击；但另一方面，疫情冲击的环境下流动性较为宽松，一些长期成长空间较为广阔的公司估值水平出现了较为明显的提升。我们逐步降低了一些估值偏高的行业的配置，增加了一些虽然短期受到冲击、但长期竞争优势明显的行业龙头的配置。

转债方面，上半年中证转债指数下跌 1.84%。转债整体的估值相比年初有一定的压缩，结构分化仍然较大。本基金前期持有的一些转债逐步实现了换股收益，同时自下而上精选一些优质的新发转债进行配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.0552 元，份额累计净值为 1.1952 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.84%，业绩比较基准收益率为 1.20%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，疫情逐步得到有效防控，国内政策的着眼点转向就业和增长，阶段性通胀和金融风险需要关注。在市场达成新的均衡水平过程中，组合仍维持投资级信用债的配置为主，以获取票息为目的，并适度拉长组合久期。我们也将继续发挥团队信用研究的传统优势，坚持自下而上的个体研究，着重调研具有竞争优势的产业龙头和政策支持地区的城投债，努力为持有人获取长期、稳健的回报。

权益方面，随着疫情带来的不确定性逐渐消退，在疫情不会二次爆发的情景下，宏观环境将逐渐回归正常路径。另外，中美关系也会带来一定的不确定性。目前市场估值分化较大，未来我们仍然坚持价值投资理念，自下而上精选估值合理的优质公司进行配置，同时关注一些估值水平处于历史低位、股息回报率已经较高的大盘蓝筹公司。

目前转债的整体估值水平相对合理，结构性分化较大，有一些转债开始具备较好的投资价值。长期来看我们仍然认为可转债是非常优秀的投资品种，未来主要考虑股票本身资质和转债的溢价水平，在转债市场中选择一些优质的转债品种进行配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 3、本基金收益分配方式仅现金分红一种方式；
- 4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本报告期内本基金进行了两次利润分配：

报告期内，本基金实施利润分配 2 次，利润分配合计为 29,712,874.44 元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 13,856,901.46          | 18,230,746.54            |
| 结算备付金       |         | 13,194,287.35          | 18,852,717.90            |
| 存出保证金       |         | 566,813.77             | 60,240.53                |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 1,113,585,466.58       | 1,347,632,578.91         |
| 其中：股票投资     |         | 169,168,855.68         | 241,337,872.27           |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | 921,115,046.52         | 1,079,395,942.26         |

|                 |            |                                |                                  |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产支持证券投资        |            | 23,301,564.38                  | 26,898,764.38                    |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 55,238,530.71                  | 44,463,292.33                    |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 19,407,684.71                  | 22,591,607.77                    |
| 应收股利            |            | 1,781,390.60                   | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,217,631,075.18               | 1,451,831,183.98                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 123,000,000.00                 | 342,640,703.60                   |
| 应付证券清算款         |            | 48,439,570.37                  | 51,964,970.98                    |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 600,631.00                     | 619,744.87                       |
| 应付托管费           |            | 171,608.85                     | 177,069.97                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 34,140.16                      | 478,133.08                       |
| 应交税费            |            | 90,923.97                      | 147,554.24                       |
| 应付利息            |            | -                              | 366,740.54                       |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 208,398.38                     | 219,000.00                       |
| 负债合计            |            | 172,545,272.73                 | 396,613,917.28                   |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 990,420,849.60                 | 990,420,849.60                   |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 54,664,952.85                  | 64,796,417.10                    |
| 所有者权益合计         |            | 1,045,085,802.45               | 1,055,217,266.70                 |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,217,631,075.18               | 1,451,831,183.98                 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0552 元，基金份额总额 990,420,849.60 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年<br>6 月 30 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入                   |            | 26,984,267.85                            | 98,317,776.67                                 |
| 1. 利息收入                |            | 23,390,448.67                            | 32,231,150.73                                 |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 153,900.38                               | 254,638.91                                    |
| 债券利息收入                 |            | 22,576,444.23                            | 31,976,511.82                                 |
| 资产支持证券利息收入             |            | 659,221.32                               | -                                             |
| 买入返售金融资产收入             |            | 882.74                                   | -                                             |
| 证券出借利息收入               |            | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                 |            | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 32,603,336.97                            | 38,588,986.32                                 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 17,644,450.94                            | 13,617,530.28                                 |
| 基金投资收益                 | -          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 11,179,353.20                            | 22,998,884.98                                 |
| 资产支持证券投资收益             | 6.4.7.13.5 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | 3,779,532.83                             | 1,972,571.06                                  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -29,009,517.79                           | 27,497,639.62                                 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | -                                        | -                                             |
| 减：二、费用                 |            | 7,402,857.66                             | 13,454,226.08                                 |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 3,671,488.34                             | 3,626,805.68                                  |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,048,996.67                             | 1,036,230.17                                  |
| 3. 销售服务费               | -          | -                                        | -                                             |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 296,482.81                               | 441,323.99                                    |
| 5. 利息支出                |            | 2,171,376.50                             | 8,108,088.71                                  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 2,171,376.50                             | 8,108,088.71                                  |
| 6. 税金及附加               |            | 77,423.25                                | 98,553.35                                     |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 137,090.09                               | 143,224.18                                    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 19,581,410.19                            | 84,863,550.59                                 |
| 减：所得税费用                |            | -                                        | -                                             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 19,581,410.19                            | 84,863,550.59                                 |



### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日      |                |                  |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|------------------|
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 990,420,849.60                             | 64,796,417.10  | 1,055,217,266.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | 19,581,410.19  | 19,581,410.19    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -                                          | -              | -                |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                                          | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                               | -                                          | -              | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                          | -29,712,874.44 | -29,712,874.44   |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 990,420,849.60                             | 54,664,952.85  | 1,045,085,802.45 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                |                  |
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 990,420,849.60                             | 3,197,214.56   | 993,618,064.16   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | 84,863,550.59  | 84,863,550.59    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数                   | -                                          | -              | -                |

|                                        |                |                |                  |
|----------------------------------------|----------------|----------------|------------------|
| (净值减少以“-”号填列)                          |                |                |                  |
| 其中：1. 基金申购款                            | -              | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                               | -              | -              | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -              | -34,664,947.19 | -34,664,947.19   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 990,420,849.60 | 53,395,817.96  | 1,043,816,667.56 |

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：

任莉

汤琳

陈培

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2070号《关于准予东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准，由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 990,337,609.47 元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 1092 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金》于 2017 年 12 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 990,420,849.6 份基金份额，其中认购资金利息折合 83,240.13 份基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为基金合同生效日所对应的第三年年度对应日前的倒数第一个工作日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日，结束之日

为第二个封闭期起始之日所对应的第三年年度对应日前的倒数第一个工作日，依此类推。本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起(即每个开放期首日为每个封闭期起始之日的第三年年度对应日，包括该工作日)进入开放期，期间可以办理申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]115 号核准，本基金 4,381,323.00 份基金份额于 2018 年 8 月 24 日在上交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司短期公司债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金的基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%-30%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%)，权证投资比例为基金资产的 0%-3%；开放期每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 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。

(3) 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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 13,856,901.46          |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 定期存款           | -             |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -             |
| 存款期限 1-3 个月    | -             |
| 存款期限 3 个月以上    | -             |
| 其他存款           | -             |
| 合计             | 13,856,901.46 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                  |                |
|---------------|------------------------|------------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            | 187,965,769.15         | 169,168,855.68   | -18,796,913.47 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | 647,159,448.26   | 649,721,046.52 |
|               | 银行间市场                  | 265,968,502.93   | 271,394,000.00 |
|               | 合计                     | 913,127,951.19   | 921,115,046.52 |
| 资产支持证券        | 23,301,564.38          | 23,301,564.38    | -              |
| 基金            | -                      | -                | -              |
| 其他            | -                      | -                | -              |
| 合计            | 1,124,395,284.72       | 1,113,585,466.58 | -10,809,818.14 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

注：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

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------|
| 应收活期存款利息  | 1,460.89               |
| 应收定期存款利息  | -                      |
| 应收其他存款利息  | -                      |
| 应收结算备付金利息 | 5,967.46               |

|            |               |
|------------|---------------|
| 应收债券利息     | 19,006,251.54 |
| 应收资产支持证券利息 | 393,955.85    |
| 应收买入返售证券利息 | —             |
| 应收申购款利息    | —             |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —             |
| 应收出借证券利息   | —             |
| 其他         | 48.97         |
| 合计         | 19,407,684.71 |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 33,790.16              |
| 银行间市场应付交易费用 | 350.00                 |
| 合计          | 34,140.16              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 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   | —                      |
| 预提费用        | 208,398.38             |
| 合计          | 208,398.38             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 990,420,849.60                        | 990,420,849.60 |
| 本期申购          | —                                     | —              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | —                                     | —              |
| 本期末           | 990,420,849.60                        | 990,420,849.60 |

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目       | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计       |
|----------|---------------|----------------|---------------|
| 上年度末     | 46,596,717.45 | 18,199,699.65  | 64,796,417.10 |
| 本期利润     | 48,590,927.98 | -29,009,517.79 | 19,581,410.19 |
| 本期基金份额交易 | —             | —              | —             |

|          |                |                |                |
|----------|----------------|----------------|----------------|
| 产生的变动数   |                |                |                |
| 其中：基金申购款 | -              | -              | -              |
| 基金赎回款    | -              | -              | -              |
| 本期已分配利润  | -29,712,874.44 | -              | -29,712,874.44 |
| 本期末      | 65,474,770.99  | -10,809,818.14 | 54,664,952.85  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 47,188.32                             |
| 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 | 106,217.51                            |
| 其他        | 494.55                                |
| 合计        | 153,900.38                            |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 17,644,450.94              |
| 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               | 17,644,450.94              |

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 119,600,145.05                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 101,955,694.11                        |
| 买卖股票差价收入   | 17,644,450.94                         |

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益-证券出借差价收入。



#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 11,179,353.20              |
| 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                            | 11,179,353.20              |

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 359,731,174.04             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 338,155,032.15             |
| 减：应收利息总额                | 10,396,788.69              |
| 买卖债券差价收入                | 11,179,353.20              |

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 4,148,323.00               |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 3,597,200.00               |
| 减：应收利息总额       | 551,123.00                 |
| 资产支持证券投资收益     | —                          |

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 3,779,532.83                          |
| 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            | 3,779,532.83                          |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -29,009,517.79                        |

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| 股票投资                   | -19,043,201.34 |
| 债券投资                   | -9,966,316.45  |
| 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                     | -29,009,517.79 |

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 295,332.81                            |
| 银行间市场交易费用 | 1,150.00                              |
| 合计        | 296,482.81                            |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 49,726.04                             |
| 信息披露费   | 59,672.34                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行费用    | 9,091.71                              |
| 账户维护费   | 18,600.00                             |
| 合计      | 137,090.09                            |

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2020 年 8 月 20 日宣告 2020 年度第 3 次分红，向截至 2020 年 8 月 25 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金

