

# 东方核心动力混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</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 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方核心动力混合型证券投资基金	
基金简称	东方核心动力混合	
基金主代码	400011	
前端交易代码	400011	
后端交易代码	400012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 6 月 24 日	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	293,306,732.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方核心动力混合 A	东方核心动力混合 C
下属分级基金的交易代码	400011	014986
报告期末下属分级基金的份额总额	191,810,025.58 份	101,496,706.72 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	坚持长期投资理念，以全球视野考察中国经济、行业以及个股的成长前景，通过“核心-卫星”投资策略，把握中国经济崛起过程中的投资机遇，在控制投资风险的前提下，追求资本的长期稳定增值。
投资策略	根据对宏观经济运行周期的研判，确定股票、债券、现金等资产的配置比例，并根据不同资产类别的收益情况进行动态调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东方基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	许俊
	联系电话	010-66295888	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95566
传真		010-66578700	010-66594942
注册地址		北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号

邮政编码	100073	100818
法定代表人	崔伟	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	东方核心动力混合 A	东方核心动力混合 C
本期已实现收益	3,902,144.56	-1,974,605.00
本期利润	5,795,515.10	-678,528.94
加权平均基金份 额本期利润	0.0279	-0.0171
本期加权平均净 值利润率	2.29%	-1.42%
本期基金份额净 值增长率	1.76%	1.55%
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	37,895,435.73	19,773,903.29
期末可供分配基 金份额利润	0.1976	0.1948
期末基金资产净 值	229,705,461.31	121,270,610.01
期末基金份额净 值	1.1976	1.1948
3.1.3 累计期末	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	92.87%	-10.26%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方核心动力混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.68%	0.76%	1.05%	0.69%	-0.37%	0.07%
过去三个月	-2.68%	0.71%	-3.73%	0.66%	1.05%	0.05%
过去六个月	1.76%	0.71%	0.05%	0.67%	1.71%	0.04%
过去一年	-11.32%	0.89%	-10.66%	0.79%	-0.66%	0.10%
过去三年	13.14%	1.14%	-3.05%	0.96%	16.19%	0.18%
自基金合同生效起至今	92.87%	1.33%	42.20%	1.15%	50.67%	0.18%

东方核心动力混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.65%	0.76%	1.05%	0.69%	-0.40%	0.07%
过去三个月	-2.78%	0.71%	-3.73%	0.66%	0.95%	0.05%
过去六个月	1.55%	0.71%	0.05%	0.67%	1.50%	0.04%
过去一年	-11.68%	0.89%	-10.66%	0.79%	-1.02%	0.10%
自基金合同生效起	-10.26%	1.07%	-13.81%	0.93%	3.55%	0.14%

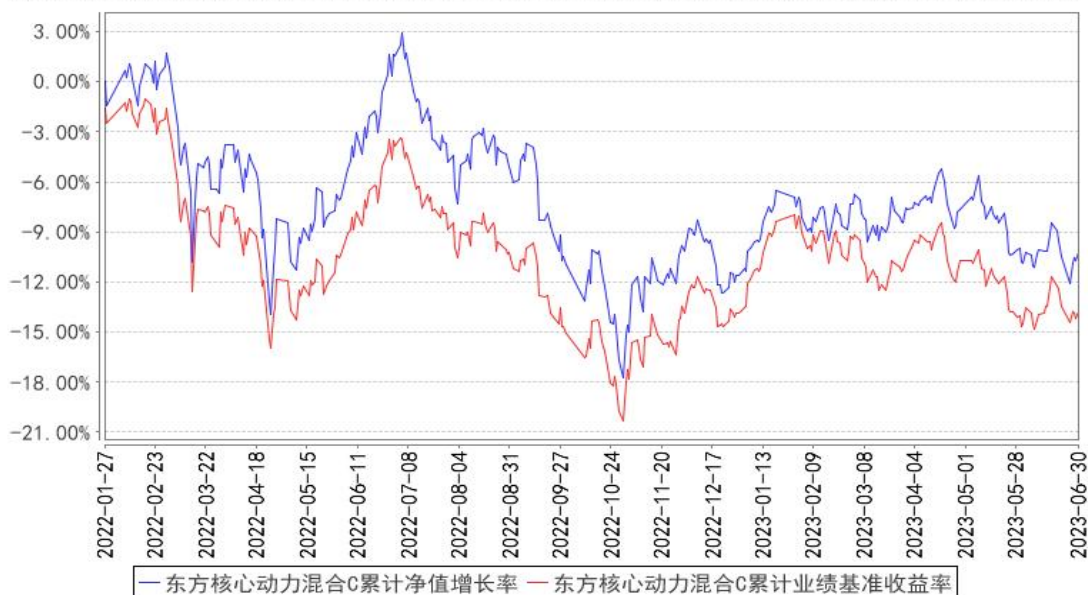
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

东方核心动力混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方核心动力混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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



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

截止 2023 年 6 月 30 日，本公司管理六十余只开放式证券投资基金——东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长回报平衡混合型证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方城镇消费主题混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方永悦 18 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方臻慧纯债债券型证券投资基金、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金、东方中国红利混合型证券投资基金、东方恒瑞短债债券型证券投资基金、东方可转债债券型证券投资基金、东方鑫享价值成长一年持有期混合型证券投资基金、东方品质消费一年持有期混合型证券投资基金、东方兴润债券型证券投资基金、东方中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、东方臻善纯债债券型证券投资基金、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金、东方创新成长混合型证券投资基金、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金、东方兴瑞趋势领航混合型证券投资

