

# 东方龙混合型开放式证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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	5
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	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
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	44
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	44

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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</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 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方龙混合型开放式证券投资基金
基金简称	东方龙混合
基金主代码	400001
前端交易代码	400001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 11 月 25 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	158,489,784.50 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国经济和资本市场的高速增长,为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。
投资策略	本基金的投资管理由自上而下的资产配置、积极风格管理和自下而上的个股(包括债券)选择组成。本基金将资产配置、基金风格管理和个股选择都建立在全面、深入而有效的研究的基础上。研究贯穿于基金投资管理的每一个环节。
业绩比较基准	标普中国 A 股 300 成长指数×30% +标普中国 A 股 300 价值指数×45% +中证综合债指数×25%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中等风险品种,其风险收益特征介于单纯的股票型基金、单纯的债券型基金与单纯的货币市场基金之间,同时其股票组合部分的风险收益特征也介于完全成长型股票组合与完全价值型股票组合之间。

### 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
	联系电话	010-66295888
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com
客户服务电话	010-66578578 或 400-628-5888	021-60637228
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	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100073	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或办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东方基金管理股份有限公司	北京市丰台区金泽路 161 号院 1 号楼远洋锐中心 26 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,220,065.38
本期利润	-14,850,824.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0828
本期加权平均净值利润率	-6.97%
本期基金份额净值增长率	-8.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	12,904,122.80
期末可供分配基金份额利润	0.0814
期末基金资产净值	171,393,907.30
期末基金份额净值	1.0814
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	437.98%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

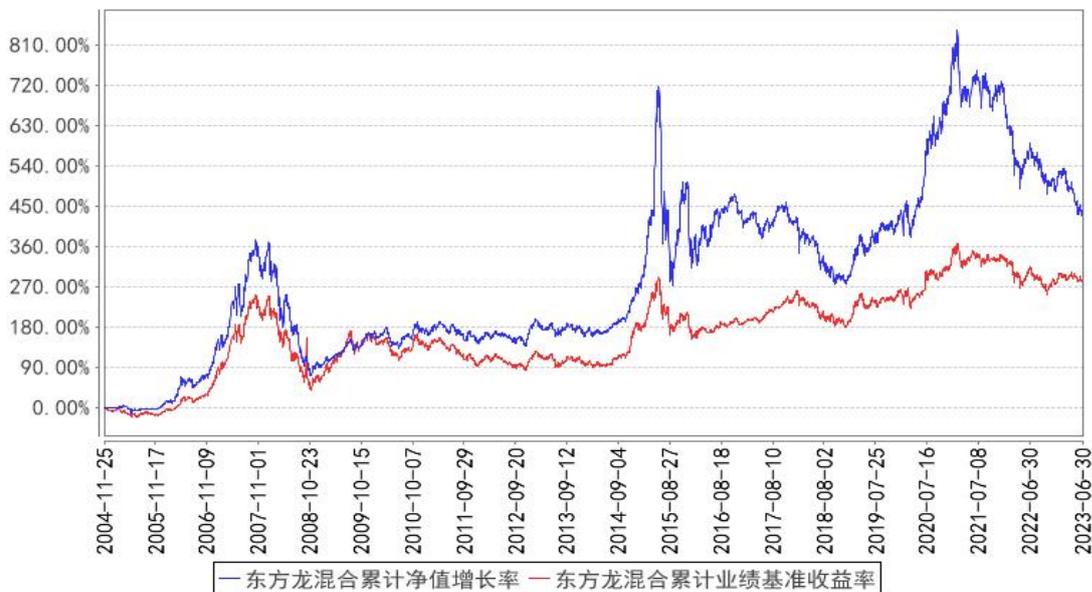
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.22%	0.99%	0.86%	0.63%	0.36%	0.36%
过去三个月	-8.49%	0.82%	-2.24%	0.62%	-6.25%	0.20%

过去六个月	-8.85%	0.86%	1.40%	0.61%	-10.25%	0.25%
过去一年	-21.23%	0.90%	-7.28%	0.71%	-13.95%	0.19%
过去三年	-13.49%	1.21%	5.44%	0.87%	-18.93%	0.34%
自基金合同生效起至今	437.98%	1.44%	283.56%	1.21%	154.42%	0.23%