份额派发红利 0.2 元。

#### 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

本基金报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

##### 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         |
|------------------------|-----------------|
| 上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”） | 基金管理人、基金销售机构    |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）     | 基金托管人、基金销售机构    |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 东方证券  | 91,254,307.98                         | 59.91                   | 218,841,750.56                             | 69.12                   |

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                                       | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 东方证券  | 385,494,461.62                        | 99.61                   | 537,798,257.93                             | 84.39                   |

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                         |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                                       | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |

|      | 成交金额              | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额              | 占当期债券回购<br>成交总额的比例<br>(%) |
|------|-------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|
| 东方证券 | 12,775,500,000.00 | 89.59                     | 14,938,800,000.00 | 69.93                     |

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 东方证券  | 67,620.87                       | 60.89              | 19,224.09    | 56.89                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 东方证券  | 160,516.73                      | 69.65              | 372,941.06   | 89.50                |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

#### 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<br>2020年1月1日至2020年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,671,488.34                   | 3,626,805.68                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,869,455.92                   | 1,849,479.11                        |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,048,996.67                          | 1,036,230.17                               |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。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

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

##### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未有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。

#### 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

注：本基金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

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 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    |
| 招商银行  | 13,856,901.46                         | 47,188.32 | 13,421,491.48                              | 77,642.15 |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日             | 除息日                       |                       | 每 10 份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投<br>资形<br>式<br>发放<br>总额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|-----------------------|---------------------------|-----------------------|-----------------------|---------------|---------------------------|---------------|----|
|    |                       | 场内                        | 场外                    |                       |               |                           |               |    |
| 1  | 2020<br>年 3 月<br>6 日  | 2020<br>年 03<br>月 09<br>日 | 2020<br>年 3 月<br>6 日  | 0.2000                | 19,808,576.71 | -                         | 19,808,576.71 | -  |
| 2  | 2020<br>年 6 月<br>12 日 | 2020<br>年 06<br>月 15<br>日 | 2020<br>年 6 月<br>12 日 | 0.1000                | 9,904,297.73  | -                         | 9,904,297.73  | -  |
| 合计 | -                     | -                         | -                     | 0.3000                | 29,712,874.44 | -                         | 29,712,874.44 | -  |

注：本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项。

#### 6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |                  |        |       |        |          |              |              |    |
|----------------------|------|-----------------|------------------|--------|-------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 可流通日             | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
| 300840               | 酷特智能 | 2020 年 6 月 30 日 | 2020 年 7 月 8 日   | 新股未上市  | 5.94  | 5.94   | 1,185    | 7,038.90     | 7,038.90     | -  |
| 300843               | 胜蓝股份 | 2020 年 6 月 23 日 | 2020 年 7 月 2 日   | 新股未上市  | 10.01 | 10.01  | 751      | 7,517.51     | 7,517.51     | -  |
| 300845               | 捷安高科 | 2020 年 6 月 24 日 | 2020 年 7 月 3 日   | 新股未上市  | 17.63 | 17.63  | 470      | 8,286.10     | 8,286.10     | -  |
| 300846               | 首都在线 | 2020 年 6 月 22 日 | 2020 年 7 月 1 日   | 新股未上市  | 3.37  | 3.37   | 1,131    | 3,811.47     | 3,811.47     | -  |
| 601816               | 京沪高铁 | 2020 年 1 月 8 日  | 2020 年 7 月 16 日  | 新股流通受限 | 4.88  | 6.17   | 906,536  | 4,423,895.68 | 5,593,327.12 | -  |
| 688027               | 国盾量子 | 2020 年 6 月 30 日 | 2020 年 7 月 9 日   | 新股未上市  | 36.18 | 36.18  | 2,830    | 102,389.40   | 102,389.40   | -  |
| 688277               | 天智航  | 2020 年 6 月 24 日 | 2020 年 7 月 7 日   | 新股未上市  | 12.04 | 12.04  | 8,810    | 106,072.40   | 106,072.40   | -  |
| 688377               | 迪威尔  | 2020 年 6 月 29 日 | 2020 年 7 月 8 日   | 新股未上市  | 16.42 | 16.42  | 7,894    | 129,619.48   | 129,619.48   | -  |
| 688520               | 神州细胞 | 2020 年 6 月 11 日 | 2020 年 12 月 22 日 | 新股流通受限 | 25.64 | 58.82  | 12,351   | 316,679.64   | 726,485.82   | -  |
| 688528               | 秦川物联 | 2020 年 6 月 19 日 | 2020 年 7 月 1 日   | 新股未上市  | 11.33 | 11.33  | 8,337    | 94,458.21    | 94,458.21    | -  |
| 688568               | 中科星图 | 2020 年 6 月      | 2020 年 7 月       | 新股未上市  | 16.21 | 16.21  | 11,020   | 178,634.20   | 178,634.20   | -  |



|        |      |                 |                |       |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------|----------------|-------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      | 30 日            | 8 日            |       |       |       |       |           |           |   |
| 688600 | 皖仪科技 | 2020 年 6 月 23 日 | 2020 年 7 月 3 日 | 新股未上市 | 15.50 | 15.50 | 5,468 | 84,754.00 | 84,754.00 | - |

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、本基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 123,000,000.00 元，截至 2020 年 7 月 3 日先后到期，该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无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

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及的各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险

进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案等。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

##### 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<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 20,041,000.00          | 10,017,000.00            |
| A-1 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | 50,150,000.00          | 60,218,000.00            |
| 合计     | 70,191,000.00          | 70,235,000.00            |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

