

东方城镇消费主题混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十六日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
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
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	58

§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方城镇消费主题混合型证券投资基金
基金简称	东方城镇消费主题混合
基金主代码	006235
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 27 日
基金管理人	东方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,456,861.36 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	挖掘与城镇消费相关的具备成长潜力的上市公司，结合积极主动的资产配置，严格控制风险，力争获得基金的长期稳定增值。
投资策略	本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平，基于对证券市场的整体判断进而动态调整股票、债券和货币市场工具等类别的资产配置比例及配置范围。
业绩比较基准	中证城镇消费指数收益率×80%+银行活期存款利率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	李申
	联系电话	010-66295888	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	021-60637111
传真		010-66578700	021-60635778
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区锦什坊街 28	北京市西城区闹市口大街 1 号

	号 1-4 层	院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	崔伟	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	3,151,958.84
本期利润	924,232.06
加权平均基金份额本期利润	0.1404
本期加权平均净值利润率	7.44%
本期基金份额净值增长率	9.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	6,739,659.64
期末可供分配基金份额利润	1.0438
期末基金资产净值	13,196,521.00
期末基金份额净值	2.0438
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	104.38%

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

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

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

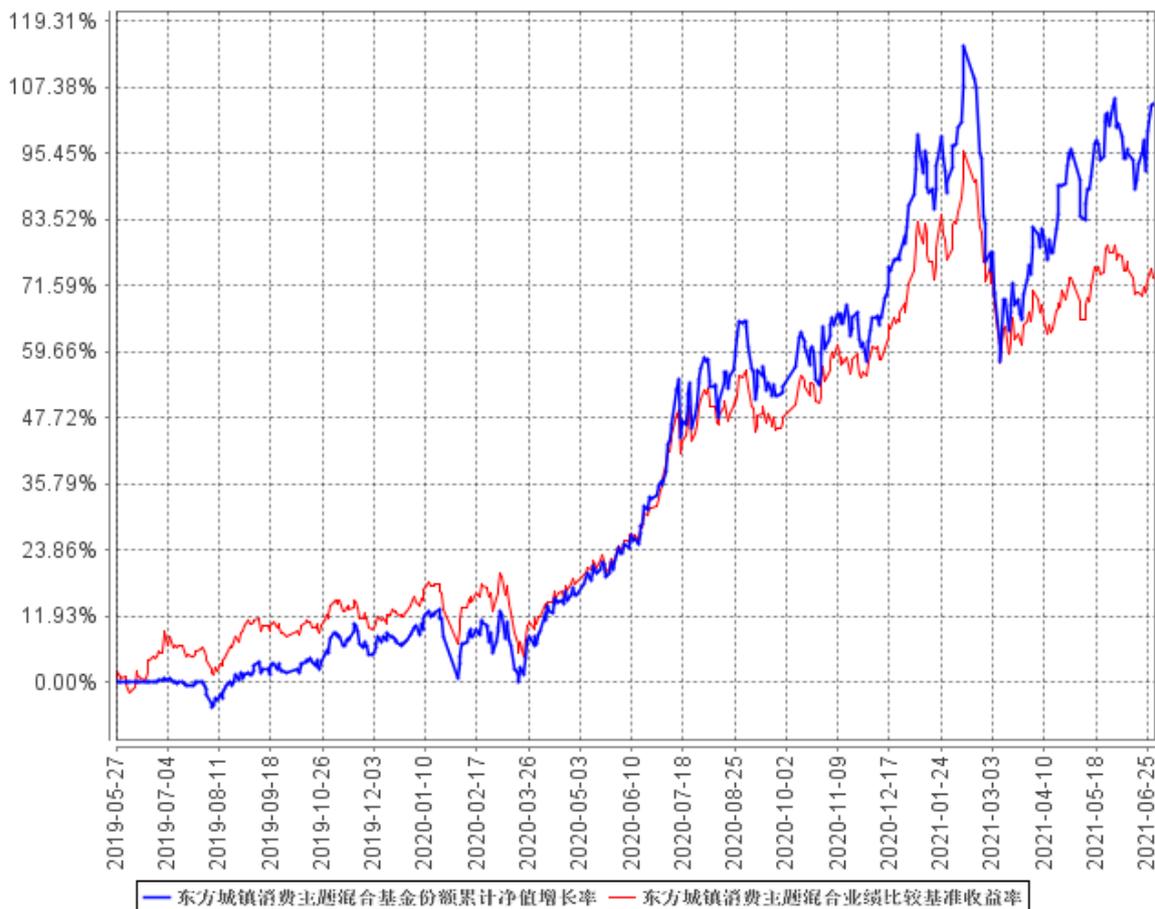
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.13%	1.58%	-2.49%	0.87%	2.62%	0.71%
过去三个月	17.72%	1.60%	4.91%	1.08%	12.81%	0.52%
过去六个月	9.93%	1.98%	0.69%	1.47%	9.24%	0.51%
过去一年	51.05%	1.80%	30.12%	1.35%	20.93%	0.45%
自基金合同生效起至今	104.38%	1.49%	73.19%	1.20%	31.19%	0.29%