### 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

东方龙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

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

截至2023年6月30日，本公司注册资本3.3333亿元人民币。东北证券股份有限公司持有本公司股份19200万股，持股比例57.6%；河北国控资本管理有限公司持有本公司股份8100万股，持股比例24.3%；渤海国际信托股份有限公司持有本公司股份2700万股，持股比例8.1%；天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持股比例3.37%；天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止2023年6月30日，本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长回报平衡混合型证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证

券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方中证 500 指数增强型证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许文波	本基金基金经理、公司副总	2019 年 1 月 2 日	-	22 年	公司副总经理、权益投资总监、公募投资决策委员会副主任委员。吉林大学工商管理硕士，22 年证券从业经历。曾任新华证

	经理、权益投资总监、公募投资决策委员会副主任委员				券有限责任公司投资顾问部分析师；东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理；德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018 年 4 月加盟本基金管理人，曾任公司总经理助理，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方中国红利混合型证券投资基金基金经理、东方欣利混合型证券投资基金基金经理、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金经理，现任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方创新医疗股票型证券投资基金基金经理。
--	--------------------------	--	--	--	---

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《东方龙混合型开放式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

上半年 A 股市场呈现修复行情：一季度相对强势，顺周期行业、中特股等板块率先启动，2、3 月份以半导体、AI 为代表的科技行业后来居上，成为市场最活跃的板块；二季度逐渐进入震荡区间，强势板块略有回调。根据 Wind 数据显示，上半年上证指数上涨 3.65%、万得全 A 上涨 3.06%、创业板指下跌 5.61%；行业来看，TMT 全面领先，通信、传媒、计算机分别上涨 50.7%、42.8%、27.6%，商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料四个行业跌幅超过 10%。

国内经济在二季度的修复不及预期，PMI 连续三个月处于荣枯线以下，ppi、cpi 数据表现低迷，受此影响 A 股出现一定的回撤。AI 可能是二季度为数不多的亮点行业，通信板块受此提振，表现相对强势。目前国内处于主动去库到被动去库的阶段，中央政府也多重并举提振经济，利率政策、促进家居消费等财政政策不断出台，经济有望逐步平稳回升，资本市场有望从中受益。

在报告期内，本基金积极应对经济形势和资本市场的剧烈变化，在工程机械、重点央企龙头公司、白电等方面进行重点的配置和布局，看好景气度回升的细分行业和国内重点央企系统性重估的机会。在选股思路，坚持以投资资产的角度进行研判，优选更好的产业公司，争取为投资人带来稳健的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日,本基金净值增长率为-8.85%,业绩比较基准收益率为 1.40%,低于业绩比较基准 10.25%。

#### 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,我们认为海外加息进入尾声,国内经济修复的动力或将会强于上半年,经济基本面有望逐步回升。在一系列的活跃资本市场的政策支持下,A股的表现也值得期待。我们持续看好中国经济增长的持续性和韧性,也看好中国资本市场的未来发展。我们将重点关注国内优质企业的发展,在竞争力不断提升的行业和企业重点布局。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了东方基金管理股份有限公司估值委员会(以下简称“估值委员会”),成员包括公司总经理、分管运营高级管理人员、分管投研高级管理人员、督察长以及运营部负责人、投研部门指定负责人、合规法务部负责人、风险管理部负责人及总办会其他指定人员。估值委员会设立委员会主任 1 名,委员会副主任 1-2 名,估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性,熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下:

