

东方中国红利混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 29 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。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 4.9 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 | 15 |
| § 5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 15 |
| 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 | 15 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 15 |
| § 6 审计报告 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 15 |
| § 7 年度财务报表 | 17 |
| 7.1 资产负债表 | 17 |
| 7.2 利润表 | 19 |
| 7.3 净资产变动表 | 20 |
| 7.4 报表附注 | 22 |
| § 8 投资组合报告 | 46 |

| | |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 46 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 46 |
| 8.3 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 | 47 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 48 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 51 |
| 8.6 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 | 52 |
| 8.7 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 | 52 |
| 8.8 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 | 52 |
| 8.9 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 | 52 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 52 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 52 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 52 |
| § 9 基金份额持有人信息 | 53 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 53 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 54 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 54 |
| § 10 开放式基金份额变动 | 54 |
| § 11 重大事件揭示 | 54 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 54 |
| 11.2 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 | 54 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 54 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 54 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 55 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 55 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 55 |
| 11.8 其他重大事件 | 57 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 62 |
| 12.1 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 | 62 |
| § 13 备查文件目录 | 62 |
| 13.1 备查文件目录 | 62 |
| 13.2 存放地点 | 62 |
| 13.3 查阅方式 | 62 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金名称 | 东方中国红利混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 东方中国红利混合 |
| 基金主代码 | 009999 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 9 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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 52,951,646.18 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金重点投资于盈利能力优秀、分红水平突出且分红政策稳定的上市公司发行的证券,长期跟踪并分享中国经济高质量发展的成果,争取为基金份额持有人谋求长期、稳健的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金结合宏观经济因素、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 | 中证红利指数收益率×80%+中债总全价指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金,其预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。 |

注:本基金从 2023 年 8 月 28 日起调整基金费率,相关公告已于 2023 年 8 月 25 日在规定媒介上公告。

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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 李景岩 |
| | 联系电话 | 010-66295888 |
| | 电子邮箱 | xxpl@orient-fund.com |
| 客户服务电话 | 010-66578578 或 400-628-5888 | 95599 |
| 传真 | 010-66578700 | 010-68121816 |
| 注册地址 | 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层 | 北京市东城区建国门内大街 69 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 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | 100073 | 100031 |
| 法定代表人 | 崔伟 | 谷澍 |

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》 |
|----------------|---------|

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.orient-fund.com 或 http://www.df5888.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|--------|------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 立信会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区南京东路 61 号四层 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2023 年 | 2022 年 | 2021 年 |
|---------------|----------------|----------------|---------------|
| 本期已实现收益 | -7,100,405.93 | -18,811,299.57 | 16,945,219.79 |
| 本期利润 | -9,156,166.04 | -18,510,455.57 | 3,772,347.86 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1625 | -0.3078 | 0.0477 |
| 本期加权平均净值利润率 | -19.18% | -30.65% | 4.17% |
| 本期基金份额净值增长率 | -17.99% | -25.07% | 13.59% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末 | 2022 年末 | 2021 年末 |
| 期末可供分配利润 | -14,627,488.13 | -7,095,252.74 | 12,451,246.11 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2762 | -0.1293 | 0.1779 |
| 期末基金资产净值 | 38,324,158.05 | 48,427,692.89 | 82,455,775.25 |
| 期末基金份额净值 | 0.7238 | 0.8826 | 1.1779 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2023 年末 | 2022 年末 | 2021 年末 |

| | | | |
|---------------------|---------|---------|--------|
| 基金份额 累计净值 增长率 | -27.62% | -11.74% | 17.79% |
|---------------------|---------|---------|--------|