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

东方城镇消费主题混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王然（女士）	本基金基金经理、权益研究部总经理、公募投资决策委员会委员	2019 年 5 月 27 日	-	13 年	权益研究部总经理，公募投资决策委员会委员。北京交通大学产业经济学硕士，13 年证券从业经历。曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010 年 4 月加盟本基金管理人，曾任权益研究部副总经理，权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于 2017 年 5 月 11 日转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于 2017 年 9 月 13 日起转型为东方民丰回报

					<p>赢安混合型证券投资基金) 基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金 (于 2018 年 1 月 17 日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金) 基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理, 现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理。</p>
陈诚(女士)	本基金基金经理助理	2021 年 6 月 23 日	-	5 年	<p>中国人民大学劳动关系学专业硕士, 5 年证券从业经历。2016 年 7 月加盟本基金管理人, 曾任权益研究部研究员助理、研究员、高级研究员。现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理助理。</p>

注: ①2021 年 7 月 9 日, 公司发布了《东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金合同生效公告》, 自 7 月 8 日起王然(女士)担任东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
 ②2021 年 8 月 11 日, 公司发布了《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》, 自 8 月 11 日起王然(女士)不再担任东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

③此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

④证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，市场整体呈现震荡向上的态势，结构分化明显。国内外经济修复与政策正常化的时间错配下，全球大宗商品价格抬升，抗通胀预期崛起，风险偏好波动带来风格的切换。从宽基指数上看，表现最好的是创成长、创业板 50、科创 50 等代表新经济方向和业绩高成长的板块；上半年表现最好的申万行业分别是钢铁、采掘、电气设备、化工和医药，而最为落后的行业分别是非银、家电、农业、军工和传媒。

整体上看，上半年市场结构分化加剧，流动性预期的变化和产业发展景气度带来的盈利变化是影响市场结构性分化的主要因素。1 季度，我们预期伴随疫情的控制和经济的修复，政策正常化将使高估值品种受到压制，因此更加关注盈利与估值的匹配，在保持组合较高盈利质量的基础上，降低整体组合的贝塔，进一步注重配置具备安全边界的标的。2 季度，市场整体流动性好于预期叠加人民币小幅升值，对高估值品种较为友好；另外经济复苏带动的部分产业景气度提升也为其业绩增长提供支撑，因此我们继续坚持优选行业、精选个股的配置思路，在保持组合较高盈利质量的基础上，兼顾具备较高成长性的细分行业龙头公司，以期获得中长期的阿尔法收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日，本基金净值增长率为 9.93%，业绩比较基准收益率为 0.69%，高于业绩比较基准 9.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济持续修复，消费信心的恢复有待确认，而产业升级和自主可控有望扮演重头戏。一些我们熟知的具备护城河的行业，短期估值偏高，需要一定时间换空间，若下半年市场遇到调整机会，则可从中长期角度进行布局，以期获得长期的胜率。新兴消费和科技领域正如同雨后春笋般涌现出众多符合新经济发展趋势的行业，目前渗透率较低但增长快速，伴随优质公司的持续上市，投资者认知存在差异，因此可以作为阶段性超额收益的配置品种。伴随疫苗覆盖率的提升，国内出行相关行业持续恢复，也可紧密跟踪并择机进行配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