##### 1. 委员会主任

负责召集估值委员会工作会议,就估值参与各方提交的估值问题组织讨论,进行决议并组织实施;因特殊原因,委员会主任无法履行职责时,由指定的副主任代理其行使召集职责。

##### 2. 运营部

(1) 自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

(2) 征求托管行意见并借鉴行业通行做法,提出估值方法的修改意见。

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

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

(5) 负责起草估值相关制度、办法等,并履行规定流程后执行。

##### 3. 投研部门

根据现行法律法规及各产品相关法律文件,适时评估各产品持有投资品种的现有估值政策及

估值方法是否公允、适当；对估值方法有失公允性时，投研部门必要时可向运营部提交估值方法调整说明，由运营部提请估值委员会召集估值会议进行审议。

#### 4. 合规法务部、风险管理部：

在日常合规监控及风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时，建议或提示运营部提请估值委员会召集估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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：东方龙混合型开放式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,886,477.53	16,841,131.14
结算备付金		143,658.07	347,770.99
存出保证金		42,370.08	50,622.39
交易性金融资产	6.4.7.2	164,027,139.70	234,715,747.03
其中：股票投资		154,616,137.80	221,476,179.08
基金投资		-	-
债券投资		9,411,001.90	13,239,567.95
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,121.06	13,911.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		172,108,766.44	251,969,182.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		25,987.49	52,438.43
应付管理人报酬		213,352.93	324,879.10
应付托管费		35,558.84	54,146.50
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	439,959.88	596,327.14
负债合计		714,859.14	1,027,791.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	158,489,784.50	211,506,359.87
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	12,904,122.80	39,435,031.88
净资产合计		171,393,907.30	250,941,391.75
负债和净资产总计		172,108,766.44	251,969,182.92

注： 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0814 元，基金份额总额 158,489,784.50 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方龙混合型开放式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-12,886,762.45	-54,551,888.64
1. 利息收入		20,191.25	49,961.80
其中：存款利息收入	6.4.7.9	20,191.25	49,961.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		680,569.83	-27,326,501.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,523,171.71	-30,416,443.99
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.11	124,149.69	-8,534.77
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,079,591.85	3,098,477.13
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-13,630,759.03	-27,282,369.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	43,235.50	7,020.76
<b>减：二、营业总支出</b>		1,964,061.96	2,657,802.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,593,074.11	2,187,507.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	265,512.40	364,584.56
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	105,475.45	105,710.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-14,850,824.41	-57,209,691.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-14,850,824.41	-57,209,691.11
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-14,850,824.41	-57,209,691.11

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东方龙混合型开放式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	211,506,359.87	-	39,435,031.88	250,941,391.75
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	211,506,359.87	-	39,435,031.88	250,941,391.75
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-53,016,575.37	-	-26,530,909.08	-79,547,484.45
(一)、综合收益总额	-	-	-14,850,824.41	-14,850,824.41
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-53,016,575.37	-	-11,680,084.67	-64,696,660.04
其中：1. 基金申购款	2,590,636.66	-	468,173.92	3,058,810.58
2. 基金赎回款	-55,607,212.03	-	-12,148,258.59	-67,755,470.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	158,489,784.50	-	12,904,122.80	171,393,907.30
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	216,504,318.58	-	137,887,909.61	354,392,228.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	216,504,318.58	-	137,887,909.61	354,392,228.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,742,459.39	-	-58,179,420.74	-60,921,880.13
(一)、综合收益总额	-	-	-57,209,691.11	-57,209,691.11
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,742,459.39	-	-969,729.63	-3,712,189.02
其中：1. 基金申购款	3,832,781.73	-	1,445,092.93	5,277,874.66
2. 基金赎回款	-6,575,241.12	-	-2,414,822.56	-8,990,063.68
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	213,761,859.19	-	79,708,488.87	293,470,348.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

东方龙混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2004 年 9 月 24 日中国证监会《关于同意东方龙混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2004】152 号）和《关于募集东方龙混合型开放式证券投资基金的确认函》（基金部函【2004】117 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《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》自 2004 年 10 月 11 日至 2004 年 11 月 19 日公开募集设立。本基金为混合型开放式基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,130,234,808.17 元人民币，业经普华永道中天会计师事务所有限公司“普华永道中天验字（2004）第 220 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》于 2004 年 11 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,130,727,725.99 份基金单位，其中认购资金利息折合 492,917.82 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《东方龙混合型开放式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，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

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

- 1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- 2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。
- 3、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 4、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,886,477.53
等于：本金	7,885,811.94
加：应计利息	665.59
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,886,477.53

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	158,002,745.86	-	154,616,137.80	-3,386,608.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券   交易所市场	9,305,554.11	93,391.90	9,411,001.90	12,055.89

