

东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 东方红中证竞争力指数 |
| 基金主代码 | 007657 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 7 月 31 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 478,799,908.06 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票投资组合。同时为实现对标的指数更好地跟踪，本基金将辅以适当的替代性策略调整组合。本基金力争基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 业绩比较基准 | 中证东方红竞争力指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金是指 |

| | | |
|-----------------|------------------------|-----------------|
| | 数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 上海东方证券资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 东方红中证竞争力指数 A | 东方红中证竞争力指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 007657 | 007658 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 414,373,965.17 份 | 64,425,942.89 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 东方红中证竞争力指数 A | 东方红中证竞争力指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | 3,656,963.94 | 468,694.43 |
| 2. 本期利润 | -17,177,672.00 | -2,738,300.14 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0404 | -0.0422 |
| 4. 期末基金资产净值 | 456,681,058.14 | 69,801,796.36 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1021 | 1.0834 |

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

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

3.2 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

东方红中证竞争力指数 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -3.67% | 0.89% | -4.54% | 0.89% | 0.87% | 0.00% |
| 过去六个月 | -7.44% | 0.84% | -9.32% | 0.85% | 1.88% | -0.01% |
| 过去一年 | -6.63% | 0.93% | -8.59% | 0.93% | 1.96% | 0.00% |
| 过去三年 | -15.93% | 1.08% | -20.52% | 1.09% | 4.59% | -0.01% |

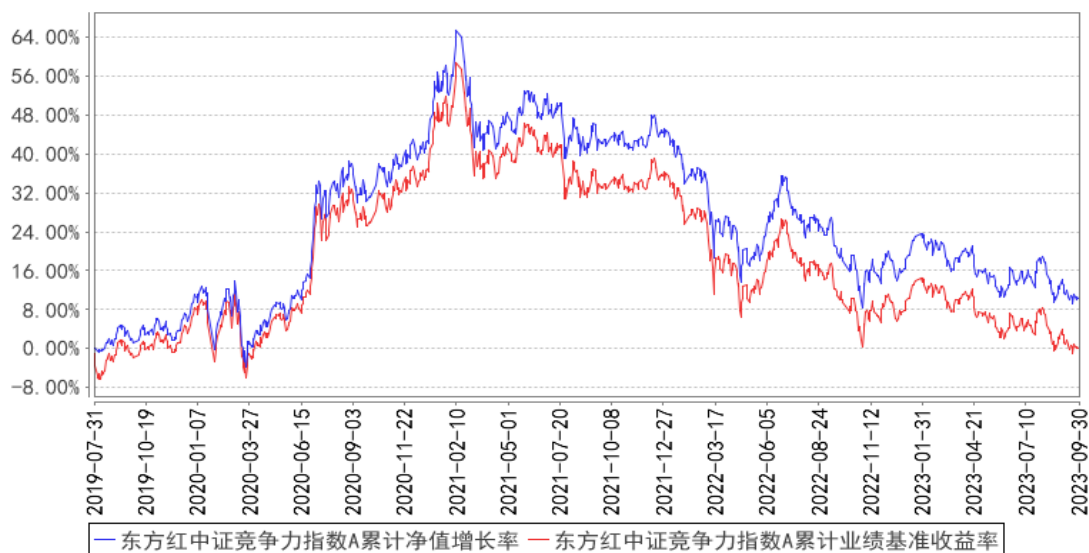
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 10.21% | 1.14% | 0.05% | 1.15% | 10.16% | -0.01% |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|--------|

东方红中证竞争力指数 C

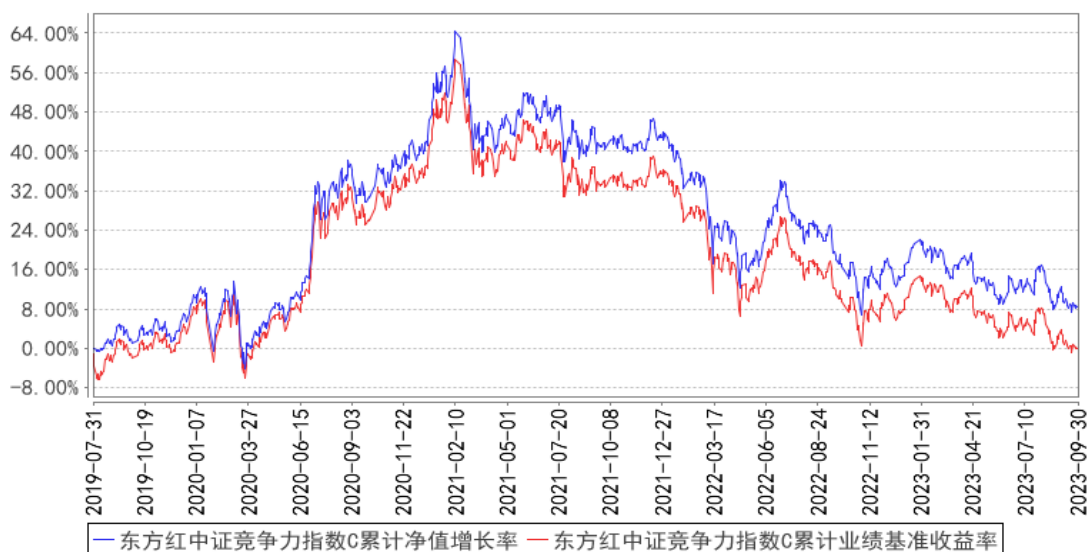
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -3.77% | 0.89% | -4.54% | 0.89% | 0.77% | 0.00% |
| 过去六个月 | -7.63% | 0.84% | -9.32% | 0.85% | 1.69% | -0.01% |
| 过去一年 | -7.00% | 0.93% | -8.59% | 0.93% | 1.59% | 0.00% |
| 过去三年 | -16.94% | 1.08% | -20.52% | 1.09% | 3.58% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.34% | 1.14% | 0.05% | 1.15% | 8.29% | -0.01% |