1. 委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议，就估值参与各方提交的估值问题组织讨论，进行决议并组织实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由副主任代理其行使主任职责。

2. 运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值模型和估值方法的修改意见。

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

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3. 投研部门

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

4. 风险管理部

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方城镇消费主题混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	492,008.55	65,763.65
结算备付金		54,139.20	32,983.10
存出保证金		7,561.41	7,983.27
交易性金融资产	6.4.7.2	12,621,936.68	13,328,257.00
其中：股票投资		12,041,936.68	12,629,167.00
基金投资		-	-
债券投资		580,000.00	699,090.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	208,760.21
应收利息	6.4.7.5	12,028.57	7,022.19
应收股利		-	-
应收申购款		214,938.23	11,275.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		13,402,612.64	13,662,044.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		144,618.43	6,395.44
应付管理人报酬		15,634.23	16,430.16
应付托管费		2,605.71	2,738.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	23,234.38	20,678.13
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	19,998.89	103,619.12
负债合计		206,091.64	149,861.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,456,861.36	7,268,172.83
未分配利润	6.4.7.10	6,739,659.64	6,244,010.66
所有者权益合计		13,196,521.00	13,512,183.49
负债和所有者权益总计		13,402,612.64	13,662,044.70

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0438 元，基金份额总额 6,456,861.36 份。

6.2 利润表

会计主体：东方城镇消费主题混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,142,839.34	4,634,394.70
1.利息收入		9,071.93	13,568.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,494.82	10,438.83
债券利息收入		6,756.29	2,911.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		820.82	218.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,334,460.01	4,011,049.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,299,111.67	3,875,511.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	288.00	7,720.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	35,060.34	127,818.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,227,726.78	591,553.16
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	27,034.18	18,223.41
减：二、费用		218,607.28	452,354.90

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	93,196.69	172,836.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,532.74	28,806.03
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	88,414.74	168,750.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	21,463.11	81,962.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		924,232.06	4,182,039.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		924,232.06	4,182,039.80

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方城镇消费主题混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,268,172.83	6,244,010.66	13,512,183.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	924,232.06	924,232.06
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）	-811,311.47	-428,583.08	-1,239,894.55
其中：1.基金申购款	3,978,480.53	3,673,122.70	7,651,603.23
2.基金赎回款	-4,789,792.00	-4,101,705.78	-8,891,497.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	6,456,861.36	6,739,659.64	13,196,521.00

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	40,178,943.32	3,702,121.61	43,881,064.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,182,039.80	4,182,039.80
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)	-26,982,024.51	-3,224,719.25	-30,206,743.76
其中：1.基金申购款	2,192,670.08	265,516.05	2,458,186.13
2.基金赎回款	-29,174,694.59	-3,490,235.30	-32,664,929.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	13,196,918.81	4,659,442.16	17,856,360.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方城镇消费主题混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2018 年 7 月 11 日中国证监会《关于准予东方城镇消费主题混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1106 号）的核准，由基金发起人东方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金合同》自 2019 年 4 月 22 日至 2019 年 5 月 22 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 244,640,797.42 元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2019]01210047 号”验资报告验证。经向中国证监会备案（机构部函【2019】1257 号），《东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 5 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

244,734,348.70 份基金单位，其中认购资金利息折合 93,551.28 份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、分离交易的可转换债券）、银行存款、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可投资于股票和权证，可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证及因投资可分离债券而产生的权证等。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和中期报告》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，

其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

5、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	492,008.55
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：	492,008.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,273,240.84	12,041,936.68	1,768,695.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	578,260.00	580,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	578,260.00	580,000.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	10,851,500.84	12,621,936.68	1,770,435.84

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	43.24
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	24.40
应收债券利息	11,957.53
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.40
合计	12,028.57

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	23,234.38
银行间市场应付交易费用	-
合计	23,234.38

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	163.10
应付证券出借违约金	-
预提费用	19,835.79
合计	19,998.89