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,305,554.11	93,391.90	9,411,001.90	12,055.89
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	167,308,299.97	93,391.90	164,027,139.70	-3,374,552.17

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	61.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	99,379.32
其中：交易所市场	99,379.32
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	295,780.45
其他	44,739.06
合计	439,959.88

注：预提费用包括按日计提的审计费、信息披露费和债券账户维护费；其他为上海、深圳证券交易所返还证管费。

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	211,506,359.87	211,506,359.87
本期申购	2,590,636.66	2,590,636.66

本期赎回（以“-”号填列）	-55,607,212.03	-55,607,212.03
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	158,489,784.50	158,489,784.50

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	85,241,897.98	-45,806,866.10	39,435,031.88
本期利润	-1,220,065.38	-13,630,759.03	-14,850,824.41
本期基金份额交易产生的变动数	-21,239,593.76	9,559,509.09	-11,680,084.67
其中：基金申购款	1,029,741.04	-561,567.12	468,173.92
基金赎回款	-22,269,334.80	10,121,076.21	-12,148,258.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,782,238.84	-49,878,116.04	12,904,122.80

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	18,081.71
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	1,706.28
其他	403.26
合计	20,191.25

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,523,171.71
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	-1,523,171.71

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	181,931,905.55
减：卖出股票成本总额	182,961,914.69
减：交易费用	493,162.57
买卖股票差价收入	-1,523,171.71

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	139,841.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-15,691.89
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	124,149.69

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,349,413.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	23,836,814.89
减：应计利息总额	528,290.41
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-15,691.89

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,079,591.85
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,079,591.85

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-13,630,759.03
股票投资	-13,631,844.92
债券投资	1,085.89
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	-13,630,759.03

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,246.51
基金转换费收入	36,988.99
合计	43,235.50

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	95.00

账户维护费	18,600.00
合计	105,475.45

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东方基金管理股份有限公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国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

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,593,074.11	2,187,507.46
其中：支付销售机构的客户维护费	654,900.78	759,472.58

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	265,512.40	364,584.56

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

本报告期及上年度可比期间，本基金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，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	7,886,477.53	18,081.71	20,460,866.27	45,417.96

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

#### 6.4.12 期末(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.12	69	1,927.17	2,285.28	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	25.32	357	4,241.16	9,039.24	-

001324	长青科技	2023年 5月12 日	6个月	新股流 通受限	18.88	20.03	102	1,925.76	2,043.06	-
001360	南矿集团	2023年 3月31 日	6个月	新股流 通受限	15.38	16.45	124	1,907.12	2,039.80	-
001367	海森药业	2023年 3月30 日	6个月	新股流 通受限	44.48	42.55	43	1,912.64	1,829.65	-
001380	华纬科技	2023年 5月9日	6个月	新股流 通受限	28.84	30.85	110	3,172.40	3,393.50	-
300804	广康生化	2023年 6月15 日	6个月	新股流 通受限	42.45	33.10	152	6,452.40	5,031.20	-
301141	中科磁业	2023年 3月27 日	6个月	新股流 通受限	41.20	42.71	198	8,157.60	8,456.58	-
301157	华塑科技	2023年 3月1日	6个月	新股流 通受限	56.50	52.92	141	7,966.50	7,461.72	-
301170	锡南科技	2023年 6月16 日	6个月	新股流 通受限	34.00	35.61	147	4,998.00	5,234.67	-
301203	国泰环保	2023年 3月28 日	6个月	新股流 通受限	46.13	34.97	154	7,104.02	5,385.38	-
301210	金杨股份	2023年 6月21 日	6个月	新股流 通受限	57.88	49.71	126	7,292.88	6,263.46	-
301225	恒勃股份	2023年 6月8日	6个月	新股流 通受限	35.66	34.28	191	6,811.06	6,547.48	-
301232	飞沃科技	2023年 6月8日	6个月	新股流 通受限	72.50	58.48	83	6,017.50	4,853.84	-
301246	宏源药业	2023年 3月10 日	6个月	新股流 通受限	50.00	30.71	242	12,100.00	7,431.82	-
301261	恒工精密	2023年 6月29 日	1个月 内(含)	新股流 通受限	36.90	36.90	1,240	45,756.00	45,756.00	-
301262	海看股份	2023年 6月13 日	6个月	新股流 通受限	30.22	25.97	249	7,524.78	6,466.53	-
301281	科源制药	2023年 3月28 日	6个月	新股流 通受限	44.18	25.36	227	7,157.16	5,756.72	-