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

东方红中证竞争力指数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



东方红中证竞争力指数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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐习佳 | 上海东方证券资产管理有限公司公募指数与多策略部副总经理（主持工作）、基金经理 | 2019年7月31日 | - | 23年 | 上海东方证券资产管理有限公司公募指数与多策略部副总经理（主持工作）、基金经理，2019年07月至今任东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金经理、2021年12月至今任东方红中证东方红利低波动指数证券投资基金基金经理。天普大学金融学博士。曾任联合证券投资银行部投行经理，美国 Towers Watson 资深分析师，兴业全球基金金融工程与专题研究部副总监、基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司研究部副总监、量化投资部总经理、投资主办人。具备证券投资基金从业资格。 |
| 戎逸洲 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理 | 2019年11月29日 | - | 8年 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2019年11月至今任东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金经理。福特汉姆大学理学硕士。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化研究员。具备证券投资基金从业资格。 |

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

据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，国内经济受周期影响，相关数据波动较为显著。2023 年 9 月食品、非食品价格环比均处于低位水平，CPI 整体环比、同比数据也均处于低位。从指标读数来看，工业增加值、社会消费品零售总额、制造业投资、价格水平、基建投资等关键宏观指标的当月同比增速均较 7 月出现了边际改善。9 月以来，许多高频数据也在持续出现边际改善，包括 30 个大、中城市商品房销售面积、各类行业开工率、G7 物流指数和电影票房收入在内的许多高频指标均较上个月有所增加。

资金上为满足跨季流动性需求，央行 9 月下旬以来加大净投放，资金面继续依赖于央行大额滚动续作。资金偏紧的背后是资金需求增多：一来初步了解到 9 月信贷情况较好，房贷提前偿还

减少；二是 8 月底信贷座谈会加之专项债投放带动，大行投放的企业中长期贷款较好；第三，政府债券净供给仍多，8 月 1.2 万亿、9 月 1 万亿，往后还有潜在 1.5 万亿再融资债待发，对资金占用较多。目前来看，国庆节前资金面相对较紧，但总体资金面供求基本匹配。

三季度政策面不断发出调整信号，全国楼市限购政策逐步加码放松，经济政策传闻不断、渐次出台，持续发力，股债跷跷板效应随着时间发展有所发酵。

东方红中证竞争力指数基金投资于一篮子高 ROE 公司，其估值目前接近 2018 年以来的低位。2023 年三季度，竞争力指数基金 A 类净值下跌-3.67%，跌幅小于同期沪深 300 指数的-3.98%。截至 9 月 28 日，竞争力指数成分股加权 ROE 约为 16.11%，高于沪深 300 指数约 10.93%、创业板指数约 13.63%的水平。根据指数真实权重计算的 PE 水平约为 12.2 倍，明显低于沪深 300 指数约 13.6 倍的估值。同期根据指数真实权重和 Wind 总市值法公布的中证 500 指数和创业板指数的 PE 水平约 23.0 倍和 29.4 倍。国际上横向比较 ROE 和 PE 水平的匹配，竞争力指数相较日经 225（16.6 倍）和德国 DAX（13.5 倍）在估值上具有优势。而标普 500 指数的 ROE 水平（约 17.21%）略高于竞争力指数，其估值水平虽然较上期略有下降到 23.4 倍，但仍高于竞争力指数。