##### 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<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 23,301,564.38          | 26,898,764.38            |
| A-1 以下 | —                      | —                        |

|     |               |               |
|-----|---------------|---------------|
| 未评级 | -             | -             |
| 合计  | 23,301,564.38 | 26,898,764.38 |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 443,496,823.02         | 443,929,896.76           |
| AAA 以下 | 356,732,223.50         | 475,185,045.50           |
| 未评级    | 50,695,000.00          | 90,046,000.00            |
| 合计     | 850,924,046.52         | 1,009,160,942.26         |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2020 年 6 月 30 日, 除卖出回购金融资产款余额中有 123,000,000.00 元将一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外, 本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%, 于开放期内, 本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%, 本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日, 本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内, 本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 6 月 30 日, 本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年6月30<br>日 | 1个月以内         | 1-3个月         | 3个月-1年         | 1-5年           | 5年以上     | 不计息            | 合计               |
|-----------------------|---------------|---------------|----------------|----------------|----------|----------------|------------------|
| 资产                    |               |               |                |                |          |                |                  |
| 银行存款                  | 13,856,901.46 | -             | -              | -              | -        | -              | 13,856,901.46    |
| 结算备付金                 | 13,194,287.35 | -             | -              | -              | -        | -              | 13,194,287.35    |
| 存出保证金                 | 566,813.77    | -             | -              | -              | -        | -              | 566,813.77       |
| 交易性金融资产               | 80,350,000.00 | 91,025,235.00 | 481,409,425.28 | 291,630,620.82 | 1,329.80 | 169,168,855.68 | 1,113,585,466.58 |
| 买入返售金融资产              | -             | -             | -              | -              | -        | -              | -                |
| 应收利息                  | -             | -             | -              | -              | -        | 19,407,684.71  | 19,407,684.71    |
| 应收股利                  | -             | -             | -              | -              | -        | 1,781,390.60   | 1,781,390.60     |
| 应收申购款                 | -             | -             | -              | -              | -        | -              | -                |
| 应收证券清算款               | -             | -             | -              | -              | -        | 55,238,530.71  | 55,238,530.71    |

|                          |                |               |                |                |               |                |                  |
|--------------------------|----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 其他资产                     | -              | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 资产总计                     | 107,968,002.58 | 91,025,235.00 | 481,409,425.28 | 291,630,620.82 | 1,329.80      | 245,596,461.70 | 1,217,631,075.18 |
| 负债                       |                |               |                |                |               |                |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应付管理人报酬                  | -              | -             | -              | -              | -             | 600,631.00     | 600,631.00       |
| 应付托管费                    | -              | -             | -              | -              | -             | 171,608.85     | 171,608.85       |
| 应付证券清算款                  | -              | -             | -              | -              | -             | 48,439,570.37  | 48,439,570.37    |
| 卖出回购金融资产款                | 123,000,000.00 | -             | -              | -              | -             | -              | 123,000,000.00   |
| 应付销售服务费                  | -              | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应付交易费用                   | -              | -             | -              | -              | -             | 34,140.16      | 34,140.16        |
| 应付利息                     | -              | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应付利润                     | -              | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应交税费                     | -              | -             | -              | -              | -             | 90,923.97      | 90,923.97        |
| 其他负债                     | -              | -             | -              | -              | -             | 208,398.38     | 208,398.38       |
| 负债总计                     | 123,000,000.00 | -             | -              | -              | -             | 49,545,272.73  | 172,545,272.73   |
| 利率敏感度缺口                  | -15,031,997.42 | 91,025,235.00 | 481,409,425.28 | 291,630,620.82 | 1,329.80      | 196,051,188.97 | 1,045,085,802.45 |
| 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 | 1 个月以内         | 1-3 个月        | 3 个月-1 年       | 1-5 年          | 5 年以上         | 不计息            | 合计               |
| 资产                       |                |               |                |                |               |                |                  |
| 银行存款                     | 18,230,746.54  | -             | -              | -              | -             | -              | 18,230,746.54    |
| 结算备付金                    | 18,852,717.90  | -             | -              | -              | -             | -              | 18,852,717.90    |
| 存出保证金                    | 60,240.53      | -             | -              | -              | -             | -              | 60,240.53        |
| 交易性金融资产                  | -              | 80,191,000.00 | 382,105,747.08 | 602,988,959.56 | 41,009,000.00 | 241,337,872.27 | 1,347,632,578.91 |
| 买入返售金融资产                 | -              | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应收利息                     | -              | -             | -              | -              | -             | 22,591,607.77  | 22,591,607.77    |
| 应收股利                     | -              | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应收申购款                    | -              | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应收证券清算款                  | -              | -             | -              | -              | -             | 44,463,292.33  | 44,463,292.33    |

|           |                 |               |                |                |               |                |                  |
|-----------|-----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 其他资产      | -               | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 资产总计      | 37,143,704.97   | 80,191,000.00 | 382,105,747.08 | 602,988,959.56 | 41,009,000.00 | 308,392,772.37 | 1,451,831,183.98 |
| 负债        |                 |               |                |                |               |                |                  |
| 应付赎回款     | -               | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应付管理人报酬   | -               | -             | -              | -              | -             | 619,744.87     | 619,744.87       |
| 应付托管费     | -               | -             | -              | -              | -             | 177,069.97     | 177,069.97       |
| 应付证券清算款   | -               | -             | -              | -              | -             | 51,964,970.98  | 51,964,970.98    |
| 卖出回购金融资产款 | 281,599,703.60  | 61,041,000.00 | -              | -              | -             | -              | 342,640,703.60   |
| 应付销售服务费   | -               | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应付交易费用    | -               | -             | -              | -              | -             | 478,133.08     | 478,133.08       |
| 应付利息      | -               | -             | -              | -              | -             | 366,740.54     | 366,740.54       |
| 应付利润      | -               | -             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应交税费      | -               | -             | -              | -              | -             | 147,554.24     | 147,554.24       |
| 其他负债      | -               | -             | -              | -              | -             | 219,000.00     | 219,000.00       |
| 负债总计      | 281,599,703.60  | 61,041,000.00 | -              | -              | -             | 53,973,213.68  | 396,613,917.28   |
| 利率敏感度缺口   | -244,455,998.63 | 19,150,000.00 | 382,105,747.08 | 602,988,959.56 | 41,009,000.00 | 254,419,558.69 | 1,055,217,266.70 |