基金、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金、东方臻裕债券型证券投资基金、东方匠心优选混合型证券投资基金、东方专精特新混合型发起式证券投资基金、东方中证 500 指数增强型证券投资基金、东方高端制造混合型证券投资基金、东方创新医疗股票型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盛泽	本基金基金经理、量化投资部总经理、资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员	2019 年 9 月 17 日	-	8 年	量化投资部总经理，资产配置部总经理、公募投资决策委员会委员。华威大学经济与国际金融经济学硕士，8 年证券从业经历。曾任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018 年 7 月加盟本基金管理人，曾任量化投资部总经理助理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理，现任东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方量化多策略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、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、东方中证 500 指数增强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、《东方核心动力混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段同向交易价差、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

回顾上半年，A 股各主要指数的涨跌幅分别为：上证综指 3.65%，沪深 300 指数-0.75%，中证 500 指数 2.29%，中证 1000 指数 5.1%，创业板指-5.61%，科创 50 指数 4.71%。市场总体小幅上涨，但各指数有一定分化，从市值风格角度来看，小市值指数相对好于大市值指数。

行业方面，上半年涨幅居前的行业是通信、传媒、计算机，涨幅靠后是销服、地产、综合。以传媒为代表的 TMT 行业上半年涨幅和振幅都较大，其他各行业亮点较少，行业指数结构分化较大。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日,本基金 A 类净值增长率为 1.76%, 业绩比较基准收益率为 0.05%, 高于业绩比较基准 1.71%; 本基金 C 类净值增长率为 1.55%, 业绩比较基准收益率为 0.05%, 高于业绩比较基准 1.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年宏观经济仍处于弱复苏的爬坡阶段,经济数据指标虽然偏弱,但是边际改善仍在持续进行中。A 股在此期间并未延续业绩主线而演绎,在人工智能等概念发酵助推下,TMT 行业上半年涨幅较大,其他顺周期板块亮点缺乏。从涨幅收益拆解来看,我们认为上半年市场涨幅和行业基本面相关性不强,主题概念型交易情绪较重,在未有业绩支撑的前提下,热门板块估值压力陡增。除此之外,我们也看到“业绩主线”上的亮点,具体表现在大型国有企业当中,业绩确定性高叠加分红率长期优异的大型企业亦表现尚佳。这其中一方面也反映了市场资金也在弱复苏的经济环境下寻求业绩确定性的低估值板块,理论超额收益空间较大。

展望下半年,我们预期下半年提振社会总需求方面会有较大的政策力度支持,这块政策力度有望超过上半年。根据中央经济工作会议精神的指示,有利于提振市场需求的政策“组合拳”将是未来市场关注的重点。市场方面,上半年主题概念板块较热而缺乏业绩主线行情也是因为市场流动性处于存量博弈的阶段,情绪相对较弱。在经济弱复苏的周期环境下,机构投资者相对比较谨慎,我们判断下半年价值类投资仍有较大机会,热门板块则会有所规避。随着经济复苏受益的板块可能会有较好表现,我们将积极捕捉含有潜在超额收益的板块及个股机会,同时严格控制组合风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

##### 1. 委员会主任

负责召集估值委员会工作会议,就估值参与各方提交的估值问题组织讨论,进行决议并组织

实施；因特殊原因，委员会主任无法履行职责时，由指定的副主任代理其行使召集职责。

## 2. 运营部

(1) 自行或应各方需求提请估值委员会召集估值委员会会议。

(2) 征求托管行意见并借鉴行业通行做法，提出估值方法的修改意见。

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

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

(5) 负责起草估值相关制度、办法等，并履行规定流程后执行。

## 3. 投研部门

根据现行法律法规及各产品相关法律文件，适时评估各产品持有投资品种的现有估值政策及估值方法是否公允、适当；对估值方法有失公允性时，投研部门必要时可向运营部提交估值方法调整说明，由运营部提请估值委员会召集估值会议进行审议。

## 4. 合规法务部、风险管理部：

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

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在东方核心动力混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：东方核心动力混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 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	4,816,113.89	3,325,901.34
结算备付金		367,848.54	1,310,345.47
存出保证金		34,373.93	105,497.44
交易性金融资产	6.4.7.2	346,505,857.28	287,386,660.64
其中：股票投资		327,306,095.17	271,276,962.01
基金投资		-	-
债券投资		19,199,762.11	16,109,698.63
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		323,596.15	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,903.12	573.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		352,057,692.91	292,128,978.60
<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		1,536.23	949.25
应付管理人报酬		423,554.37	425,661.18
应付托管费		70,592.39	70,943.52
应付销售服务费		37,380.51	10,163.27
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	548,558.09	688,195.75
负债合计		1,081,621.59	1,195,912.97
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	293,306,732.30	247,199,702.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	57,669,339.02	43,733,362.91
净资产合计		350,976,071.32	290,933,065.63
负债和净资产总计		352,057,692.91	292,128,978.60