301291	明阳电 气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	38.13	31.57	227	8,655.51	7,166.39	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	32.34	32.00	284	9,184.56	9,088.00	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流 通受限	67.28	65.42	147	9,890.16	9,616.74	-
301317	鑫磊股 份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流 通受限	20.67	26.14	619	12,794.73	16,180.66	-
301322	绿通科 技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流 通受限	131.11	53.20	129	11,275.46	6,862.80	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流 通受限	39.06	41.11	109	4,257.54	4,480.99	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	14.81	13.74	419	6,205.39	5,757.06	-
301355	南王科 技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	17.55	17.23	334	5,861.70	5,754.82	-
301358	湖南裕 能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流 通受限	23.77	42.86	371	8,818.67	15,901.06	-
301360	荣旗科 技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流 通受限	71.88	92.81	88	6,325.44	8,167.28	-
301373	凌玮科 技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	33.73	31.84	242	8,162.66	7,705.28	-
301376	致欧科 技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	24.66	22.57	210	5,178.60	4,739.70	-
301383	天键股 份	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流 通受限	46.16	35.72	215	9,924.40	7,679.80	-
301387	光大同 创	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	58.32	45.63	176	10,264.32	8,030.88	-
301408	华人健 康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流 通受限	16.24	16.95	567	9,208.08	9,610.65	-
301429	森泰股 份	2023 年 4 月 10	6 个月	新股流 通受限	28.75	21.19	366	10,522.50	7,755.54	-

301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	39.78	39.78	1,571	62,494.38	62,494.38	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	12.59	223	2,310.28	2,807.57	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	13.72	232	2,705.12	3,183.04	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	26.51	75	1,948.50	1,988.25	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	18.25	210	3,339.00	3,832.50	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.68	122	1,778.76	2,034.96	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.07	1,123	22,302.78	20,292.61	-
688307	中润光学	2023年2月8日	6个月	新股流通受限	23.88	31.71	2,455	58,625.40	77,848.05	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	17.20	385	5,451.60	6,622.00	-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.63	661	7,998.10	8,348.43	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	78.84	200	4,720.00	15,768.00	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	27.88	227	4,358.40	6,328.76	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.45	2,160	12,290.40	11,772.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.24	703	7,803.30	12,119.72	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	38.64	197	7,878.03	7,612.08	-
688512	慧智微	2023年	6个月	新股流	20.92	19.23	242	5,062.64	4,653.66	-

		5月8日		通受限							
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	25.43	276	6,033.36	7,018.68		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	139.16	70	10,666.60	9,741.20		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	54.75	145	5,075.00	7,938.75		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.72	130	5,677.10	6,983.60		-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	24.18	280	5,927.60	6,770.40		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.46	196	5,930.96	4,990.16		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.08	46	5,786.80	5,431.68		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	89.31	52	6,545.76	4,644.12		-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	30.89	161	4,070.08	4,973.29		-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金投资于具有良好信用等级的证券，并在法律法规规定和本基金基金合同约定的基础上，进一步进行分散化投资管理。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：上述同业存单按主体评级列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支

付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,886,477.53	-	-	-	7,886,477.53
结算备付金	143,658.07	-	-	-	143,658.07
存出保证金	42,370.08	-	-	-	42,370.08
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	154,616,137.80	154,616,137.80