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 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
|    | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                    | 本期末（2020年6月30日）             | 上年度末（2019年12月31日） |
| 分析 | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 3,460,313.30                | 5,724,514.29      |

|  |                     |                  |                  |
|--|---------------------|------------------|------------------|
|  | 2. 市场利率上升 25<br>个基点 | -3, 431, 125. 86 | -5, 661, 398. 13 |
|--|---------------------|------------------|------------------|

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

##### 6. 4. 13. 4. 2. 1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目                    | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日   |                  |                |                  |
|-----------------------|--------------------------|------------------|----------------|------------------|
|                       | 美元<br>折合人民币<br>元         | 港币<br>折合人民币元     | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计               |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |                  |                |                  |
| 交易性金融资产               | -                        | 41, 363, 542. 00 | -              | 41, 363, 542. 00 |
| 资产合计                  | -                        | 41, 363, 542. 00 | -              | 41, 363, 542. 00 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |                  |                |                  |
| 负债合计                  | -                        | -                | -              | -                |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | 41, 363, 542. 00 | -              | 41, 363, 542. 00 |
| 项目                    | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |                  |                |                  |
|                       | 美元<br>折合人民币<br>元         | 港币<br>折合人民币元     | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计               |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |                  |                |                  |
| 交易性金融资产               | -                        | 59, 086, 520. 00 | -              | 59, 086, 520. 00 |
| 资产合计                  | -                        | 59, 086, 520. 00 | -              | 59, 086, 520. 00 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |                  |                |                  |
| 负债合计                  | -                        | -                | -              | -                |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | 59, 086, 520. 00 | -              | 59, 086, 520. 00 |



|   |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|
| 额 |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率外其他市场变量保持不变 |                                 |                        |
|----|----------------|---------------------------------|------------------------|
|    | 相关风险变量的变动      | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                | 本期末（2020 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 1、港币相对人民币升值 5% | 2,068,177.10                    | 2,954,326.00           |
|    | 2、港币相对人民币贬值 5% | -2,068,177.10                   | -2,954,326.00          |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

##### 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<br>2020 年 6 月 30 日 |              | 上年度末<br>2019 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  | 169,168,855.68         | 16.19        | 241,337,872.27           | 22.87        |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —            | —                        | —            |
| 交易性金融资产—债券投资  | —                      | —            | —                        | —            |
| 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 | 169,168,855.68 | 16.19 | 241,337,872.27 | 22.87 |
|----|----------------|-------|----------------|-------|

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|-------------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 相关风险变量的变动               | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                         | 本期末（2020 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 1. 沪深 300 指数上升 5%       | 8,857,650.23                | 10,585,458.03          |
|    | 2. 沪深 300 指数下降 5%       | -8,857,650.23               | -10,585,458.03         |

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型 (CAPM) 对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准对应的股票市场指数 (沪深 300) 价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

|    |                       |                      |                        |
|----|-----------------------|----------------------|------------------------|
| 分析 | 1. 置信区间百分之九十五         |                      |                        |
|    | 2. 观察期统计日之前的 250 个交易日 |                      |                        |
|    | 风险价值<br>(单位：人民币元)     | 本期末（2020 年 6 月 30 日） | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
|    | 1 天                   | 4,073,059.11         | 5,425,713.60           |
|    | 1 周                   | 8,983,123.75         | 12,132,264.44          |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 176,035,724.67 元，第二层次的余额为 914,248,177.53 元，第三层次的余额为 23,301,564.38 元（2019 年 12 月 31 日：第一层次 278,015,697.62 元，第二层次：1,042,718,116.91 元，第三层次：26,898,764.38 元）。

(ii) 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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具为 23,301,564.38 元（2019 年 12 月 31 日：26,898,764.38 元）。本基金本期净转出第三层次的金额为 3,597,200.00 元（2019 年同期：无），计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为 0 元（2019 年同期：无）。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2019 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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   | 169,168,855.68 | 13.89         |
|    | 其中：股票  | 169,168,855.68 | 13.89         |
| 2  | 基金投资   | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资 | 944,416,610.90 | 77.56         |
|    | 其中：债券  | 921,115,046.52 | 75.65         |
|    | 资产支持证券 | 23,301,564.38  | 1.91          |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 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      | 27,051,188.81    | 2.22   |
| 8 | 其他各项资产            | 76,994,419.79    | 6.32   |
| 9 | 合计                | 1,217,631,075.18 | 100.00 |

注：1、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 41,363,542.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 3.96%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 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              | 5,768,000.00   | 0.55         |
| C  | 制造业              | 64,518,144.98  | 6.17         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32      | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 6,201,000.00   | 0.59         |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 8,580,109.15   | 0.82         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,946,731.77   | 0.38         |
| J  | 金融业              | 25,310,361.46  | 2.42         |
| K  | 房地产业             | 11,240,200.00  | 1.08         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,228,000.00   | 0.21         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -            |
| 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               | 127,805,313.68 | 12.23        |