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，东方核心动力混合 A 基金份额净值 1.1976 元，基金份额总额 191,810,025.58 份；东方核心动力混合 C 基金份额净值 1.1948 元，基金份额总额 101,496,706.72 份。东方核心动力混合份额总额合计为 293,306,732.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方核心动力混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 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
<b>一、营业总收入</b>		7,943,772.74	-8,847,896.28
1. 利息收入		10,572.45	7,083.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,572.45	7,083.92
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）		4,677,214.70	-12,015,929.23
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-73,985.33	-14,375,533.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	149,473.96	132,593.78
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	4,601,726.07	2,227,010.70
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	3,189,446.60	3,135,712.77
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	66,538.99	25,236.26
<b>减：二、营业总支出</b>		2,826,786.58	1,890,385.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,247,696.69	1,513,736.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	374,616.16	252,289.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	96,387.78	16,689.97
4. 投资顾问费		-	-



5. 利息支出		177.70	-
其中：卖出回购金融资产支出		177.70	-
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	107,908.25	107,670.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,116,986.16	-10,738,282.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,116,986.16	-10,738,282.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,116,986.16	-10,738,282.18

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东方核心动力混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	247,199,702.72	-	43,733,362.91	290,933,065.63
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）	247,199,702.72	-	43,733,362.91	290,933,065.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	46,107,029.58	-	13,935,976.11	60,043,005.69
（一）、综合收益总额	-	-	5,116,986.16	5,116,986.16
（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）	46,107,029.58	-	8,818,989.95	54,926,019.53
其中：1. 基金申购款	110,855,311.38	-	23,598,432.01	134,453,743.39

2. 基金赎回款	-64,748,281.80	-	-14,779,442.06	-79,527,723.86
(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)	293,306,732.30	-	57,669,339.02	350,976,071.32
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)	120,777,477.11	-	101,792,059.40	222,569,536.51
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)	120,777,477.11	-	101,792,059.40	222,569,536.51
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,631,850.48	-	-5,688,259.64	943,590.84
(一)、综合收益总额	-	-	-10,738,282.18	-10,738,282.18
(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)	6,631,850.48	-	5,050,022.54	11,681,873.02
其中：1. 基金申购款	26,760,968.37	-	17,192,105.90	43,953,074.27
2. 基金赎回款	-20,129,117.89	-	-12,142,083.36	-32,271,201.25
(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)	127,409,327.59	-	96,103,799.76	223,513,127.35

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

东方核心动力股票型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2009 年 4 月 10 日《关于核准东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可【2009】302 号）和 2009 年 4 月 23 日《关于东方核心动力股票型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2009】301 号）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《东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金合同》自 2009 年 5 月 5 日至 2009 年 6 月 19 日公开募集设立。本基金为股票型开放式基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 771,742,249.97 元，业经立信会计师事务所有限公司“信会师报字【2009】第 80607 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金合同》于 2009 年 6 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 771,974,243.03 份基金份额，其中认购资金利息折合 231,993.06 份基金份额。本基金的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《东方核心动力混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金自 2015 年 7 月 31 日起变更名称为“东方核心动力混合型证券投资基金”，基金代码 400011 保持不变，详情可参阅《关于东方核心动力股票型开放式证券投资基金变更基金名称并修改基金合同的公告》。

本基金自 2022 年 1 月 27 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，并自 2022 年 1 月 27 日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。详情可参阅本公司于 2022 年 1 月 26 日发布的《关

于东方核心动力混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改《基金合同》等法律文件的公告》。

#### 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》以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	4,816,113.89
等于：本金	4,815,763.02
加：应计利息	350.87
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	4,816,113.89

#### 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	338,342,489.20	-	327,306,095.17	-11,036,394.03	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	18,894,017.18	302,242.11	19,199,762.11	3,502.82
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	18,894,017.18	302,242.11	19,199,762.11	3,502.82
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	357,236,506.38	302,242.11	346,505,857.28	-11,032,891.21	

#### 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	5.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	299,210.77
其中：交易所市场	299,210.77
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	245,780.45
其他	3,561.32
合计	548,558.09

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费，其他为上海、深圳证券交易所返还的证管费。

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 东方核心动力混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	226,037,521.12	226,037,521.12
本期申购	9,195,225.83	9,195,225.83
本期赎回（以“-”号填列）	-43,422,721.37	-43,422,721.37
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	191,810,025.58	191,810,025.58

##### 东方核心动力混合 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,162,181.60	21,162,181.60
本期申购	101,660,085.55	101,660,085.55

本期赎回（以“-”号填列）	-21,325,560.43	-21,325,560.43
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	101,496,706.72	101,496,706.72

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

东方核心动力混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	141,070,236.22	-101,073,212.05	39,997,024.17
本期利润	3,902,144.56	1,893,370.54	5,795,515.10
本期基金份额交易产生的变动数	-22,157,352.77	14,260,249.23	-7,897,103.54
其中：基金申购款	5,723,842.73	-3,628,979.92	2,094,862.81
基金赎回款	-27,881,195.50	17,889,229.15	-9,991,966.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	122,815,028.01	-84,919,592.28	37,895,435.73