交易性金融资产-债券投资	9,411,001.90	-	-	-	9,411,001.90
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,121.06	9,121.06
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,483,507.58	-	-	-154,625,258.86	172,108,766.44
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	25,987.49	25,987.49
应付管理人报酬	-	-	-	213,352.93	213,352.93
应付托管费	-	-	-	35,558.84	35,558.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	439,959.88	439,959.88
负债总计	-	-	-	714,859.14	714,859.14
利率敏感度缺口	17,483,507.58	-	-	-153,910,399.72	171,393,907.30
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,841,131.14	-	-	-	16,841,131.14
结算备付金	347,770.99	-	-	-	347,770.99
存出保证金	50,622.39	-	-	-	50,622.39
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-221,476,179.08	221,476,179.08
交易性金融资产-债券投资	13,239,567.95	-	-	-	13,239,567.95
交易性金融资产-资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	13,911.37	13,911.37
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	30,479,092.47	-	-221,490,090.45	251,969,182.92
负债	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	52,438.43	52,438.43
应付管理人报酬	-	-	324,879.10	324,879.10
应付托管费	-	-	54,146.50	54,146.50
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	596,327.14	596,327.14
负债总计	-	-	1,027,791.17	1,027,791.17
利率敏感度缺口	30,479,092.47	-	-220,462,299.28	250,941,391.75

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率上调 0.25%	-12,355.16	-7,564.60
	市场利率下调 0.25%	12,355.16	7,564.60

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金按照基金合同的约定和法律法规的规定进行投资，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	154,616,137.80	90.21	221,476,179.08	88.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,411,001.90	5.49	13,239,567.95	5.28
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	164,027,139.70	95.70	234,715,747.03	93.53

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月）

			31 日 )
	沪深 300 指数上涨 5%	6,738,880.85	9,161,062.92
	沪深 300 指数下跌 5%	-6,738,880.85	-9,161,062.92

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	154,040,166.33	221,001,461.28
第二层次	9,519,252.28	13,239,567.95
第三层次	467,721.09	474,717.80
合计	164,027,139.70	234,715,747.03

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	154,616,137.80	89.84
	其中：股票	154,616,137.80	89.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,411,001.90	5.47
	其中：债券	9,411,001.90	5.47
	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	8,030,135.60	4.67
8	其他各项资产	51,491.14	0.03
9	合计	172,108,766.44	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	27,442,672.48	16.01
C	制造业	107,742,592.79	62.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,265,000.00	0.74
E	建筑业	7,015.54	0.00
F	批发和零售业	23,389.59	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	8,653,510.80	5.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,589,326.22	3.84

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	77,245.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	5,385.38	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,810,000.00	1.64
S	综合	-	-
	合计	154,616,137.80	90.21

### 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	002372	伟星新材	700,150	14,381,081.00	8.39
2	600519	贵州茅台	8,000	13,528,000.00	7.89
3	300699	光威复材	320,157	9,876,843.45	5.76
4	000651	格力电器	250,000	9,127,500.00	5.33
5	002930	宏川智慧	380,040	8,653,510.80	5.05
6	002959	小熊电器	95,000	7,932,500.00	4.63
7	000807	云铝股份	550,000	7,001,500.00	4.09
8	002155	湖南黄金	550,000	6,710,000.00	3.91
9	600489	中金黄金	640,000	6,611,200.00	3.86
10	600941	中国移动	70,000	6,531,000.00	3.81
11	601100	恒立液压	100,033	6,435,122.89	3.75
12	300558	贝达药业	120,000	5,763,600.00	3.36
13	301367	怡和嘉业	37,080	5,500,447.20	3.21
14	600938	中国海油	300,004	5,436,072.48	3.17
15	601088	中国神华	140,000	4,305,000.00	2.51
16	600572	康恩贝	600,000	4,110,000.00	2.40
17	002032	苏泊尔	80,000	4,000,000.00	2.33
18	002594	比亚迪	15,021	3,879,473.67	2.26
19	603868	飞科电器	60,091	3,791,141.19	2.21
20	688696	极米科技	25,076	3,495,343.64	2.04
21	603365	水星家纺	200,000	2,812,000.00	1.64
22	600977	中国电影	200,000	2,810,000.00	1.64
23	600547	山东黄金	100,000	2,348,000.00	1.37
24	600839	四川长虹	400,000	2,020,000.00	1.18
25	002304	洋河股份	15,000	1,970,250.00	1.15
26	601857	中国石油	200,000	1,494,000.00	0.87
27	600886	国投电力	100,000	1,265,000.00	0.74
28	688072	拓荆科技	1,908	812,750.76	0.47