注：预提费用为按日计提的审计费。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,268,172.83	7,268,172.83
本期申购	3,978,480.53	3,978,480.53
本期赎回(以“-”号填列)	-4,789,792.00	-4,789,792.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	6,456,861.36	6,456,861.36

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,657,566.42	586,444.24	6,244,010.66
本期利润	3,151,958.84	-2,227,726.78	924,232.06
本期基金份额交易产生的变动数	-867,125.18	438,542.10	-428,583.08
其中：基金申购款	4,181,111.33	-507,988.63	3,673,122.70

基金赎回款	-5,048,236.51	946,530.73	-4,101,705.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,942,400.08	-1,202,740.44	6,739,659.64

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	1,084.15
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	351.16
其他	59.51
合计	1,494.82

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	29,639,737.49
减：卖出股票成本总额	26,340,625.82
买卖股票差价收入	3,299,111.67

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	288.00
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	288.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	121,695.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	119,640.00
减：应收利息总额	1,767.12
买卖债券差价收入	288.00

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	35,060.34
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	35,060.34

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,227,726.78
——股票投资	-2,228,276.78
——债券投资	550.00

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-2,227,726.78

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	23,893.45
基金转换费收入	3,140.73
合计	27,034.18

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	88,414.74
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	88,414.74

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-

银行汇划费用	1,627.32
合计	21,463.11

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	24,169,727.20	23.61%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	2,999,920.00	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券股份有限公司	22,509.34	23.61%	-	-

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	93,196.69	172,836.62
其中：支付销售机构的客户维护费	45,988.66	127,183.80

注：①计提标准：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计算，具体计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,532.74	28,806.03

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

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	492,008.55	1,084.15	1,740,849.34	9,329.86

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券；

本基金持有一家上市公司的股票市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

注：上述同业存单按主体评级列示。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	492,008.55	-	-	-	492,008.55

结算备付金	54,139.20	-	-	-	54,139.20
存出保证金	7,561.41	-	-	-	7,561.41
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	12,041,936.68	12,041,936.68
交易性金融资产-债券投资	580,000.00	0.00	0.00	-	580,000.00
交易性金融资产-资产支持证券投资	0.00	0.00	0.00	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	12,028.57	12,028.57
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	214,938.23	214,938.23
资产总计	1,133,709.16	0.00	0.00	12,268,903.48	13,402,612.64
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	144,618.43	144,618.43
应付管理人报酬	-	-	-	15,634.23	15,634.23
应付托管费	-	-	-	2,605.71	2,605.71
应付交易费用	-	-	-	23,234.38	23,234.38
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	19,998.89	19,998.89
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	206,091.64	206,091.64
利率敏感度缺口	1,133,709.16	0.00	0.00	12,062,811.84	13,196,521.00
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	65,763.65	-	-	-	65,763.65
结算备付金	32,983.10	-	-	-	32,983.10
存出保证金	7,983.27	-	-	-	7,983.27
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	12,629,167.00	12,629,167.00
交易性金融资产-债券投资	699,090.00	0.00	0.00	-	699,090.00
交易性金融资产-资产支持证券投资	0.00	0.00	0.00	-	0.00
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	208,760.21	208,760.21
应收利息	-	-	-	7,022.19	7,022.19
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	11,275.28	11,275.28
资产总计	805,820.02	0.00	0.00	12,856,224.68	13,662,044.70
负债					
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00

应付赎回款	-	-	-	6,395.44	6,395.44
应付管理人报酬	-	-	-	16,430.16	16,430.16
应付托管费	-	-	-	2,738.36	2,738.36
应付交易费用	-	-	-	20,678.13	20,678.13
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利息	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	103,619.12	103,619.12
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	149,861.21	149,861.21
利率敏感度缺口	805,820.02	0.00	0.00	12,706,363.47	13,512,183.49

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下调 0.25%	63.51	931.54
	市场利率上调 0.25%	-63.51	-931.54

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

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

	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	12,041,936.68	91.25	12,629,167.00	93.47
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	580,000.00	4.40	699,090.00	5.17
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	12,621,936.68	95.65	13,328,257.00	98.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数下跌 5%	-916,595.25	-695,527.04
	沪深 300 指数上涨 5%	916,595.25	695,527.04