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。

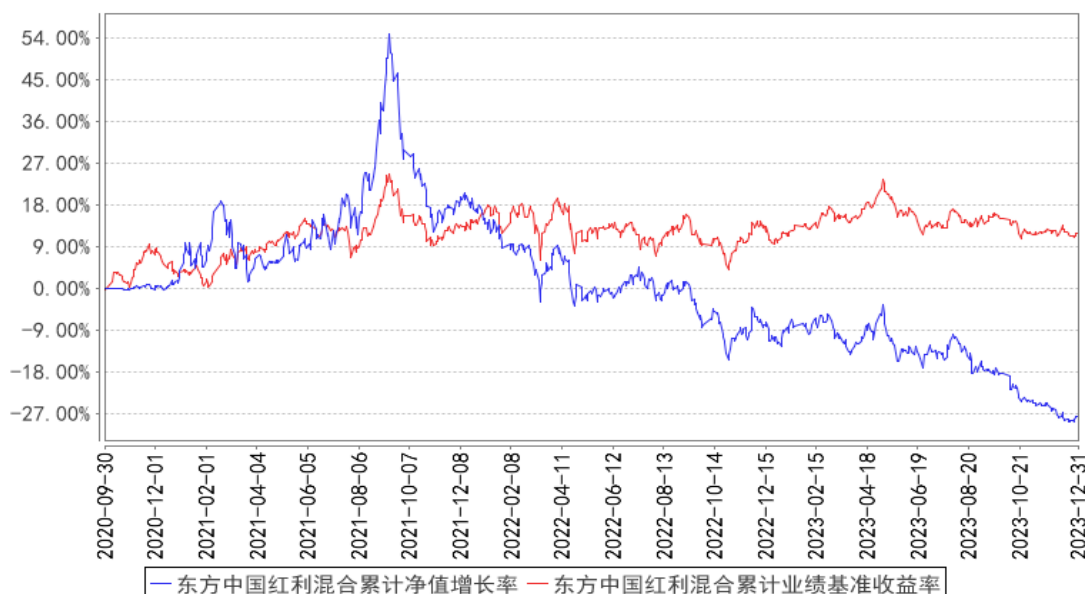
3.2 基金净值表现

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

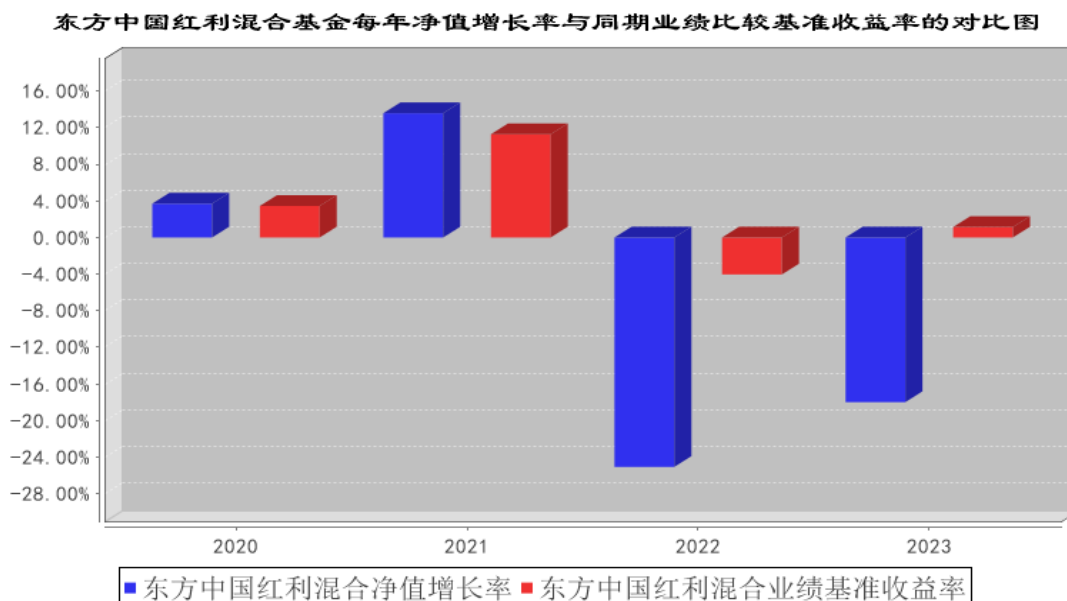
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -11.43% | 0.79% | -2.80% | 0.47% | -8.63% | 0.32% |
| 过去六个月 | -15.67% | 0.96% | -1.43% | 0.51% | -14.24% | 0.45% |
| 过去一年 | -17.99% | 1.05% | 1.14% | 0.56% | -19.13% | 0.49% |
| 过去三年 | -30.20% | 1.33% | 8.02% | 0.82% | -38.22% | 0.51% |
| 自基金合同生效起至今 | -27.62% | 1.29% | 11.75% | 0.82% | -39.37% | 0.47% |

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

东方中国红利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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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12月31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%；海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1170万股，持股比例3.51%；海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1123万股，持股比例3.37%；海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙）持有本公司股份1040万股，持股比例3.12%。

截止2023年12月31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、东方养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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 | | |
| 曲华锋 | 本基金基金经理 | 2023 年 8 月 23 日 | - | 11 年 | 吉林大学信用经济与管理专业硕士，11 年证券从业经历。2012 年 7 月加盟本基金管理人，曾任权益研究部研究员，东方策略 |

| | | | | | |
|-----|---------|-----------|-----------|-----|---|
| | | | | | 成长混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理助理、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、东方支柱产业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。 |
| 薛子徽 | 本基金基金经理 | 2021年1月4日 | 2023年9月1日 | 16年 | 山西大学工商管理、应用心理学专业学士，16年证券从业经历。曾任中宣部政研所研究员、中信基金管理有限责任公司助理研究员、华夏基金管理有限公司研究员。2009年7月加盟本基金管理人，曾任权益投资部房地产、综合、汽车、国防军工、机械设备行业研究员，投资经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金（于2015年7月31日转型为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（自2018年6月21日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金）基金经理、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新价值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、东方成长收益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。 |

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、《东方中国红利混合

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易管理制度的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行T分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 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。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易，不存在同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年全年看，wind 显示上证指数下跌 3.7%、深圳成指下跌 13.54%、创业板指下跌 19.41%、沪深 300 下跌 11.38%、上证 50 下跌 11.73%、科创 50 下跌 11.24%。分行业看，申万一级行业涨幅前五的是通信、传媒、计算机、电子、石油石化；跌幅较大的行业分别是美容护理、房地产、建筑材料、商贸零售、电力设备。

2023 年年全年来看，宽指普遍跌幅 10% 以上，其中创业板指跌幅接近 20%，上证指数跌幅较小，指数经历了冲高回落走势，一二季度表现较好，但伴随经济数据回落及信心不足等因素影响，三四季度指数阴跌，同时市场结构持续分化，TMT 领涨，主题轮动，红利、小微盘风格指数占优，而传统机构重仓的相关赛道领域、顺周期类行业表现较差。

回顾全年，国内一季度在低基数情况下实现了量的超预期回补，二三四季度需求端出现疲弱，海外来看，美国经济数据保持一定韧性，但环比走弱，加息停止，2024 年大概率开启降息周期。从经济构成来看，投资端受到地产拖累，消费需求仍有待恢复，出口端出现一定压力。短期出台一揽子相关政策，后续政策效果仍有待观察，未来不排除进一步加码可能。展望未来，我们认为国内经济依然需要内外“两条腿走路”，对内扩大内需，结构构成看消费领域仍然是国内经济重要支柱，对外依然要走出去，产品、品牌、技术有明显优势的企业在出海道路上仍有很大空间。市场情况来看，2023 年市场仍然有结构性行情，在经济数据的反复波动，市场没有明确主线的情况下，震荡结构化行情依然将延续，后续我们认为需要经济基本面的支撑。对于组合而言，我们仍然坚持一贯的风格，自下而上选择有中长期配置价值的标的，对公司盈利和目前市场定价再平衡，同时从短中长期角度对组合进行盈利估值的再平衡。中长期角度，对于优质龙头个股我们认为业绩稳定性仍然会保持较高胜率，但我们需要在足够合理的价格配置这些优质公司，从估值角度，我们认为，市场整体估值及部分优质个股已经进入中长期配置区间，风险收益比较高，在经济弱复苏的趋势下市场底有望逐步形成。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为-17.99%，业绩比较基准收益率为 1.14%，低于业绩比较基准 19.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年，从国内宏观环境来看，三大工程是全年重要抓手，出口在高基数、海外经济增速回

落的背景下也很难维持高增，消费作为下游慢变量需求恢复时间较慢，政策上财政政策是全年关键，货币政策保持相对宽松，海外情况来看，美联储加息暂停，后续大概率开启降息周期，市场估值目前处于相对较低水平，我们认为伴随一揽子政策出台，后续效果将逐步显现，需要关注政策对经济的影响，同时估值已跌至历史较低分位，当前市场有较高性价比，同时我们仍然需要自下而上不断精选个股，在盈利和估值之间不断进行再平衡，重视自下而上。