29	600988	赤峰黄金	40,000	538,400.00	0.31
30	688147	微导纳米	4,195	221,412.10	0.13
31	301383	天键股份	2,144	79,824.40	0.05
32	688307	中润光学	2,455	77,848.05	0.05
33	688523	航天环宇	2,760	73,813.44	0.04
34	301291	明阳电气	2,267	73,670.39	0.04
35	688543	国科军工	1,296	72,454.50	0.04
36	688334	西高院	3,848	68,817.48	0.04
37	688429	时创能源	2,265	65,328.86	0.04
38	301210	金杨股份	1,260	64,471.68	0.04
39	301488	豪恩汽电	1,571	62,494.38	0.04
40	301170	锡南科技	1,466	54,301.47	0.03
41	300804	广康生化	1,518	51,898.66	0.03
42	688631	莱斯信息	1,601	51,859.69	0.03
43	301261	恒工精密	1,240	45,756.00	0.03
44	001282	三联锻造	685	24,276.48	0.01
45	001324	长青科技	1,018	21,434.78	0.01
46	688249	晶合集成	1,123	20,292.61	0.01
47	301317	鑫磊股份	619	16,180.66	0.01
48	301358	湖南裕能	371	15,901.06	0.01
49	688361	中科飞测	200	15,768.00	0.01
50	688472	阿特斯	703	12,119.72	0.01
51	688469	中芯集成	2,160	11,772.00	0.01
52	301277	新天地	545	10,632.95	0.01
53	301280	珠城科技	285	10,191.60	0.01
54	688531	日联科技	70	9,741.20	0.01
55	301310	鑫宏业	147	9,616.74	0.01
56	301408	华人健康	567	9,610.65	0.01
57	301335	天元宠物	384	9,154.56	0.01
58	301307	美利信	284	9,088.00	0.01
59	001287	中电港	357	9,039.24	0.01
60	301141	中科磁业	198	8,456.58	0.00
61	301365	矩阵股份	512	8,427.52	0.00
62	688352	颀中科技	661	8,348.43	0.00
63	301360	荣旗科技	88	8,167.28	0.00
64	301387	光大同创	176	8,030.88	0.00
65	688535	华海诚科	145	7,938.75	0.00
66	301429	森泰股份	366	7,755.54	0.00
67	301373	凌玮科技	242	7,705.28	0.00
68	688484	南芯科技	197	7,612.08	0.00
69	301157	华塑科技	141	7,461.72	0.00
70	301246	宏源药业	242	7,431.82	0.00
71	301322	绿通科技	129	6,862.80	0.00

72	688552	航天南湖	280	6,770.40	0.00
73	301225	恒勃股份	191	6,547.48	0.00
74	301262	海看股份	249	6,466.53	0.00
75	301265	华新环保	524	6,088.88	0.00
76	301332	德尔玛	419	5,757.06	0.00
77	301281	科源制药	227	5,756.72	0.00
78	301355	南王科技	334	5,754.82	0.00
79	688581	安杰思	46	5,431.68	0.00
80	301203	国泰环保	154	5,385.38	0.00
81	688570	天玛智控	196	4,990.16	0.00
82	301232	飞沃科技	83	4,853.84	0.00
83	301376	致欧科技	210	4,739.70	0.00
84	688512	慧智微	242	4,653.66	0.00
85	688623	双元科技	52	4,644.12	0.00
86	301323	新莱福	109	4,480.99	0.00
87	603137	恒尚节能	210	3,832.50	0.00
88	001380	华纬科技	110	3,393.50	0.00
89	601133	柏诚股份	232	3,183.04	0.00
90	601065	江盐集团	223	2,807.57	0.00
91	001360	南矿集团	124	2,039.80	0.00
92	603172	万丰股份	122	2,034.96	0.00
93	603125	常青科技	75	1,988.25	0.00
94	001367	海森药业	43	1,829.65	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	9,891,236.00	3.94
2	301367	怡和嘉业	8,934,401.00	3.56
3	002155	湖南黄金	8,879,302.00	3.54
4	000858	五粮液	8,274,370.00	3.30
5	000807	云铝股份	7,501,428.00	2.99
6	600489	中金黄金	7,097,232.00	2.83
7	688696	极米科技	7,085,088.64	2.82
8	600988	赤峰黄金	6,693,054.00	2.67
9	000333	美的集团	5,647,757.00	2.25
10	000683	远兴能源	5,343,143.00	2.13
11	600031	三一重工	4,255,565.00	1.70
12	002032	苏泊尔	4,197,167.27	1.67
13	600572	康恩贝	4,152,107.00	1.65
14	300558	贝达药业	3,797,123.10	1.51
15	600977	中国电影	3,292,912.00	1.31