东方核心动力混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,798,495.24	-1,062,156.50	3,736,338.74
本期利润	-1,974,605.00	1,296,076.06	-678,528.94
本期基金份额交易产生的变动数	21,590,508.52	-4,874,415.03	16,716,093.49
其中：基金申购款	26,401,348.46	-4,897,779.26	21,503,569.20
基金赎回款	-4,810,839.94	23,364.23	-4,787,475.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,414,398.76	-4,640,495.47	19,773,903.29

#### 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	6,983.81
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	2,981.04
其他	607.60
合计	10,572.45

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	-73,985.33
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	-73,985.33

#### 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	202,119,668.23
减：卖出股票成本总额	201,537,297.88
减：交易费用	656,355.68
买卖股票差价收入	-73,985.33

### 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	152,813.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,339.66
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	149,473.96

#### 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	3,138,271.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,100,429.66
减：应计利息总额	41,181.92
减：交易费用	-

买卖债券差价收入	-3,339.66
----------	-----------

#### 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	4,601,726.07
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	4,601,726.07

#### 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	3,189,446.60
股票投资	3,152,486.94
债券投资	36,959.66
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	3,189,446.60

#### 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	66,259.48
基金转换费收入	279.51
合计	66,538.99

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,527.80
账户维护费	18,600.00
合计	107,908.25

#### 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
中国银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)

东北证券股份有限公司	1,046,598.32	0.23	-	-
------------	--------------	------	---	---

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东北证券股份有限公司	964.20	0.23	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,247,696.69	1,513,736.47
其中：支付销售机构的客户维护费	139,474.28	120,277.98

注：①计提标准：基金管理费按前一日基金资产净值的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：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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托管费	374,616.16	252,289.42

注：①计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 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：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方核心动力混合 A	东方核心动力混合 C	合计
东方基金管理股份有限公司	-	70,940.53	70,940.53
合计	-	70,940.53	70,940.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方核心动力混合 A	东方核心动力混合 C	合计
合计	-	-	-

注：本基金仅对 C 类基金份额收取销售服务费。

①计提标准：本基金 C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：本基金 C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，经基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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

中国银行股份有限公司	4,816,113.89	6,983.81	2,459,074.62	4,850.10
------------	--------------	----------	--------------	----------

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

#### 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	99	2,765.07	3,278.88	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.93	3,767	36,163.20	37,406.31	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	25.32	448	5,322.24	11,343.36	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	20.03	114	2,152.32	2,283.42	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	16.45	157	2,414.66	2,582.65	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	42.55	54	2,401.92	2,297.70	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.85	138	3,979.92	4,257.30	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	42.45	33.10	226	9,593.70	7,480.60	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.71	246	10,135.20	10,506.66	-

301157	华塑科技	2023年 3月1日	6个月	新股流 通受限	56.50	52.92	150	8,475.00	7,938.00	-
301170	锡南科技	2023年 6月16日	6个月	新股流 通受限	34.00	35.61	250	8,500.00	8,902.50	-
301203	国泰环保	2023年 3月28日	6个月	新股流 通受限	46.13	34.97	195	8,995.35	6,819.15	-
301210	金杨股份	2023年 6月21日	6个月	新股流 通受限	57.88	49.71	243	14,064.84	12,079.53	-
301225	恒勃股份	2023年 6月8日	6个月	新股流 通受限	35.66	34.28	333	11,874.78	11,415.24	-
301232	飞沃科技	2023年 6月8日	6个月	新股流 通受限	72.50	58.48	161	11,672.50	9,415.28	-
301246	宏源药业	2023年 3月10日	6个月	新股流 通受限	50.00	30.71	317	15,850.00	9,735.07	-
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	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301262	海看股份	2023年 6月13日	6个月	新股流 通受限	30.22	25.97	471	14,233.62	12,231.87	-
301281	科源制药	2023年 3月28日	6个月	新股流 通受限	44.18	25.36	284	8,968.54	7,202.24	-
301291	明阳电气	2023年 6月21日	6个月	新股流 通受限	38.13	31.57	437	16,662.81	13,796.09	-
301307	美利信	2023年 4月14日	6个月	新股流 通受限	32.34	32.00	321	10,381.14	10,272.00	-
301310	鑫宏业	2023年 5月26日	6个月	新股流 通受限	67.28	65.42	288	19,376.64	18,840.96	-
301317	鑫磊股份	2023年 1月12日	6个月	新股流 通受限	20.67	26.14	694	14,344.98	18,141.16	-
301322	绿通科技	2023年 2月27日	6个月	新股流 通受限	131.11	53.20	149	12,979.89	7,926.80	-



		日								
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	41.11	208	8,124.48	8,550.88	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.74	606	8,974.86	8,326.44	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	17.23	563	9,880.65	9,700.49	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.86	424	10,078.48	18,172.64	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.81	98	7,044.24	9,095.38	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.84	277	9,343.21	8,819.68	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.57	402	9,913.32	9,073.14	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	406	18,740.96	14,502.32	-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.63	225	13,122.00	10,266.75	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	655	10,637.20	11,102.25	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.19	466	13,397.50	9,874.54	-
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	2,618	104,144.04	104,144.04	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	12.59	277	2,869.72	3,487.43	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	13.72	288	3,358.08	3,951.36	-
601916	浙商	2023年	1个月	配股流	2.02	2.64	432,660	873,973.20	1,142,222.40	-