本基金延续此前红利风格，配置上仍以代表红利的国企央企为主要持仓，主要因为我们认为新一轮国资委考核机制，能够促使国企央企进一步释放业绩，同时保持高比例分红，估值具备进一步修复空间。且国企央企通常经营稳健，资金来源充裕，具备较强的经营安全垫；同时若未来经济增速提升，相关企业集中在传统周期、大金融行业，同样有望率先受益，总体属于进可攻退可守的选择。总体上看我们的组合延续此前的低估值、红利风格，并将在未来一段时间保持稳定。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金法》和中国证监会发布的有关规定，完善内部控制制度和操作流程；在基金日常运作上，开展定期和不定期监察，强化内控体系和制度的落实；在加强对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过定期检查、专项检查等方式，及时发现问题、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：

（1）开展对公司各项业务的日常监察，对风险隐患做到及时发现、及时化解，保证投资管理、基金销售和后台运营等业务的合法合规。（2）根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强基金投资运作的监察力度，完善了基金投资有关控制制度。（3）进一步完善公司内控体系，完善业务流程，在各个部门和全体人员中实行风险管理责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

（4）注重加强对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规学习活动等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。下一年度，本基金管理人将在不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，给基金份额持有人以更多、更好的回报。

4.7 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”），估值委员会委员包括公司总经理、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）。

4.8 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。

4.9 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二十个工作日低于五千万元的情形，持续期间为 2023 年 3 月 7 日至 2023 年 4 月 27 日、2023 年 8 月 18 日至 2023 年 11 月 14 日、2023 年 11 月 21 日至 2023 年 12 月 31 日。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—东方基金管理股份有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，东方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，东方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 信会师报字[2024]第 ZB30162 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|---------|----------------------------|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 东方中国红利混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了东方中国红利混合型证券投资基金（以下简称东 |

| | |
|-----------------|--|
| | <p>方中国红利基金)财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年1月1日至2023年12月31日的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了东方中国红利基金2023年12月31日的财务状况以及2023年1月1日至2023年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方中国红利基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | <p>东方中国红利基金的基金管理人东方基金管理股份有限公司(以下简称基金管理人)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人负责评估东方中国红利基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉</p> |

| | |
|-----------|---|
| | <p>及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东方中国红利基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方中国红利基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 立信会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 李永江 高慧丽 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区南京东路 61 号 4 层 |
| 审计报告日期 | 2024 年 3 月 21 日 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方中国红利混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 1,338,250.74 | 1,035,520.46 |
| 结算备付金 | | 42,314.99 | 359,190.94 |
| 存出保证金 | | 5,097.24 | 29,909.00 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 36,566,171.09 | 47,009,136.09 |
| 其中：股票投资 | | 34,323,427.20 | 43,988,567.60 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,242,743.89 | 3,020,568.49 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 7.4.7.5 | - | - |
| 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 | | 692,560.07 | 405,562.00 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 5,535.26 | 41,865.06 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 38,649,929.39 | 48,881,183.55 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年12月31日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 117,339.38 | 53,582.81 |
| 应付管理人报酬 | | 40,122.19 | 64,267.09 |
| 应付托管费 | | 6,687.02 | 10,711.17 |
| 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 | 7.4.7.7 | 161,622.75 | 324,929.59 |
| 负债合计 | | 325,771.34 | 453,490.66 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.8 | 52,951,646.18 | 54,869,780.09 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.9 | -14,627,488.13 | -6,442,087.20 |
| 净资产合计 | | 38,324,158.05 | 48,427,692.89 |
| 负债和净资产总计 | | 38,649,929.39 | 48,881,183.55 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7238 元，基金份额总额 52,951,646.18 份。

7.2 利润表

会计主体：东方中国红利混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| 一、营业总收入 | | -8,248,019.41 | -17,281,308.71 |
| 1. 利息收入 | | 16,659.45 | 71,568.75 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.10 | 15,790.96 | 71,568.75 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 868.49 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -6,360,446.86 | -17,773,805.10 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.11 | -7,768,286.86 | -18,459,580.44 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.12 | 46,338.68 | 74,283.28 |
| 资产支持证券投资 | 7.4.7.13 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 1,361,501.32 | 611,492.06 |
| 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） | 7.4.7.17 | -2,055,760.11 | 300,844.00 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 151,528.11 | 120,083.64 |
| 减：二、营业总支出 | | 908,146.63 | 1,229,146.86 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 671,652.68 | 911,229.22 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 111,942.13 | 151,871.48 |
| 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 | 7.4.7.19 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.20 | 124,551.82 | 166,046.16 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -9,156,166.04 | -18,510,455.57 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -9,156,166.04 | -18,510,455.57 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -9,156,166.04 | -18,510,455.57 |

7.3 净资产变动表

会计主体：东方中国红利混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 | 54,869,780.09 | - | -6,442,087.20 | 48,427,692.89 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 54,869,780.09 | - | -6,442,087.20 | 48,427,692.89 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -1,918,133.91 | - | -8,185,400.93 | -10,103,534.84 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -9,156,166.04 | -9,156,166.04 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -1,918,133.91 | - | 970,765.11 | -947,368.80 |
| 其中：1. 基金申购款 | 34,686,412.73 | - | -6,173,341.86 | 28,513,070.87 |
| 2. 基金赎回 | -36,604,546.64 | - | 7,144,106.97 | -29,460,439.67 |

| | | | | |
|--|-----------------------|--------|----------------|----------------|
| 回款 | | | | |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 52,951,646.18 | - | -14,627,488.13 | 38,324,158.05 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2022年1月1日至2022年12月31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 | 70,004,529.14 | - | 12,451,246.11 | 82,455,775.25 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 70,004,529.14 | - | 12,451,246.11 | 82,455,775.25 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -15,134,749.05 | - | -18,893,333.31 | -34,028,082.36 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -18,510,455.57 | -18,510,455.57 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | -15,134,749.05 | - | -382,877.74 | -15,517,626.79 |
| 其中：1. 基金申购款 | 14,354,421.09 | - | 239,631.40 | 14,594,052.49 |
| 2. 基金赎回款 | -29,489,170.14 | - | -622,509.14 | -30,111,679.28 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |

| | | | | |
|------------------|---------------|---|---------------|---------------|
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 54,869,780.09 | - | -6,442,087.20 | 48,427,692.89 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>刘鸿鹏</u> | <u>刘鸿鹏</u> | <u>王丹丹</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方中国红利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2020 年 7 月 29 日中国证监会《关于核准东方中国红利混合型证券投资基金》（证监许可【2020】1622 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《东方中国红利混合型证券投资基金基金合同》自 2020 年 9 月 7 日至 2020 年 9 月 25 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 275,419,628.01 元人民币，业经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）“中喜验字[2020]第 00142 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方中国红利混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 275,527,603.81 份基金单位，其中认购资金利息折合 107,975.80 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方中国红利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、央行票据、金融债、政策性金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券、可交换债券、分离交易的可转换债券）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