16	603365	水星家纺	2,967,756.00	1.18
17	600183	生益科技	2,961,806.00	1.18
18	600547	山东黄金	2,555,665.00	1.02
19	600941	中国移动	2,541,391.00	1.01
20	601888	中国中免	2,293,260.00	0.91

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	002304	洋河股份	14,027,236.00	5.59
2	600031	三一重工	11,703,335.00	4.66
3	601111	中国国航	10,601,160.00	4.22
4	601369	陕鼓动力	9,083,780.00	3.62
5	600519	贵州茅台	7,999,004.00	3.19
6	000858	五粮液	7,710,094.00	3.07
7	002594	比亚迪	6,288,864.00	2.51
8	002959	小熊电器	6,018,747.00	2.40
9	600566	济川药业	5,736,937.86	2.29
10	600988	赤峰黄金	5,512,953.00	2.20
11	605376	博迁新材	5,437,899.00	2.17
12	688050	爱博医疗	5,371,784.35	2.14
13	601888	中国中免	5,349,924.00	2.13
14	688089	嘉必优	5,276,332.13	2.10
15	000333	美的集团	5,234,420.04	2.09
16	000683	远兴能源	5,034,658.00	2.01
17	600875	东方电气	4,992,536.00	1.99
18	601088	中国神华	4,756,677.00	1.90
19	600803	新奥股份	4,662,453.50	1.86
20	601100	恒立液压	4,322,154.00	1.72

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	129,733,718.33
卖出股票收入（成交）总额	181,931,905.55

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	9,099,867.95	5.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	311,133.95	0.18
	其中：政策性金融债	311,133.95	0.18
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	9,411,001.90	5.49

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019694	23 国债 01	90,000	9,099,867.95	5.31
2	018008	国开 1802	3,000	311,133.95	0.18
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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

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	42,370.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,121.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,491.14

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
15,641	10,132.97	121,330.40	0.08	158,368,454.10	99.92

### 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	338,789.80	0.21

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发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	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 11 月 25 日） 基金份额总额	1,130,727,725.99
本报告期期初基金份额总额	211,506,359.87
本报告期基金总申购份额	2,590,636.66
减：本报告期基金总赎回份额	55,607,212.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	158,489,784.50

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

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券股份有限公司	2	200,276,218.71	65.24	186,520.39	65.24	-
华西证券股份有限公司	2	68,176,400.40	22.21	63,492.53	22.21	-
华创证券有限责任公司	1	18,381,700.61	5.99	17,118.43	5.99	-
东方财富证券股份有限公司	2	12,272,573.33	4.00	11,429.44	4.00	-
招商证券股份有限公司	1	7,880,182.56	2.57	7,338.92	2.57	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
国盛证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

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资质雄厚，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) 本报告期内本基金租用的券商交易单元未发生变更。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中泰证券股份有限公司	13,431,114.00	55.63	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1,709,758.00	7.08	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	9,000,990.00	37.28	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

安信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
方正证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
信达证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方龙混合型开放式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 19 日
2	关于增加平安银行为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 9 日
3	关于增加和合期货有限公司为东方基金旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 10 日
4	关于增加平安银行股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 24 日
5	关于增加泛华普益基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构同	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金	2023 年 3 月 2 日

	时开通定投及转换业务的公告	管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	关于增加深圳新华信通基金销售有限公司为公司旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 9 日
7	东方龙混合型开放式证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 29 日
8	东方龙混合型开放式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 22 日
9	关于增加华西证券股份有限公司为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
10	关于增加平安银行股份有限公司行 E 通平台为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
11	关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司行 E 通平台费率优惠活动的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
12	关于提醒投资者防范金融诈骗的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》
- 二、《东方龙混合型开放式证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2023 年 8 月 31 日