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95% 的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 437,592.21 元，占基金资产净值比例为 3.32%；上年度末本基金风险价值为 311,136.64 元，占基金资产净值比例为 2.30%。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	12,041,936.68	89.85
	其中：股票	12,041,936.68	89.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	580,000.00	4.33
	其中：债券	580,000.00	4.33
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	546,147.75	4.07
8	其他各项资产	234,528.21	1.75
9	合计	13,402,612.64	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,868,065.00	74.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	644,140.00	4.88
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	199,325.00	1.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	410,080.00	3.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	920,326.68	6.97
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,041,936.68	91.25

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000661	长春高新	2,500	967,500.00	7.33
2	300896	爱美客	1,200	946,656.00	7.17
3	300015	爱尔眼科	12,966	920,326.68	6.97
4	688363	华熙生物	3,200	889,152.00	6.74
5	600519	贵州茅台	400	822,680.00	6.23
6	002612	朗姿股份	14,000	756,280.00	5.73
7	000858	五粮液	2,500	744,725.00	5.64
8	688366	昊海生科	3,200	669,760.00	5.08
9	000963	华东医药	14,000	644,140.00	4.88
10	300957	贝泰妮	2,000	543,380.00	4.12
11	002867	周大生	25,000	494,250.00	3.75
12	300595	欧普康视	4,500	465,975.00	3.53
13	603605	珀莱雅	2,200	432,762.00	3.28
14	601633	长城汽车	9,000	392,310.00	2.97
15	600315	上海家化	6,500	390,910.00	2.96
16	600809	山西汾酒	800	358,400.00	2.72
17	600223	鲁商发展	22,000	355,080.00	2.69
18	300740	水羊股份	17,000	354,960.00	2.69
19	002568	百润股份	3,500	331,765.00	2.51
20	688389	普门科技	10,000	306,600.00	2.32
21	600754	锦江酒店	3,500	199,325.00	1.51
22	000615	奥园美谷	2,500	55,000.00	0.42

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	688363	华熙生物	1,546,244.67	11.44
2	300896	爱美客	1,352,080.00	10.01
3	600882	妙可蓝多	1,146,880.00	8.49
4	002867	周大生	1,072,076.00	7.93
5	300015	爱尔眼科	1,008,904.00	7.47
6	002612	朗姿股份	982,399.00	7.27
7	000963	华东医药	868,333.00	6.43
8	600612	老凤祥	836,836.00	6.19
9	688366	昊海生科	836,063.47	6.19
10	601633	长城汽车	762,085.00	5.64
11	603899	晨光文具	724,549.00	5.36
12	300132	青松股份	720,831.00	5.33
13	603605	珀莱雅	680,414.00	5.04
14	300957	贝泰妮	649,320.00	4.81
15	000661	长春高新	619,671.00	4.59
16	300595	欧普康视	602,005.00	4.46
17	300144	宋城演艺	587,009.00	4.34
18	002241	歌尔股份	570,395.00	4.22
19	000799	酒鬼酒	544,220.00	4.03
20	002705	新宝股份	543,690.00	4.02
21	000998	隆平高科	524,332.00	3.88
22	000858	五粮液	509,608.00	3.77
23	600600	青岛啤酒	497,821.00	3.68
24	688696	极米科技	472,251.42	3.50
25	300122	智飞生物	452,574.00	3.35
26	300740	水羊股份	444,255.00	3.29
27	002555	三七互娱	436,402.00	3.23
28	600754	锦江酒店	423,825.00	3.14
29	600809	山西汾酒	410,996.00	3.04
30	600519	贵州茅台	406,849.00	3.01
31	600763	通策医疗	385,194.00	2.85
32	000596	古井贡酒	380,363.00	2.81
33	600315	上海家化	373,795.00	2.77
34	002956	西麦食品	358,682.00	2.65