2、金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平

均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项

中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例, 损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于月末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2、投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认, 并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内, 按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额, 逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债, 根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后, 逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内, 按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时, 其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额, 确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认, 由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

3、公允价值变动损益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

4、信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率逐日计提并确认。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提并确认。

(3) 卖出回购金融资产利息支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提并确认。

(4) 交易费用

进行股票、债券、同业存单及权证等交易过程中产生的交易费用，在发生时按照确定的金额计入交易费用。

(5) 其他费用

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2. 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3. 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即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；

4. 每一基金份额享有同等分配权；

5. 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 1,338,250.74 | 1,035,520.46 |
| 等于：本金 | 1,338,076.67 | 1,035,036.84 |
| 加：应计利息 | 174.07 | 483.62 |
| 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 | 1,338,250.74 | 1,035,520.46 |
|----|--------------|--------------|

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2023年12月31日 | | | |
|---------------|-------|---------------------|-----------|---------------|---------------|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 36,576,511.77 | - | 34,323,427.20 | -2,253,084.57 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 2,206,182.00 | 42,523.89 | 2,242,743.89 | -5,962.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 2,206,182.00 | 42,523.89 | 2,242,743.89 | -5,962.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 38,782,693.77 | 42,523.89 | 36,566,171.09 | -2,259,046.57 |
| 项目 | | 上年度末 2022年12月31日 | | | |
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 44,178,954.06 | - | 43,988,567.60 | -190,386.46 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 3,007,200.00 | 26,268.49 | 3,020,568.49 | -12,900.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 3,007,200.00 | 26,268.49 | 3,020,568.49 | -12,900.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 47,186,154.06 | 26,268.49 | 47,009,136.09 | -203,286.46 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年12月31日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 81.05 | 65.89 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 41,541.70 | 164,863.70 |
| 其中：交易所市场 | 41,541.70 | 164,863.70 |
| 银行间市场 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 120,000.00 | 160,000.00 |
| 合计 | 161,622.75 | 324,929.59 |

注：预提费用为按日计提的审计费和信息披露费。

7.4.7.8 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12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 54,869,780.09 | 54,869,780.09 |
| 本期申购 | 34,686,412.73 | 34,686,412.73 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -36,604,546.64 | -36,604,546.64 |
| 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 | 52,951,646.18 | 52,951,646.18 |

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。

7.4.7.9 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 | -7,095,252.74 | 653,165.54 | -6,442,087.20 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |

| | | | |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -7,095,252.74 | 653,165.54 | -6,442,087.20 |
| 本期利润 | -7,100,405.93 | -2,055,760.11 | -9,156,166.04 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 445,521.34 | 525,243.77 | 970,765.11 |
| 其中：基金申购款 | -5,347,772.83 | -825,569.03 | -6,173,341.86 |
| 基金赎回款 | 5,793,294.17 | 1,350,812.80 | 7,144,106.97 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -13,750,137.33 | -877,350.80 | -14,627,488.13 |

7.4.7.10 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12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 13,433.94 | 68,678.56 |
| 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 | 1,975.77 | 2,292.33 |
| 其他 | 381.25 | 597.86 |
| 合计 | 15,790.96 | 71,568.75 |

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 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12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -7,768,286.86 | -18,459,580.44 |
| 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 | -7,768,286.86 | -18,459,580.44 |

7.4.7.11.2 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12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 158,622,654.36 | 192,226,500.45 |
| 减：卖出股票成本总额 | 165,926,202.21 | 210,113,003.09 |
| 减：交易费用 | 464,739.01 | 573,077.80 |
| 买卖股票差价收入 | -7,768,286.86 | -18,459,580.44 |

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 56,002.68 | 74,883.28 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -9,664.00 | -600.00 |
| 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 | 46,338.68 | 74,283.28 |

7.4.7.12.2 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12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 3,869,929.09 | 7,669,200.00 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,809,448.00 | 7,500,600.00 |
| 减：应计利息总额 | 70,145.09 | 169,200.00 |
| 减：交易费用 | - | - |
| 买卖债券差价收入 | -9,664.00 | -600.00 |

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|---------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,361,501.32 | 611,492.06 |
| 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 | 1,361,501.32 | 611,492.06 |

7.4.7.17 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12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -2,055,760.11 | 300,844.00 |
| 股票投资 | -2,062,698.11 | 307,894.00 |
| 债券投资 | 6,938.00 | -7,050.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 2. 衍生工具 | - | - |
| 权证投资 | - | - |
| 3. 其他 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | -2,055,760.11 | 300,844.00 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 基金赎回费收入 | 142,591.21 | 111,327.93 |
| 基金转换费收入 | 8,936.90 | 8,755.71 |
| 合计 | 151,528.11 | 120,083.64 |

7.4.7.19 信用减值损失

本报告期及上年度可比期间，本基金无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 审计费用 | 40,000.00 | 40,000.00 |
| 信息披露费 | 80,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费用 | 4,551.82 | 6,046.16 |
| 合计 | 124,551.82 | 166,046.16 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 本基金托管人、销售机构 |
| 渤海国际信托股份有限公司 | 本基金管理人股东 |
| 河北国控资本管理有限公司 | 本基金管理人股东 |
| 海南汇远长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙） | 本基金管理人股东 |
| 海南汇智长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙） | 本基金管理人股东 |
| 海南汇聚长行企业管理咨询合伙企业（有限合伙） | 本基金管理人股东 |
| 东方汇智资产管理有限公司 | 本基金管理人全资子公司 |

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 671,652.68 | 911,229.22 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 306,623.96 | 409,847.12 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 365,028.72 | 501,382.10 |