### 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    | 3,770,000.00  | 0.36 |
| B 消费者非必需品 | 5,570,000.00  | 0.53 |
| C 消费者常用品  | -             | -    |
| D 能源      | 16,782,120.00 | 1.61 |
| E 金融      | 6,987,822.00  | 0.67 |
| F 医疗保健    | -             | -    |
| G 工业      | 2,532,000.00  | 0.24 |
| H 信息技术    | -             | -    |
| I 电信服务    | 5,721,600.00  | 0.55 |
| J 公用事业    | -             | -    |
| K 房地产     | -             | -    |
| 合计        | 41,363,542.00 | 3.96 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

### 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  | 01088  | 中国神华 | 1,516,000 | 16,782,120.00 | 1.61         |
| 2  | 000001 | 平安银行 | 1,200,000 | 15,360,000.00 | 1.47         |
| 3  | 000002 | 万科A  | 430,000   | 11,240,200.00 | 1.08         |
| 4  | 600104 | 上汽集团 | 600,000   | 10,194,000.00 | 0.98         |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 318,000   | 9,899,340.00  | 0.95         |
| 6  | 002078 | 太阳纸业 | 808,667   | 7,698,509.84  | 0.74         |
| 7  | 002415 | 海康威视 | 234,800   | 7,126,180.00  | 0.68         |
| 8  | 601939 | 建设银行 | 1,000,000 | 6,310,000.00  | 0.60         |
| 9  | 601668 | 中国建筑 | 1,300,000 | 6,201,000.00  | 0.59         |
| 10 | 601225 | 陕西煤业 | 800,000   | 5,768,000.00  | 0.55         |
| 11 | 00772  | 阅文集团 | 120,000   | 5,721,600.00  | 0.55         |
| 12 | 601816 | 京沪高铁 | 906,536   | 5,593,327.12  | 0.54         |
| 13 | 00175  | 吉利汽车 | 500,000   | 5,570,000.00  | 0.53         |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 90,000    | 5,381,100.00  | 0.51         |
| 15 | 600438 | 通威股份 | 300,000   | 5,214,000.00  | 0.50         |
| 16 | 02601  | 中国太保 | 244,200   | 4,617,822.00  | 0.44         |
| 17 | 600600 | 青岛啤酒 | 60,000    | 4,590,000.00  | 0.44         |
| 18 | 600741 | 华域汽车 | 200,000   | 4,158,000.00  | 0.40         |
| 19 | 03323  | 中国建材 | 500,000   | 3,770,000.00  | 0.36         |
| 19 | 000932 | 华菱钢铁 | 1,000,000 | 3,770,000.00  | 0.36         |
| 20 | 002065 | 东华软件 | 300,000   | 3,756,000.00  | 0.36         |
| 21 | 601658 | 邮储银行 | 796,578   | 3,640,361.46  | 0.35         |
| 22 | 300750 | 宁德时代 | 20,000    | 3,487,200.00  | 0.33         |
| 23 | 600377 | 宁沪高速 | 304,463   | 2,986,782.03  | 0.29         |

|    |        |       |         |              |      |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 24 | 00753  | 中国国航  | 600,000 | 2,532,000.00 | 0.24 |
| 25 | 01336  | 新华保险  | 100,000 | 2,370,000.00 | 0.23 |
| 26 | 002027 | 分众传媒  | 400,000 | 2,228,000.00 | 0.21 |
| 27 | 000858 | 五 粮 液 | 10,000  | 1,711,200.00 | 0.16 |
| 28 | 688520 | 神州细胞  | 12,351  | 726,485.82   | 0.07 |
| 29 | 688568 | 中科星图  | 11,020  | 178,634.20   | 0.02 |
| 30 | 688377 | 迪威尔   | 7,894   | 129,619.48   | 0.01 |
| 31 | 688277 | 天智航   | 8,810   | 106,072.40   | 0.01 |
| 32 | 688027 | 国盾量子  | 2,830   | 102,389.40   | 0.01 |
| 33 | 688528 | 秦川物联  | 8,337   | 94,458.21    | 0.01 |
| 34 | 688600 | 皖仪科技  | 5,468   | 84,754.00    | 0.01 |
| 35 | 300842 | 帝科股份  | 455     | 18,527.60    | 0.00 |
| 36 | 600956 | 新天绿能  | 2,533   | 12,766.32    | 0.00 |
| 37 | 300839 | 博汇股份  | 502     | 11,751.82    | 0.00 |
| 38 | 300845 | 捷安高科  | 470     | 8,286.10     | 0.00 |
| 39 | 300843 | 胜蓝股份  | 751     | 7,517.51     | 0.00 |
| 40 | 300840 | 酷特智能  | 1,185   | 7,038.90     | 0.00 |
| 41 | 300846 | 首都在线  | 1,131   | 3,811.47     | 0.00 |

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

## 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  | 000002 | 万 科 A | 11,928,273.00 | 1.13           |
| 2  | 601816 | 京沪高铁  | 6,319,848.88  | 0.60           |
| 3  | 000001 | 平安银行  | 5,442,512.00  | 0.52           |
| 4  | 00772  | 阅文集团  | 3,995,421.14  | 0.38           |
| 5  | 000932 | 华菱钢铁  | 3,800,000.00  | 0.36           |
| 6  | 300750 | 宁德时代  | 3,082,359.00  | 0.29           |
| 7  | 002078 | 太阳纸业  | 2,854,439.35  | 0.27           |
| 8  | 000858 | 五 粮 液 | 1,619,268.41  | 0.15           |
| 9  | 688177 | 百奥泰   | 987,976.08    | 0.09           |
| 10 | 688396 | 华润微   | 950,156.80    | 0.09           |
| 11 | 688599 | 天合光能  | 728,141.28    | 0.07           |
| 12 | 688158 | 优刻得   | 687,861.00    | 0.07           |
| 13 | 688318 | 财富趋势  | 467,877.96    | 0.04           |
| 14 | 688106 | 金宏气体  | 403,641.00    | 0.04           |
| 15 | 688208 | 道通科技  | 345,059.40    | 0.03           |
| 16 | 688520 | 神州细胞  | 316,679.64    | 0.03           |
| 17 | 688233 | 神工股份  | 256,962.86    | 0.02           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 18 | 688189 | 南新制药 | 238,745.02 | 0.02 |
| 19 | 688566 | 吉贝尔  | 234,104.58 | 0.02 |
| 20 | 688051 | 佳华科技 | 205,932.93 | 0.02 |