35	000729	燕京啤酒	345,625.00	2.56
36	603818	曲美家居	337,380.00	2.50
37	600223	鲁商发展	336,999.00	2.49
38	300792	壹网壹创	334,385.00	2.47
39	002557	洽洽食品	328,248.00	2.43
40	002568	百润股份	308,658.00	2.28
41	002594	比亚迪	306,597.00	2.27
42	688389	普门科技	293,299.90	2.17
43	002668	奥马电器	289,850.00	2.15
44	003011	海象新材	287,321.00	2.13
45	688298	东方生物	279,475.82	2.07
46	300482	万孚生物	275,995.00	2.04
47	300010	豆神教育	272,817.00	2.02

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000568	泸州老窖	1,269,639.00	9.40
2	600882	妙可蓝多	1,187,787.00	8.79
3	600809	山西汾酒	1,168,886.00	8.65
4	300015	爱尔眼科	1,130,821.00	8.37
5	603899	晨光文具	1,095,187.00	8.11
6	300896	爱美客	1,084,736.35	8.03
7	002594	比亚迪	1,018,571.00	7.54
8	000596	古井贡酒	1,016,835.00	7.53
9	000333	美的集团	926,882.00	6.86
10	603288	海天味业	893,666.00	6.61
11	300792	壹网壹创	892,837.00	6.61
12	600519	贵州茅台	858,976.00	6.36
13	000858	五粮液	858,215.00	6.35
14	688363	华熙生物	849,136.66	6.28
15	600612	老凤祥	837,259.00	6.20
16	600754	锦江酒店	799,253.00	5.92

17	300132	青松股份	700,279.00	5.18
18	002705	新宝股份	608,299.00	4.50
19	002555	三七互娱	568,807.00	4.21
20	300144	宋城演艺	518,762.40	3.84
21	000799	酒鬼酒	511,446.00	3.79
22	002241	歌尔股份	494,710.00	3.66
23	688696	极米科技	494,200.00	3.66
24	000998	隆平高科	483,716.00	3.58
25	601633	长城汽车	482,086.00	3.57
26	600600	青岛啤酒	477,548.00	3.53
27	300122	智飞生物	448,119.00	3.32
28	002867	周大生	446,627.00	3.31
29	002612	朗姿股份	439,308.00	3.25
30	603833	欧派家居	434,534.68	3.22
31	688366	昊海生科	424,989.43	3.15
32	600660	福耀玻璃	406,194.65	3.01
33	601888	中国中免	401,859.60	2.97
34	000661	长春高新	389,397.00	2.88
35	000729	燕京啤酒	343,430.00	2.54
36	002956	西麦食品	333,630.00	2.47
37	000963	华东医药	325,264.00	2.41
38	603818	曲美家居	313,006.00	2.32
39	300595	欧普康视	311,674.00	2.31
40	603605	珀莱雅	304,839.00	2.26
41	002557	洽洽食品	304,778.00	2.26
42	002668	奥马电器	285,962.00	2.12
43	300482	万孚生物	278,322.00	2.06
44	003011	海象新材	274,607.00	2.03
45	603630	拉芳家化	271,388.00	2.01

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	27,981,672.28
卖出股票收入（成交）总额	29,639,737.49

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	580,000.00	4.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	580,000.00	4.40

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	019640	20 国债 10	5,800	580,000.00	4.40
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金所持有的贵州茅台（600519）于 2020 年 12 月 31 日公告，公司时任董事董事长高卫东被上交所予以监管关注。主要内容为“经查明，2020 年 12 月 16 日，贵州茅台酒股份有限公司（以下简称贵州茅台或公司）召开 2020 年度贵州茅台酱香系列酒全国经销商联谊会。会议上公司董事长高卫东表示，公司 2020 年预计可完成酱香系列酒销量 2.95 万吨，实现含税销售额 106 亿元，同比增长 4%。同时，多家媒体对会议内容进行报道，引发了市场和投资者的广泛关注。近期，白酒板块上市公司受到投资者及媒体的广泛关注，相关公司的产销情况及业绩信息是市场高度关注的热点信息，可能对公司股票交易及投资者决策产生较大影响。高卫东作为公司时任董事长，通过非法定信息披露渠道自行对外发布涉及公司经营的重要信息。鉴于上述违规事实和情节，根据《股票上市规则》第 17.1 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》有关规定，我部做出如下监管措施决定：对贵州茅台酒股份有限公司时任董事长高卫东予以监管关注。”