注：①计提标准：本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的 1.20%（2023 年 8 月 28 日前为 1.50%）年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

③本基金于 2023 年 8 月 28 日起，将基金管理费率自 1.50%调整至 1.20%，详情请见《东方基

金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 111,942.13 | 151,871.48 |

注：①计提标准：本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的 0.20%（2023 年 8 月 28 日前为 0.25%）的年费率计提：

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

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

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

③本基金于 2023 年 8 月 28 日起，将基金托管费率自 0.25%调整至 0.20%，详情请见《东方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

7.4.10.3 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，未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月 31日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 | |
|--------------|---------------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 1,338,250.74 | 13,433.94 | 1,035,520.46 | 68,678.56 |

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.11 利润分配情况

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

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 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。

7.4.13.2.2 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 12 月 31 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 |

7.4.13.2.3 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 12 月 31 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 |

7.4.13.2.4 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 12 月 31 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。

7.4.13.2.5 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 12 月 31 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 |

7.4.13.2.6 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 12 月 31 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 1,338,250.74 | - | - | - | 1,338,250.74 |
| 结算备付金 | 42,314.99 | - | - | - | 42,314.99 |
| 存出保证金 | 5,097.24 | - | - | - | 5,097.24 |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | 34,323,427.20 | 34,323,427.20 |

| | | | | | |
|--------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 交易性金融资产-债券投资 | 2,242,743.89 | - | - | - | 2,242,743.89 |
| 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 | - | - | - | 692,560.07 | 692,560.07 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 5,535.26 | 5,535.26 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 3,628,406.86 | - | - | 35,021,522.53 | 38,649,929.39 |
| 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 | - | - | - | 117,339.38 | 117,339.38 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 40,122.19 | 40,122.19 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,687.02 | 6,687.02 |
| 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 | - | - | - | 161,622.75 | 161,622.75 |
| 负债总计 | - | - | - | 325,771.34 | 325,771.34 |
| 利率敏感度缺口 | 3,628,406.86 | - | - | 34,695,751.19 | 38,324,158.05 |
| 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 | | | | | |
| 货币资金 | 1,035,520.46 | - | - | - | 1,035,520.46 |
| 结算备付金 | 359,190.94 | - | - | - | 359,190.94 |
| 存出保证金 | 29,909.00 | - | - | - | 29,909.00 |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | - | 43,988,567.60 | 43,988,567.60 |
| 交易性金融资产-债券投资 | 3,020,568.49 | - | - | - | 3,020,568.49 |
| 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 | - | - | - | 405,562.00 | 405,562.00 |

| | | | | |
|-----------|--------------|---|---------------|---------------|
| 应收股利 | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | 41,865.06 | 41,865.06 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - |
| 资产总计 | 4,445,188.89 | - | 44,435,994.66 | 48,881,183.55 |
| 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 | - | - | 53,582.81 | 53,582.81 |
| 应付管理人报酬 | - | - | 64,267.09 | 64,267.09 |
| 应付托管费 | - | - | 10,711.17 | 10,711.17 |
| 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 | - | - | 324,929.59 | 324,929.59 |
| 负债总计 | - | - | 453,490.66 | 453,490.66 |
| 利率敏感度缺口 | 4,445,188.89 | - | 43,982,504.00 | 48,427,692.89 |

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。

7.4.13.4.1.2 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（2023年12月31日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| | 市场利率上调 0.25% | -230.44 | -4,049.07 |
| | 市场利率下调 0.25% | 230.44 | 4,049.07 |

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年12月31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 | 34,323,427.20 | 89.56 | 43,988,567.60 | 90.83 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 2,242,743.89 | 5.85 | 3,020,568.49 | 6.24 |
| 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 | 36,566,171.09 | 95.41 | 47,009,136.09 | 97.07 |

7.4.13.4.3.2 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（2023 年 12 月 31 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |

| | | | |
|--|-------------------|-------------|---------------|
| | 沪深 300 指数上涨 5% | 983,997.17 | 2,699,363.02 |
| | 沪深 300 指数下跌 5% | -983,997.17 | -2,699,363.02 |

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 34,323,427.20 | 43,988,567.60 |
| 第二层次 | 2,242,743.89 | 3,020,568.49 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 36,566,171.09 | 47,009,136.09 |

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期及上年度可比期间无第三层次公允价值余额及变动。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