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

#### 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  | 600196 | 复星医药     | 7,298,581.00 | 0.69           |
| 2  | 300271 | 华宇软件     | 6,485,593.00 | 0.61           |
| 3  | 600176 | 中国巨石     | 6,211,270.43 | 0.59           |
| 4  | 600377 | 宁沪高速     | 6,027,590.94 | 0.57           |
| 5  | 01055  | 中国南方航空股份 | 5,913,095.47 | 0.56           |
| 6  | 600585 | 海螺水泥     | 5,743,980.00 | 0.54           |
| 7  | 300166 | 东方国信     | 5,662,859.00 | 0.54           |
| 8  | 600104 | 上汽集团     | 5,627,232.54 | 0.53           |
| 9  | 300124 | 汇川技术     | 5,193,671.40 | 0.49           |
| 10 | 002065 | 东华软件     | 4,733,451.00 | 0.45           |
| 11 | 600066 | 宇通客车     | 4,281,136.00 | 0.41           |
| 12 | 600600 | 青岛啤酒     | 4,124,110.00 | 0.39           |
| 13 | 002815 | 崇达技术     | 3,645,956.00 | 0.35           |
| 14 | 600438 | 通威股份     | 3,606,000.00 | 0.34           |
| 15 | 601939 | 建设银行     | 3,330,000.00 | 0.32           |
| 16 | 688396 | 华润微      | 3,099,657.59 | 0.29           |
| 17 | 002078 | 太阳纸业     | 3,043,000.00 | 0.29           |
| 18 | 00902  | 华能国际电力股份 | 2,978,741.95 | 0.28           |
| 19 | 600511 | 国药股份     | 2,815,391.00 | 0.27           |
| 20 | 601816 | 京沪高铁     | 2,578,972.45 | 0.24           |

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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 | 48,829,878.86  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 119,600,145.05 |

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -             |
| 2  | 央行票据      | -              | -             |
| 3  | 金融债券      | 50,695,000.00  | 4.85          |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,695,000.00  | 4.85          |
| 4  | 企业债券      | 511,292,933.92 | 48.92         |
| 5  | 企业短期融资券   | 70,191,000.00  | 6.72          |
| 6  | 中期票据      | 131,264,000.00 | 12.56         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 157,672,112.60 | 15.09         |
| 8  | 同业存单      | -              | -             |
| 9  | 其他        | -              | -             |
| 10 | 合计        | 921,115,046.52 | 88.14         |

## 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  | 112457 | 16 魏桥 05 | 655,753 | 58,584,973.02 | 5.61          |
| 2  | 132013 | 17 宝武 EB | 530,000 | 54,181,900.00 | 5.18          |
| 3  | 190203 | 19 国开 03 | 500,000 | 50,695,000.00 | 4.85          |
| 4  | 136014 | 15 福投债   | 500,000 | 50,220,000.00 | 4.81          |
| 5  | 155043 | 18 复星 05 | 400,000 | 40,280,000.00 | 3.85          |

## 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称     | 数量（份）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|---------------|
| 1  | 159865 | 锦安 1A2   | 170,000 | 13,402,800.00 | 1.28          |
| 2  | 138032 | 19 链雅 6A | 100,000 | 9,898,764.38  | 0.95          |

## 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行股指期货投资。



## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以期萃取相应股票组合的超额收益。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

## 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

本基金持有的平安银行（代码：000001.SZ）发行主体平安银行股份有限公司因汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员、信用卡现金分期用途管控不力等 15 项违法违规行为，于 2020 年 1 月 20 日被深圳银保监局处以罚款 720 万元。

本基金持有的太阳纸业（代码：002078.SZ）发行主体山东太阳纸业股份有限公司因违反《价格法》、《价格违法行为行政处罚规定》，于 2019 年 11 月 1 日被山东省市场监督管理局处以没收违法所得和非法财物的行政处罚。

本基金持有的建设银行（代码：601939.SH）发行主体中国建设银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在资金交易信息漏报严重、信贷资产转让业务漏报、银行承兑汇票业务漏报等 7 项违法违规行为，于 2020 年 4 月 20 日被银保监会处以罚款 230 万元。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对

上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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   | 566,813.77    |
| 2  | 应收证券清算款 | 55,238,530.71 |
| 3  | 应收股利    | 1,781,390.60  |
| 4  | 应收利息    | 19,407,684.71 |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 76,994,419.79 |

#### 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<br>(%) |
|----|--------|----------|---------------|------------------|
| 1  | 132013 | 17 宝武 EB | 54,181,900.00 | 5.18             |
| 2  | 132012 | 17 巨化 EB | 27,434,435.00 | 2.63             |
| 3  | 132015 | 18 中油 EB | 25,804,000.00 | 2.47             |
| 4  | 132014 | 18 中化 EB | 18,324,000.00 | 1.75             |
| 5  | 132009 | 17 中油 EB | 15,046,500.00 | 1.44             |
| 6  | 110047 | 山鹰转债     | 6,711,172.50  | 0.64             |
| 7  | 113508 | 新凤转债     | 5,312,693.10  | 0.51             |
| 8  | 132017 | 19 新钢 EB | 2,620,264.00  | 0.25             |
| 9  | 110043 | 无锡转债     | 1,884,068.20  | 0.18             |