	银行	6月27日	内(含)	通受限							
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	18.25	139	2,210.10	2,536.75	-	
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.68	122	1,778.76	2,034.96	-	
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.07	1,420	28,201.20	25,659.40	-	
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	17.20	743	10,520.88	12,779.60	-	
688352	硕中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.63	839	10,151.90	10,596.57	-	
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	78.84	289	6,820.40	22,784.76	-	
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	27.88	346	6,643.20	9,646.48	-	
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.45	2,719	15,471.11	14,818.55	-	
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.24	1,315	14,596.50	22,670.60	-	
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	39.99	38.64	252	10,077.48	9,737.28	-	
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	20.92	19.23	307	6,422.44	5,903.61	-	
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	25.43	472	10,317.92	12,002.96	-	
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	139.16	87	13,257.06	12,106.92	-	
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.72	246	10,742.82	13,215.12	-	

688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	24.18	352	7,451.84	8,511.36	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.46	373	11,286.98	9,496.58	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.08	68	8,554.40	8,029.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	89.31	103	12,965.64	9,198.93	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	30.89	305	7,710.40	9,421.45	-

#### 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	4,816,113.89	-	-	-	4,816,113.89
结算备付金	367,848.54	-	-	-	367,848.54
存出保证金	34,373.93	-	-	-	34,373.93
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-327,306,095.17	327,306,095.17
交易性金融资产-债券投资	19,199,762.11	-	-	-	19,199,762.11
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	-	-	-	323,596.15	323,596.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,903.12	9,903.12
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,418,098.47	-	-	-327,639,594.44	352,057,692.91

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	-	-	-	1,536.23	1,536.23
应付管理人报酬	-	-	-	423,554.37	423,554.37
应付托管费	-	-	-	70,592.39	70,592.39
应付销售服务费	-	-	-	37,380.51	37,380.51
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	-	-	-	548,558.09	548,558.09
负债总计	-	-	-	1,081,621.59	1,081,621.59
利率敏感度缺口	24,418,098.47	-	-	-326,557,972.85	350,976,071.32
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	3,325,901.34	-	-	-	3,325,901.34
结算备付金	1,310,345.47	-	-	-	1,310,345.47
存出保证金	105,497.44	-	-	-	105,497.44
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-271,276,962.01	271,276,962.01
交易性金融资产-债券投资	16,109,698.63	-	-	-	16,109,698.63
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	-	-	-	573.71	573.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,851,442.88	-	-	-271,277,535.72	292,128,978.60
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	-	-	-	949.25	949.25

应付管理人报酬	-	-	425,661.18	425,661.18
应付托管费	-	-	70,943.52	70,943.52
应付销售服务费	-	-	10,163.27	10,163.27
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	-	-	688,195.75	688,195.75
负债总计	-	-	1,195,912.97	1,195,912.97
利率敏感度缺口	20,851,442.88	-	-270,081,622.75	290,933,065.63

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%	-6,294.84	-21,595.05
	市场利率下调 0.25%	6,294.84	21,595.05

#### 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	327,306,095.17	93.26	271,276,962.01	93.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	19,199,762.11	5.47	16,109,698.63	5.54
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	346,505,857.28	98.73	287,386,660.64	98.78

#### 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%	14,365,604.75	11,512,302.29
沪深 300 指数下跌 5%	-14,365,604.75	-11,512,302.29	

## 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	326,546,920.04	270,492,392.47
第二层次	19,376,709.85	16,109,698.63
第三层次	582,227.39	784,569.54
合计	346,505,857.28	287,386,660.64

#### 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	327,306,095.17	92.97
	其中：股票	327,306,095.17	92.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,199,762.11	5.45
	其中：债券	19,199,762.11	5.45
	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	5,183,962.43	1.47
8	其他各项资产	367,873.20	0.10
9	合计	352,057,692.91	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	22,739,593.00	6.48
C	制造业	156,327,482.19	44.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,330,420.31	5.22
E	建筑业	14,093,802.11	4.02
F	批发和零售业	31,518.75	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	19,467,049.00	5.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,449,837.47	2.69
J	金融业	79,443,625.40	22.64
K	房地产业	4,467,024.00	1.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,867,962.82	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	78,089.07	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	9,691.05	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	327,306,095.17	93.26