本基金本报告期末及上年度末无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本年度报告报出日，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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 34,323,427.20 | 88.81 |
| | 其中：股票 | 34,323,427.20 | 88.81 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,242,743.89 | 5.80 |
| | 其中：债券 | 2,242,743.89 | 5.80 |
| | 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 | 1,380,565.73 | 3.57 |
| 8 | 其他各项资产 | 703,192.57 | 1.82 |
| 9 | 合计 | 38,649,929.39 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | 9,421,227.20 | 24.58 |
| C | 制造业 | 8,357,200.00 | 21.81 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供 | 1,077,000.00 | 2.81 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| | 应业 | | |
| E | 建筑业 | 1,443,000.00 | 3.77 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,896,300.00 | 7.56 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,492,200.00 | 3.89 |
| J | 金融业 | 6,582,500.00 | 17.18 |
| K | 房地产业 | 3,054,000.00 | 7.97 |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 34,323,427.20 | 89.56 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 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 | 600028 | 中国石化 | 320,000 | 1,785,600.00 | 4.66 |
| 2 | 601857 | 中国石油 | 250,000 | 1,765,000.00 | 4.61 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 1,000 | 1,726,000.00 | 4.50 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 40,000 | 1,612,000.00 | 4.21 |
| 5 | 601988 | 中国银行 | 400,000 | 1,596,000.00 | 4.16 |
| 6 | 000002 | 万 科 A | 150,000 | 1,569,000.00 | 4.09 |
| 7 | 600941 | 中国移动 | 15,000 | 1,492,200.00 | 3.89 |
| 8 | 600048 | 保利发展 | 150,000 | 1,485,000.00 | 3.87 |
| 9 | 000983 | 山西焦煤 | 150,000 | 1,482,000.00 | 3.87 |
| 10 | 601668 | 中国建筑 | 300,000 | 1,443,000.00 | 3.77 |
| 11 | 600938 | 中国海油 | 60,000 | 1,258,200.00 | 3.28 |
| 12 | 601881 | 中国银河 | 100,000 | 1,205,000.00 | 3.14 |
| 13 | 600019 | 宝钢股份 | 200,000 | 1,186,000.00 | 3.09 |
| 14 | 601995 | 中金公司 | 30,000 | 1,141,500.00 | 2.98 |
| 15 | 601006 | 大秦铁路 | 150,000 | 1,081,500.00 | 2.82 |
| 16 | 605368 | 蓝天燃气 | 100,000 | 1,077,000.00 | 2.81 |
| 17 | 002327 | 富安娜 | 120,000 | 1,074,000.00 | 2.80 |
| 18 | 002048 | 宁波华翔 | 80,000 | 1,040,800.00 | 2.72 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 19 | 601997 | 贵阳银行 | 200,000 | 1,028,000.00 | 2.68 |
| 20 | 600012 | 皖通高速 | 90,000 | 991,800.00 | 2.59 |
| 21 | 600123 | 兰花科创 | 79,930 | 882,427.20 | 2.30 |
| 22 | 688009 | 中国通号 | 200,000 | 876,000.00 | 2.29 |
| 23 | 600273 | 嘉化能源 | 100,000 | 859,000.00 | 2.24 |
| 24 | 601225 | 陕西煤业 | 40,000 | 835,600.00 | 2.18 |
| 25 | 603565 | 中谷物流 | 100,000 | 823,000.00 | 2.15 |
| 26 | 600720 | 中交设计 | 80,000 | 806,400.00 | 2.10 |
| 27 | 601766 | 中国中车 | 150,000 | 789,000.00 | 2.06 |
| 28 | 600256 | 广汇能源 | 110,000 | 785,400.00 | 2.05 |
| 29 | 601088 | 中国神华 | 20,000 | 627,000.00 | 1.64 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 600970 | 中材国际 | 3,688,402.00 | 7.62 |
| 2 | 601390 | 中国中铁 | 3,401,200.00 | 7.02 |
| 3 | 601766 | 中国中车 | 3,276,500.00 | 6.77 |
| 4 | 601800 | 中国交建 | 2,944,308.00 | 6.08 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 2,873,468.00 | 5.93 |
| 6 | 000002 | 万科 A | 2,623,888.00 | 5.42 |
| 7 | 600048 | 保利发展 | 2,591,319.00 | 5.35 |
| 8 | 601857 | 中国石油 | 2,440,850.00 | 5.04 |
| 9 | 601881 | 中国银河 | 2,352,247.00 | 4.86 |
| 10 | 601186 | 中国铁建 | 2,333,866.00 | 4.82 |
| 11 | 002230 | 科大讯飞 | 2,253,993.00 | 4.65 |
| 12 | 600028 | 中国石化 | 2,248,856.00 | 4.64 |
| 13 | 601668 | 中国建筑 | 2,100,500.00 | 4.34 |
| 14 | 000928 | 中钢国际 | 2,094,899.00 | 4.33 |
| 15 | 002051 | 中工国际 | 2,016,876.00 | 4.16 |
| 16 | 001979 | 招商蛇口 | 1,980,888.00 | 4.09 |
| 17 | 688009 | 中国通号 | 1,977,000.00 | 4.08 |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 1,941,167.00 | 4.01 |
| 19 | 000983 | 山西焦煤 | 1,929,697.00 | 3.98 |
| 20 | 000617 | 中油资本 | 1,929,660.00 | 3.98 |
| 21 | 601225 | 陕西煤业 | 1,903,840.00 | 3.93 |
| 22 | 600581 | 八一钢铁 | 1,859,198.00 | 3.84 |
| 23 | 002415 | 海康威视 | 1,819,298.00 | 3.76 |
| 24 | 600900 | 长江电力 | 1,770,200.00 | 3.66 |
| 25 | 600720 | 中交设计 | 1,703,573.00 | 3.52 |
| 26 | 601988 | 中国银行 | 1,697,400.00 | 3.51 |
| 27 | 600019 | 宝钢股份 | 1,660,350.00 | 3.43 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 28 | 600390 | 五矿资本 | 1,618,102.00 | 3.34 |
| 29 | 000729 | 燕京啤酒 | 1,611,363.00 | 3.33 |
| 30 | 001872 | 招商港口 | 1,586,293.00 | 3.28 |
| 31 | 001322 | 箭牌家居 | 1,582,988.00 | 3.27 |
| 32 | 600150 | 中国船舶 | 1,512,174.46 | 3.12 |
| 33 | 600941 | 中国移动 | 1,502,945.00 | 3.10 |
| 34 | 600546 | 山煤国际 | 1,488,468.00 | 3.07 |
| 35 | 601698 | 中国卫通 | 1,472,993.00 | 3.04 |
| 36 | 601998 | 中信银行 | 1,439,915.00 | 2.97 |
| 37 | 000877 | 天山股份 | 1,436,050.00 | 2.97 |
| 38 | 603833 | 欧派家居 | 1,353,062.00 | 2.79 |
| 39 | 601898 | 中煤能源 | 1,321,296.00 | 2.73 |
| 40 | 601995 | 中金公司 | 1,279,974.00 | 2.64 |
| 41 | 601601 | 中国太保 | 1,267,094.00 | 2.62 |
| 42 | 600346 | 恒力石化 | 1,249,993.00 | 2.58 |
| 43 | 300616 | 尚品宅配 | 1,244,471.00 | 2.57 |
| 44 | 601989 | 中国重工 | 1,229,000.00 | 2.54 |
| 45 | 601618 | 中国中冶 | 1,216,000.00 | 2.51 |
| 46 | 601319 | 中国人保 | 1,210,802.00 | 2.50 |
| 47 | 601669 | 中国电建 | 1,162,300.00 | 2.40 |
| 48 | 600938 | 中国海油 | 1,139,217.00 | 2.35 |
| 49 | 601088 | 中国神华 | 1,135,210.00 | 2.34 |
| 50 | 605368 | 蓝天燃气 | 1,122,693.00 | 2.32 |
| 51 | 600036 | 招商银行 | 1,121,311.00 | 2.32 |
| 52 | 601658 | 邮储银行 | 1,115,000.00 | 2.30 |
| 53 | 601006 | 大秦铁路 | 1,097,000.00 | 2.27 |
| 54 | 002048 | 宁波华翔 | 1,090,267.00 | 2.25 |
| 55 | 002327 | 富安娜 | 1,089,562.00 | 2.25 |
| 56 | 600010 | 包钢股份 | 1,060,000.00 | 2.19 |
| 57 | 600012 | 皖通高速 | 1,046,346.00 | 2.16 |
| 58 | 601997 | 贵阳银行 | 1,040,000.00 | 2.15 |
| 59 | 000519 | 中兵红箭 | 1,027,497.00 | 2.12 |
| 60 | 601728 | 中国电信 | 1,020,900.00 | 2.11 |
| 61 | 600188 | 兖矿能源 | 1,013,648.00 | 2.09 |
| 62 | 603180 | 金牌厨柜 | 1,006,628.00 | 2.08 |
| 63 | 600325 | 华发股份 | 1,005,828.00 | 2.08 |
| 64 | 600528 | 中铁工业 | 982,627.00 | 2.03 |