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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 (%) |
| 17,055       | 58,072.17     | 11,273,407.40 | 1.14       | 979,147,442.20 | 98.86      |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                        | 持有份额 (份)     | 占上市总份额比例 (%) |
|----|------------------------------|--------------|--------------|
| 1  | 杜爱芳                          | 1,126,146.00 | 15.02        |
| 2  | 林国康                          | 529,057.00   | 7.06         |
| 3  | 莫瑞清                          | 328,275.00   | 4.38         |
| 4  | 廖斯颖                          | 311,627.00   | 4.16         |
| 5  | 陈小锋                          | 270,000.00   | 3.60         |
| 6  | 武胜利                          | 220,000.00   | 2.94         |
| 7  | 李清                           | 200,045.00   | 2.67         |
| 8  | 深圳市尚珑基金管理有限公司—尚珑珑玺阳光私募证券投资基金 | 179,400.00   | 2.39         |
| 9  | 王天韵                          | 177,000.00   | 2.36         |
| 10 | 石元德                          | 160,463.00   | 2.14         |

注：上述持有人为本基金本报告期末场内份额持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 833,028.16 | 0.0841       |

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10               |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017 年 12 月 18 日） |                |
| 基金份额总额                    | 990,420,849.60 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 990,420,849.60 |
| 本报告期基金总申购份额               | —              |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | —              |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | —              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 990,420,849.60 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

### 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

自 2020 年 5 月 15 日起，林鹏同志不再担任本基金管理人副总经理职务。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内本基金未发生改聘会计师事务所的情形。

### 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

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 |    |

|      |   |               |        |           |        |   |
|------|---|---------------|--------|-----------|--------|---|
| 东方证券 | 5 | 91,254,307.98 | 59.91% | 67,620.87 | 60.89% | - |
| 中信证券 | 2 | 61,068,109.97 | 40.09% | 43,436.95 | 39.11% | - |
| 安信证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 长江证券 | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 川财证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 东吴证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 方正证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 高华证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 光大证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 广发证券 | 4 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国金证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国盛证券 | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国泰君安 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 国信证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 海通证券 | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 宏信证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 华创证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 华金证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 华泰证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 华菁证券 | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 汇丰前海 | 2 | -             | -      | -         | -      | - |
| 民生证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 申万宏源 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 天风证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 西部证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 西南证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 兴业证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 银河证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |
| 招商证券 | 1 | -             | -      | -         | -      | - |

|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 中泰证券   | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序：

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

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

3、本基金本报告期内租用交易单元的变更情况：新增东方证券交易单元 1 个、广发证券交易单元 1 个、华金证券交易单元 1 个、中泰证券交易单元 1 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 |
| 东方证券 | 385,494,461.62 | 99.61%       | 12,775,500,000.00 | 89.59%         | -    | -            |
| 中信证券 | 1,512,230.41   | 0.39%        | 1,484,491,000.00  | 10.41%         | -    | -            |
| 安信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 川财证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 方正证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 高华证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国盛证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 海通证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 宏信证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 华菁证券       | - | - | - | - | - | - |
| 汇丰前海       | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券       | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源       | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券       | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券       | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券       | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券       | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券       | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>证券 | - | - | - | - | - | - |

## 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  | 关于上海东方证券资产管理有限公司旗下部分证券投资基金 2020 年非港股通交易日暂停开放的公告      | 规定媒介   | 2020 年 01 月 06 日 |
| 2  | 东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告                | 规定媒介   | 2020 年 01 月 17 日 |
| 3  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金 2020 年春节假期期间相关业务安排调整的公告 | 规定媒介   | 2020 年 01 月 30 日 |
| 4  | 东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金分红公告                           | 规定媒介   | 2020 年 03 月 03 日 |
| 5  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告             | 规定媒介   | 2020 年 03 月 13 日 |
| 6  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告                  | 规定媒介   | 2020 年 03 月 18 日 |
| 7  | 东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金 2019 年年度报告                    | 规定媒介   | 2020 年 03 月 31 日 |
| 8  | 东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告                | 规定媒介   | 2020 年 04 月 22 日 |
| 9  | 关于在网上直销平台开通东方红货币                                     | 规定媒介   | 2020 年 04 月 24 日 |

|    |                                              |      |                  |
|----|----------------------------------------------|------|------------------|
|    | 市场基金 D 类份额与旗下部分基金赎回转购（含定期定额赎回转购）业务的公告        |      |                  |
| 10 | 上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                  | 规定媒介 | 2020 年 05 月 16 日 |
| 11 | 东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金招募说明书（摘要）（2020 年第 1 号） | 规定媒介 | 2020 年 05 月 20 日 |
| 12 | 东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2020 年第 1 号） | 规定媒介 | 2020 年 05 月 20 日 |
| 13 | 东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金分红公告                   | 规定媒介 | 2020 年 06 月 09 日 |

注：本基金信息披露的规定媒介为中国证券报、公司官网、上海证券交易所网站、中国证监会基金电子披露网站。上述公告中，基金合同、招募说明书、定期报告、上市交易公告书仅在规定网站披露，规定报刊仅披露相关提示性公告。

## § 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层。



### 12.3 查阅方式

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

上海东方证券资产管理有限公司

2020 年 8 月 31 日