### 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	600519	贵州茅台	7,859	13,289,569.00	3.79
2	600036	招商银行	236,300	7,741,188.00	2.21
3	300750	宁德时代	28,580	6,538,818.20	1.86
4	601288	农业银行	1,851,900	6,537,207.00	1.86
5	601766	中国中车	966,000	6,279,000.00	1.79
6	600332	白云山	191,200	6,095,456.00	1.74
7	601169	北京银行	1,313,300	6,080,579.00	1.73
8	601390	中国中铁	796,700	6,038,986.00	1.72
9	600050	中国联通	1,227,800	5,893,440.00	1.68
10	601328	交通银行	992,800	5,758,240.00	1.64
11	600028	中国石化	890,400	5,662,944.00	1.61
12	601006	大秦铁路	751,800	5,585,874.00	1.59
13	601618	中国中冶	1,379,400	5,476,218.00	1.56
14	601225	陕西煤业	297,500	5,411,525.00	1.54
15	601100	恒立液压	83,200	5,352,256.00	1.52
16	601009	南京银行	646,300	5,170,400.00	1.47
17	601377	兴业证券	829,630	5,077,335.60	1.45
18	603369	今世缘	96,000	5,068,800.00	1.44
19	300433	蓝思科技	426,100	5,010,936.00	1.43
20	601916	浙商银行	1,874,860	4,949,630.40	1.41
21	688009	中国通号	846,800	4,911,440.00	1.40
22	600795	国电电力	1,274,800	4,882,484.00	1.39
23	601665	齐鲁银行	1,244,200	4,877,264.00	1.39
24	300009	安科生物	485,880	4,858,800.00	1.38
25	300760	迈瑞医疗	16,000	4,796,800.00	1.37
26	002568	百润股份	131,900	4,794,565.00	1.37
27	601066	中信建投	197,800	4,786,760.00	1.36
28	600061	国投资本	661,100	4,707,032.00	1.34
29	601881	中国银河	400,300	4,647,483.00	1.32
30	002032	苏泊尔	92,700	4,635,000.00	1.32
31	600674	川投能源	303,600	4,569,180.00	1.30
32	601857	中国石油	610,200	4,558,194.00	1.30
33	600007	中国国贸	241,200	4,467,024.00	1.27
34	000568	泸州老窖	21,250	4,453,362.50	1.27
35	600089	特变电工	194,900	4,344,321.00	1.24

36	600548	深高速	476,300	4,277,174.00	1.22
37	601168	西部矿业	400,200	4,206,102.00	1.20
38	600662	外服控股	723,400	4,137,848.00	1.18
39	601398	工商银行	848,100	4,087,842.00	1.16
40	600438	通威股份	115,700	3,969,667.00	1.13
41	601939	建设银行	630,600	3,947,556.00	1.12
42	601319	中国人保	674,600	3,939,664.00	1.12
43	002690	美亚光电	151,000	3,888,250.00	1.11
44	003816	中国广核	1,237,100	3,847,381.00	1.10
45	000895	双汇发展	155,500	3,808,195.00	1.09
46	601138	工业富联	150,300	3,787,560.00	1.08
47	601318	中国平安	80,684	3,743,737.60	1.07
48	600312	平高电气	290,900	3,604,251.00	1.03
49	688223	晶科能源	252,000	3,543,120.00	1.01
50	600566	济川药业	117,000	3,397,680.00	0.97
51	000858	五粮液	20,000	3,271,400.00	0.93
52	300124	汇川技术	49,300	3,165,553.00	0.90
53	600018	上港集团	599,900	3,149,475.00	0.90
54	603899	晨光股份	70,300	3,138,192.00	0.89
55	000792	盐湖股份	156,300	2,996,271.00	0.85
56	000708	中信特钢	187,900	2,976,336.00	0.85
57	601898	中煤能源	343,700	2,900,828.00	0.83
58	603259	药明康德	45,720	2,848,813.20	0.81
59	002555	三七互娱	79,400	2,769,472.00	0.79
60	600025	华能水电	380,500	2,712,965.00	0.77
61	601231	环旭电子	165,800	2,480,368.00	0.71
62	002938	鹏鼎控股	99,000	2,404,710.00	0.69
63	600900	长江电力	103,400	2,281,004.00	0.65
64	000408	藏格矿业	99,100	2,236,687.00	0.64
65	002415	海康威视	66,900	2,215,059.00	0.63
66	601668	中国建筑	375,000	2,152,500.00	0.61
67	601012	隆基绿能	72,108	2,067,336.36	0.59
68	000878	云南铜业	173,100	1,912,755.00	0.54
69	600585	海螺水泥	80,000	1,899,200.00	0.54
70	600362	江西铜业	94,701	1,797,424.98	0.51
71	000333	美的集团	30,000	1,767,600.00	0.50
72	002152	广电运通	150,000	1,758,000.00	0.50
73	002129	TCL 中环	51,875	1,722,250.00	0.49
74	600019	宝钢股份	303,200	1,703,984.00	0.49
75	002384	东山精密	62,600	1,621,340.00	0.46
76	600690	海尔智家	66,900	1,570,812.00	0.45
77	600887	伊利股份	51,100	1,447,152.00	0.41
78	000776	广发证券	95,300	1,401,863.00	0.40