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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(%) |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

| | 码 | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 1 | 001979 | 招商蛇口 | 3,714,072.00 | 7.67 |
| 2 | 600048 | 保利发展 | 3,352,710.00 | 6.92 |
| 3 | 600970 | 中材国际 | 3,032,809.00 | 6.26 |
| 4 | 601390 | 中国中铁 | 2,724,401.00 | 5.63 |
| 5 | 600702 | 舍得酒业 | 2,638,813.00 | 5.45 |
| 6 | 000002 | 万 科 A | 2,433,600.00 | 5.03 |
| 7 | 600657 | 信达地产 | 2,406,000.00 | 4.97 |
| 8 | 601800 | 中国交建 | 2,362,738.00 | 4.88 |
| 9 | 603369 | 今世缘 | 2,337,006.00 | 4.83 |
| 10 | 002230 | 科大讯飞 | 2,285,063.00 | 4.72 |
| 11 | 000596 | 古井贡酒 | 2,278,141.00 | 4.70 |
| 12 | 601766 | 中国中车 | 2,251,174.00 | 4.65 |
| 13 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,103,242.00 | 4.34 |
| 14 | 600376 | 首开股份 | 2,066,750.00 | 4.27 |
| 15 | 000858 | 五 粮 液 | 2,065,000.00 | 4.26 |
| 16 | 601186 | 中国铁建 | 2,054,707.00 | 4.24 |
| 17 | 600132 | 重庆啤酒 | 1,895,490.00 | 3.91 |
| 18 | 000961 | 中南建设 | 1,826,000.00 | 3.77 |
| 19 | 600900 | 长江电力 | 1,795,240.00 | 3.71 |
| 20 | 600581 | 八一钢铁 | 1,756,000.00 | 3.63 |
| 21 | 000656 | 金科股份 | 1,739,000.00 | 3.59 |
| 22 | 600390 | 五矿资本 | 1,675,409.00 | 3.46 |
| 23 | 000617 | 中油资本 | 1,650,000.00 | 3.41 |
| 24 | 601688 | 华泰证券 | 1,638,133.00 | 3.38 |
| 25 | 002415 | 海康威视 | 1,630,828.00 | 3.37 |
| 26 | 000729 | 燕京啤酒 | 1,618,115.00 | 3.34 |
| 27 | 600150 | 中国船舶 | 1,614,065.00 | 3.33 |
| 28 | 001322 | 箭牌家居 | 1,519,051.00 | 3.14 |
| 29 | 000928 | 中钢国际 | 1,517,500.00 | 3.13 |
| 30 | 300755 | 华致酒行 | 1,514,303.00 | 3.13 |
| 31 | 600606 | 绿地控股 | 1,475,000.00 | 3.05 |
| 32 | 600546 | 山煤国际 | 1,401,893.00 | 2.89 |
| 33 | 603589 | 口子窖 | 1,319,512.00 | 2.72 |
| 34 | 001872 | 招商港口 | 1,316,847.00 | 2.72 |
| 35 | 603919 | 金徽酒 | 1,311,110.00 | 2.71 |
| 36 | 000877 | 天山股份 | 1,310,160.00 | 2.71 |
| 37 | 000799 | 酒鬼酒 | 1,299,135.00 | 2.68 |
| 38 | 002051 | 中工国际 | 1,299,049.00 | 2.68 |
| 39 | 601377 | 兴业证券 | 1,294,000.00 | 2.67 |
| 40 | 603833 | 欧派家居 | 1,283,803.00 | 2.65 |
| 41 | 601698 | 中国卫通 | 1,259,231.00 | 2.60 |
| 42 | 601898 | 中煤能源 | 1,240,735.00 | 2.56 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 43 | 601788 | 光大证券 | 1,236,143.00 | 2.55 |
| 44 | 600346 | 恒力石化 | 1,188,962.00 | 2.46 |
| 45 | 601998 | 中信银行 | 1,176,000.00 | 2.43 |
| 46 | 601225 | 陕西煤业 | 1,171,040.00 | 2.42 |
| 47 | 000568 | 泸州老窖 | 1,126,700.00 | 2.33 |
| 48 | 601989 | 中国重工 | 1,119,003.00 | 2.31 |
| 49 | 300616 | 尚品宅配 | 1,114,547.00 | 2.30 |
| 50 | 688009 | 中国通号 | 1,094,843.21 | 2.26 |
| 51 | 601658 | 邮储银行 | 1,080,000.00 | 2.23 |
| 52 | 601601 | 中国太保 | 1,077,450.00 | 2.22 |
| 53 | 600036 | 招商银行 | 1,077,145.00 | 2.22 |
| 54 | 601628 | 中国人寿 | 1,077,046.00 | 2.22 |
| 55 | 601669 | 中国电建 | 1,074,000.00 | 2.22 |
| 56 | 600325 | 华发股份 | 1,065,060.00 | 2.20 |
| 57 | 600600 | 青岛啤酒 | 1,059,334.00 | 2.19 |
| 58 | 601319 | 中国人保 | 1,052,000.00 | 2.17 |
| 59 | 603180 | 金牌厨柜 | 1,051,242.00 | 2.17 |
| 60 | 600528 | 中铁工业 | 1,042,815.00 | 2.15 |
| 61 | 600010 | 包钢股份 | 1,035,000.00 | 2.14 |
| 62 | 600188 | 兖矿能源 | 1,026,538.00 | 2.12 |
| 63 | 600519 | 贵州茅台 | 1,014,548.00 | 2.09 |
| 64 | 600909 | 华安证券 | 996,000.00 | 2.06 |