公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的长春高新（000661）于 2020 年 12 月 31 日公告，公司股东金磊被深交所给予通报批评的处分。主要内容为“经查明，金磊存在以下违规行为：2020 年 9 月 12 日，金磊作为长春高新技术产业（集团）股份有限公司（以下简称“长春高新”或“上市公司”）第二大股东、长春高新主要子公司长春金赛药业有限责任公司（以下简称“金赛药业”）董事兼总经理，在上市公司尚未披露相关业绩预计且未就减持进行预披露的情况下，向部分机构投资者发表了有关金赛药业经营业绩与个人减持长春高新股票计划的言论，上述言论对上市公司股票交易价格产生较大影响，长春高新股价于 9 月 14 日出现盘中跌停。经本所纪律处分委员会审议通过，本所作出如下处分决定：对金磊给予通报批评的处分。对于金磊上述违规行为及本所给予的处分，本所将记入上市公司诚信档案，并向社会公开。”

公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的爱美客（300896），于 2021 年 3 月 2 日公告，公司副总经理勾丽娜收到中国证券监督管理委员会北京监管局的警示函。主要内容为“经查，你担任爱美客技术发展股份有限公司（以下简称公司）副总经理期间，你配偶王刚于 2020 年 12 月 10 日至 2021 年 1 月 4 日通过

名下证券账户以集中竞价方式，累计买入公司股票 500 股，累计卖出公司股票 500 股。上述六个月内买卖公司股票的行为构成短线交易，违反了《证券法》第四十四条的规定。我局决定对你采取出具警示函的监督管理措施。你应充分吸取教训，加强本人及直系亲属的证券法律法规学习，严格规范交易行为，杜绝此类违法行为再次发生。”

公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

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

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

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

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

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

本基金投资贵州茅台主要基于以下原因：国内白酒行业出现弱复苏强分化特征，龙头企业集中度进一步提升，公司是国内白酒龙头，主打高端酒价位段，拥有绝对强的品牌壁垒，业绩表现良好、财务指标过硬。我们认为公司具备较宽的护城河，在国内白酒行业分化的背景之下，公司作为全国化高端龙头具备投资价值。

本基金投资长春高新主要基于以下原因：公司作为国内生长激素龙头公司，整体收入利润过去几年保持稳健增长，未来伴随渠道下沉和治疗渗透率的提升，行业仍有空间。公司产品线突出，渠道能力强，同时疫苗业务也独具特色，符合消费升级逻辑，具备一定投资价值。

本基金投资爱美客主要基于以下原因：公司是医美行业领先的产品生产企业，在玻尿酸等多个细分领域具备较强的产品研发和销售能力，产品线布局丰富，能够分享到医美行业快速发展的红利，具备一定的投资价值。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,561.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,028.57
5	应收申购款	214,938.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	234,528.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,781	2,321.78	-	-	6,456,861.36	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,095.35	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2019 年 5 月 27 日 ）基金份额总额	244,734,348.70
本报告期期初基金份额总额	7,268,172.83
本报告期基金总申购份额	3,978,480.53
减：本报告期基金总赎回份额	4,789,792.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	6,456,861.36

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券股份有限公司	1	33,743,870.75	58.56%	31,426.31	58.56%	-
华创证券有限责任公司	1	23,877,539.02	41.44%	22,238.19	41.44%	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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

（2）交易单元的选择标准和程序

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

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

(3) 本报告期内, 本基金新增租用 1 个交易单元, 为东兴证券股份有限公司上海交易所交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	119,928.00	100.00%	1,000,000.00	100.00%	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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

10.8 其他重大事件

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

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

19	关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务并参与定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 1 日
20	东方城镇消费主题混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
21	关于增加上海爱建基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 13 日
22	关于旗下部分基金参与吉林银行基金申购及定投手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 28 日
23	关于增加展恒为东方基金旗下部分产品的销售机构同时开通定期定额投资、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 22 日
24	关于旗下部分基金继续参与交通银行基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 29 日
25	关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 29 日
26	关于旗下部分基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2021 年 8 月 26 日