79	300832	新产业	23,700	1,398,300.00	0.40
80	000429	粤高速 A	176,000	1,379,840.00	0.39
81	002372	伟星新材	57,200	1,174,888.00	0.33
82	600958	东方证券	90,000	873,000.00	0.25
83	600845	宝信软件	14,900	757,069.00	0.22
84	000425	徐工机械	106,400	720,328.00	0.21
85	600233	圆通速递	47,400	690,144.00	0.20
86	000932	华菱钢铁	110,900	528,993.00	0.15
87	600926	杭州银行	38,900	457,075.00	0.13
88	601186	中国铁建	42,600	419,610.00	0.12
89	300408	三环集团	13,800	405,030.00	0.12
90	600999	招商证券	24,700	335,179.00	0.10
91	600030	中信证券	16,410	324,589.80	0.09
92	600176	中国巨石	17,907	253,563.12	0.07
93	601816	京沪高铁	46,900	246,694.00	0.07
94	688372	伟测科技	990	151,618.50	0.04
95	000596	古井贡酒	500	123,690.00	0.04
96	688409	富创精密	1,013	110,417.00	0.03
97	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
98	688143	长盈通	2,519	94,966.30	0.03
99	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
100	688480	赛恩斯	2,302	71,269.92	0.02
101	300122	智飞生物	1,050	46,410.00	0.01
102	001286	陕西能源	3,767	37,406.31	0.01
103	688249	晶合集成	1,420	25,659.40	0.01
104	688361	中科飞测	289	22,784.76	0.01
105	688472	阿特斯	1,315	22,670.60	0.01
106	301310	鑫宏业	288	18,840.96	0.01
107	301358	湖南裕能	424	18,172.64	0.01
108	301317	鑫磊股份	694	18,141.16	0.01
109	688469	中芯集成	2,719	14,818.55	0.00
110	301383	天键股份	406	14,502.32	0.00
111	301280	珠城科技	393	14,053.68	0.00
112	301291	明阳电气	437	13,796.09	0.00
113	688543	国科军工	246	13,215.12	0.00
114	688334	西高院	743	12,779.60	0.00
115	301262	海看股份	471	12,231.87	0.00
116	688531	日联科技	87	12,106.92	0.00
117	301210	金杨股份	243	12,079.53	0.00
118	688523	航天环宇	472	12,002.96	0.00
119	301225	恒勃股份	333	11,415.24	0.00
120	001287	中电港	448	11,343.36	0.00
121	301408	华人健康	655	11,102.25	0.00

122	688352	颀中科技	839	10,596.57	0.00
123	301141	中科磁业	246	10,506.66	0.00
124	301307	美利信	321	10,272.00	0.00
125	301387	光大同创	225	10,266.75	0.00
126	301429	森泰股份	466	9,874.54	0.00
127	301363	美好医疗	223	9,809.77	0.00
128	688484	南芯科技	252	9,737.28	0.00
129	301246	宏源药业	317	9,735.07	0.00
130	301355	南王科技	563	9,700.49	0.00
131	301267	华夏眼科	159	9,691.05	0.00
132	688429	时创能源	346	9,646.48	0.00
133	688570	天玛智控	373	9,496.58	0.00
134	688631	莱斯信息	305	9,421.45	0.00
135	301232	飞沃科技	161	9,415.28	0.00
136	688623	二元科技	103	9,198.93	0.00
137	301360	荣旗科技	98	9,095.38	0.00
138	301376	致欧科技	402	9,073.14	0.00
139	301379	天山电子	320	8,937.60	0.00
140	301170	锡南科技	250	8,902.50	0.00
141	301373	凌玮科技	277	8,819.68	0.00
142	301367	怡和嘉业	59	8,752.06	0.00
143	301323	新莱福	208	8,550.88	0.00
144	688552	航天南湖	352	8,511.36	0.00
145	301265	华新环保	727	8,447.74	0.00
146	301332	德尔玛	606	8,326.44	0.00
147	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
148	688581	安杰思	68	8,029.44	0.00
149	301157	华塑科技	150	7,938.00	0.00
150	301322	绿通科技	149	7,926.80	0.00
151	301277	新天地	395	7,706.45	0.00
152	300804	广康生化	226	7,480.60	0.00
153	301389	隆扬电子	400	7,272.00	0.00
154	301281	科源制药	284	7,202.24	0.00
155	301273	瑞晨环保	221	6,930.56	0.00
156	301203	国泰环保	195	6,819.15	0.00
157	301335	天元宠物	274	6,532.16	0.00
158	301365	矩阵股份	387	6,370.02	0.00
159	301356	天振股份	288	6,307.20	0.00
160	301223	中荣股份	321	6,009.12	0.00
161	688512	慧智微	307	5,903.61	0.00
162	603659	璞泰来	150	5,733.00	0.00
163	001380	华纬科技	138	4,257.30	0.00
164	601133	柏诚股份	288	3,951.36	0.00

165	601065	江盐集团	277	3,487.43	0.00
166	001282	三联锻造	99	3,278.88	0.00
167	001360	南矿集团	157	2,582.65	0.00
168	603137	恒尚节能	139	2,536.75	0.00
169	001367	海森药业	54	2,297.70	0.00
170	001324	长青科技	114	2,283.42	0.00
171	603172	万丰股份	122	2,034.96	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	6,767,987.00	2.33
2	601766	中国中车	6,391,744.00	2.20
3	600332	白云山	6,325,800.00	2.17
4	601169	北京银行	6,229,761.00	2.14
5	601390	中国中铁	6,094,953.00	2.09
6	603369	今世缘	6,014,605.00	2.07
7	601100	恒立液压	5,630,532.00	1.94
8	300009	安科生物	5,358,989.00	1.84
9	601328	交通银行	5,298,548.00	1.82
10	603019	中科曙光	5,261,073.00	1.81
11	600741	华域汽车	5,245,083.00	1.80
12	601665	齐鲁银行	5,104,126.00	1.75
13	600061	国投资本	5,096,264.00	1.75
14	300433	蓝思科技	4,983,380.00	1.71
15	688009	中国通号	4,981,389.00	1.71
16	600662	外服控股	4,899,025.00	1.68
17	002032	苏泊尔	4,868,742.00	1.67
18	600007	中国国贸	4,836,826.00	1.66
19	000429	粤高速 A	4,793,314.00	1.65
20	601618	中国中冶	4,790,455.26	1.65