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。

8.4.3 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 | 158,323,759.92 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 158,622,654.36 |

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。

8.5 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 | 2,242,743.89 | 5.85 |
| 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 | 2,242,743.89 | 5.85 |

8.6 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 | 22,000 | 2,242,743.89 | 5.85 |

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金所持有的中国银行（601988）公司因业务违规受到中国人民银行、各地银保监会处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

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。

本基金投资中国银行主要基于以下原因：公司作为传统四大行之一，财务稳健，公司立足于传统外汇外贸等业务，全球化、综合化布局不断完善，对公占比较高，资产质量有所改善，具备一定投资价值。

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。

8.12.2 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。

8.12.3 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 | 5,097.24 |
| 2 | 应收清算款 | 692,560.07 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,535.26 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 703,192.57 |

8.12.4 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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%) |
| 6,436 | 8,227.42 | 0.00 | 0.00 | 52,951,646.18 | 100.00 |

9.2 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 | 56,075.23 | 0.11 |

9.3 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 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 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2020 年 9 月 30 日) 基金份额总额 | 275,527,603.81 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 54,869,780.09 |
| 本报告期基金总申购份额 | 34,686,412.73 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 36,604,546.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 52,951,646.18 |

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，无涉及基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 40,000.00 元；截至 2023 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供 4 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%) | |
| 德邦证券股份有限公司 | 2 | 316,709,070.74 | 100.00 | 295,707.81 | 100.00 | - |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份有限公司 | 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资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部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) 本基金本报告期未发生交易单元变更。

11.7.2 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 (%) |
| 德邦证券股份有限公司 | 3,808,214.00 | 100.00 | 5,000,000.00 | 100.00 | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 太平洋 证券股 份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证 券股 份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证 券股 份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |

11.8 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 | 东方中国红利混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告 | 基金管理人网站及中国 证监会基金电子披露网 站 | 2023 年 1 月 19 日 |
| 2 | 关于增加玄元保险代理有限公司为东 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 3 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时开 通定投及转换业务的公告 | 证券时报、证券日报、 中国证券报、上海证券 报、基金管理人网站及 中国证监会基金电子披 露网站 | 2023 年 3 月 2 日 |
| 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 | 东方中国红利混合型证券投资基金 2022 年年度报告 | 基金管理人网站及中国 证监会基金电子披露网 | 2023 年 3 月 29 日 |

| | | | |
|----|---|---|-----------------|
| | | 站 | |
| 8 | 东方中国红利混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 基金管理人网站及中国 证监会基金电子披露网 站 | 2023 年 4 月 22 日 |
| 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 |
| 13 | 关于增加杭州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 7 月 13 日 |
| 14 | 东方中国红利混合型证券投资基金 2023 年第 2 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 7 月 21 日 |
| 15 | 关于增加九州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 8 月 1 日 |
| 16 | 关于增加招商银行股份有限公司招赢 通平台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 8 月 1 日 |
| 17 | 关于增加平安银行股份有限公司为东 方基金旗下部分基金销售机构同时开 | 中国证券报、基金管理 人网站及中国证监会基 | 2023 年 8 月 17 日 |

| | | | |
|----|---|---|-----------------|
| | 通定投及转换业务的公告 | 金电子披露网站 | |
| 18 | 关于增加海通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 8 月 19 日 |
| 19 | 东方中国红利混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 8 月 23 日 |
| 20 | 东方中国红利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 8 月 24 日 |
| 21 | 东方中国红利混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 1 号） | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 8 月 24 日 |
| 22 | 关于增加海通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 8 月 24 日 |
| 23 | 关于增加宁波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 8 月 24 日 |
| 24 | 东方中国红利混合型证券投资基金基金合同(2023 年 8 月修订) | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 8 月 25 日 |
| 25 | 东方中国红利混合型证券投资基金托管协议(2023 年 8 月修订) | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 8 月 25 日 |
| 26 | 东方基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告 | 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 8 月 25 日 |
| 27 | 东方中国红利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 8 月 29 日 |
| 28 | 东方中国红利混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 2 号） | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 8 月 29 日 |
| 29 | 关于增加国金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 | 证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券 | 2023 年 8 月 29 日 |

| | | | |
|----|--|---|------------------|
| | 投及转换业务的公告 | 报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 30 | 东方中国红利混合型证券投资基金 2023 年中期报告 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 8 月 31 日 |
| 31 | 东方中国红利混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 9 月 1 日 |
| 32 | 东方基金管理股份有限公司关于终止凤凰金信(海口)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 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 9 月 1 日 |
| 33 | 东方中国红利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 9 月 4 日 |
| 34 | 东方中国红利混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 3 号) | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 9 月 4 日 |
| 35 | 关于增加甬兴证券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并参与申购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 9 月 14 日 |
| 36 | 关于增加招商银行股份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 9 月 26 日 |
| 37 | 关于增加麦高证券有限责任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并参加申购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 10 月 19 日 |
| 38 | 关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司邮你同赢平台为公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购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 10 月 24 日 |
| 39 | 东方中国红利混合型证券投资基金 2023 年第 3 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 10 月 25 日 |
| 40 | 关于增加长江证券股份有限公司为公 | 证券时报、证券日报、 | 2023 年 10 月 30 日 |

| | | | |
|----|---|---|------------------|
| | 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 | 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 | |
| 41 | 东方基金管理股份有限公司关于恢复乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 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 11 月 3 日 |
| 42 | 东方中国红利混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 4 号） | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 11 月 13 日 |
| 43 | 东方中国红利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 11 月 13 日 |
| 44 | 关于增加甬兴证券有限公司为东方中国红利混合型证券投资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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 11 月 13 日 |
| 45 | 东方基金管理股份有限公司关于公司旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司转换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 11 月 16 日 |
| 46 | 关于增加德邦证券股份有限公司旗下部分基金销售机构同时开通定投及转换业务并参加申购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 11 月 16 日 |
| 47 | 关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司申购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 11 月 24 日 |
| 48 | 关于旗下部分基金参与东兴证券股份有限公司申购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 11 月 28 日 |
| 49 | 关于增加深圳前海微众银行股份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 12 月 12 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

13.3 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

2024 年 3 月 30 日