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	601138	工业富联	7,312,394.00	2.51
2	300750	宁德时代	6,994,257.00	2.40
3	300628	亿联网络	5,949,712.00	2.05



4	600741	华域汽车	5,539,460.00	1.90
5	601318	中国平安	5,499,954.90	1.89
6	002714	牧原股份	5,381,964.00	1.85
7	603019	中科曙光	5,061,652.85	1.74
8	688008	澜起科技	5,006,429.40	1.72
9	600519	贵州茅台	4,823,044.00	1.66
10	600559	老白干酒	4,812,977.48	1.65
11	300003	乐普医疗	4,560,960.02	1.57
12	002466	天齐锂业	4,275,677.00	1.47
13	300244	迪安诊断	4,167,988.00	1.43
14	300014	亿纬锂能	3,840,719.00	1.32
15	600025	华能水电	3,774,731.00	1.30
16	000429	粤高速 A	3,734,234.00	1.28
17	600233	圆通速递	3,611,413.00	1.24
18	601618	中国中冶	3,487,375.00	1.20
19	300832	新产业	3,467,228.76	1.19
20	600426	华鲁恒升	3,357,695.00	1.15

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	254,413,944.10
卖出股票收入（成交）总额	202,119,668.23

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	19,199,762.11	5.47
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	19,199,762.11	5.47

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019679	22 国债 14	130,000	13,233,725.75	3.77
2	019688	22 国债 23	59,000	5,966,036.36	1.70
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本基金所持有的招商银行(600036.SH)总行、部分分支机构、高管近一年内被中国银行保险监督管理委员会多次处罚，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

本基金所持有的农业银行(601288.SH)总行、部分分支机构、高管近一年内被中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行多次处罚，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

本基金所持有的北京银行(601169.SH)总行、部分分支机构、高管近一年内被中国银行保险监督管理委员会多次处罚，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

本基金所持有的交通银行(601328.SH)总行、部分分支机构、高管近一年内被中国银行保险监督管理委员会多次处罚，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

以上事项不会对各公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

(1) 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告或者量化投资策略，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、合规法务部、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。

本基金投资上述公司主要基于以下原因：该基金基于基本面进行选股，选择盈利增速较高、基本面向好、估值较低等符合选股标准的股票进行分散投资。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,373.93
2	应收清算款	323,596.15
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,903.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	367,873.20

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
东方核心动力混合 A	2,072	92,572.41	175,990,678.11	91.75	15,819,347.47	8.25
东方核心动力混合 C	60	1,691,611.78	101,426,741.67	99.93	69,965.05	0.07
合计	2,132	137,573.51	277,417,419.78	94.58	15,889,312.52	5.42

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方核心动力混合 A	43,903.08	0.02
	东方核心动力混合 C	9.54	0.00
	合计	43,912.62	0.01

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方核心动力混合 A	0~10
	东方核心动力混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东方核心动力混合 A	0~10
	东方核心动力混合 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方核心动力混合 A	东方核心动力混合 C
基金合同生效日 (2009年6月24日)	771,974,243.03	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	226,037,521.12	21,162,181.60
本报告期基金总申购份额	9,195,225.83	101,660,085.55
减：本报告期基金总赎回份额	43,422,721.37	21,325,560.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	191,810,025.58	101,496,706.72

注：基金总申购份额包含基金转换转入的份额，基金总赎回份额包含基金转换转出的份额。

## § 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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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

本报告期内本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，本基金托管人的托管业务部门及其线管高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华创证券有限责任公司	3	321,283,404.61	71.57	299,210.77	71.65	-
天风证券股份有限公司	2	126,562,061.43	28.19	117,438.60	28.12	-
东北证券股份有限公司	2	1,046,598.32	0.23	964.20	0.23	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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

#### （2）交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：①资质雄厚，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）本基金本报告期未发生交易单元变更。

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 (%)
华创证券有限责任公司	6,091,330.00	67.02	300,000.00	100.00	-	-
天风证券股份有限公司	2,997,150.00	32.98	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	东方核心动力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	东方核心动力混合型证券投资基金恢复 1 万元以上申购、转换转入、定期定额投资业务公告	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 1 月 20 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	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券	2023 年 3 月 2 日

	通定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	
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	关于增加上海长量基金销售有限公司为东方核心动力混合型证券投资基金 C 类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 3 月 22 日
8	东方核心动力混合型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 29 日
9	东方核心动力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
10	关于增加中国工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、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 18 日
11	关于增加招商证券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	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 5 月 30 日
12	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
13	关于增加平安银行股份有限公司行 E 通平台为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、证券日报、中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日
14	关于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
15	关于增加国泰君安证券股份有限公司为东方核心动力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 6 月 9 日



16	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230630	85,083,966.28	-	-	85,083,966.28	29.01
	2	20230308-20230630	46,067,127.34	82,311,301.34	-	128,378,428.68	43.77
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时,可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本,可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时,基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理,可能会影响投资者赎回。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2023 年 8 月 31 日