展望 2023 年四季度，估值低点、业绩低点叠加政策刺激，是目前资本市场所处状态。我们可以预期，在经济压力仍在，资本市场活跃力度不足的环境下，刺激政策不会停止，这将有利于进一步提振市场风险偏好。站在目前位置，有利因素正在不断集聚。内部环境上看，在政策持续刺激之下，国内经济有望逐步复苏；外部环境上，中美成立经济和金融领域工作组等也有助于进出口边际改善，所以对于四季度的市场不宜悲观。市场春秋的风格指针转动可能步入质量因子的上升区域。自去年四季度以来，由于溢价水平受到市场资金面和经济潜在增速的双重限制，市场风格更多偏好红利和估值类因子。质量因子的表现相对中庸。我们持续跟踪的竞争力指数成分股组合在持有期盈利能力上相对于沪深 300 指数组合的优势目前已经第四个季度超过了通常所处的 3%~4%区间的上沿，而其估值继续略低于沪深 300 指数。事实上，从股价走势看，竞争力指数相对沪深 300 指数的相对强弱在三季度已经有所改变。密切关注这种改变是否能够延续扩大，从而确认拐点的出现。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.1021 元，份额累计净值为 1.1021 元；C 类份额净值为 1.0834 元，份额累计净值为 1.0834 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-3.67%，同期业绩比较基准收益率为-4.54%；C 类份额净值增长率为-3.77%，同期业绩比较基准收益率为-4.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 495,596,930.47 | 94.00 |
| | 其中：股票 | 495,596,930.47 | 94.00 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 31,010,086.37 | 5.88 |
| 8 | 其他资产 | 643,183.70 | 0.12 |
| 9 | 合计 | 527,250,200.54 | 100.00 |

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 4,842,342.00 | 0.92 |
| B | 采矿业 | 11,298,135.00 | 2.15 |
| C | 制造业 | 294,582,153.88 | 55.95 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 15,148,876.00 | 2.88 |
| E | 建筑业 | 11,014,350.00 | 2.09 |
| F | 批发和零售业 | 1,607,905.00 | 0.31 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 15,400,783.00 | 2.93 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 23,495,099.37 | 4.46 |
| J | 金融业 | 101,611,880.62 | 19.30 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业 | 8,126,566.00 | 1.54 |
| 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 | 7,698,509.73 | 1.46 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 494,826,600.60 | 93.99 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 524,329.33 | 0.10 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 7,992.38 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 96,747.58 | 0.02 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 107,767.71 | 0.02 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 12,307.41 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 21,185.46 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 770,329.87 | 0.15 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 11,906 | 21,413,536.30 | 4.07 |
| 2 | 600809 | 山西汾酒 | 86,438 | 20,701,901.00 | 3.93 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 386,300 | 18,658,290.00 | 3.54 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 495,200 | 14,766,864.00 | 2.80 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 331,900 | 12,047,970.00 | 2.29 |
| 6 | 002142 | 宁波银行 | 434,229 | 11,667,733.23 | 2.22 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 347,200 | 11,447,184.00 | 2.17 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 701,600 | 11,429,064.00 | 2.17 |
| 9 | 600436 | 片仔癀 | 34,800 | 9,577,308.00 | 1.82 |
| 10 | 300308 | 中际旭创 | 77,300 | 8,951,340.00 | 1.70 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 301559 | 中集环科 | 3,943 | 95,499.46 | 0.02 |
| 2 | 301520 | 万邦医药 | 1,244 | 92,568.63 | 0.02 |
| 3 | 688719 | 爱科赛博 | 1,260 | 82,337.22 | 0.02 |
| 4 | 688657 | 浩辰软件 | 794 | 82,099.60 | 0.02 |
| 5 | 688361 | 中科飞测 | 366 | 27,885.54 | 0.01 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量 (买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动 (元) | 风险说明 |
|--------------------|--------|-----------|--------------|------------|-------------|
| IF2312 | IF2312 | 4 | 4,465,920.00 | -97,680.00 | - |
| 公允价值变动总额合计 (元) | | | | | -97,680.00 |
| 股指期货投资本期收益 (元) | | | | | -73,301.01 |
| 股指期货投资本期公允价值变动 (元) | | | | | -151,980.00 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并通过对证券市场和期货市场运行趋势的研判，结合对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，以对冲系统性风险和流动性风险。本基金还将利用股指期货，降低股票仓位频繁调整的交易成本，达到有效跟踪标的指数的目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券发行主体中，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局宁波市分局的处罚，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到宁波银保监局的处罚。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

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

5.11.2 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未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 606,321.16 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 36,862.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 643,183.70 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 301559 | 中集环科 | 95,499.46 | 0.02 | 新股未上市 |
| 2 | 688657 | 浩辰软件 | 73,827.60 | 0.01 | 新股未上市 |
| 2 | 688657 | 浩辰软件 | 8,272.00 | 0.00 | 新股锁定 |
| 3 | 688361 | 中科飞测 | 27,885.54 | 0.01 | 新股锁定 |
| 4 | 301520 | 万邦医药 | 8,621.25 | 0.00 | 新股锁定 |
| 5 | 688719 | 爱科赛博 | 7,980.84 | 0.00 | 新股锁定 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东方红中证竞争力指数 A | 东方红中证竞争力指数 C |
|-------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 436,741,066.79 | 65,310,946.57 |

| | | |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,157,895.61 | 649,804.11 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 26,524,997.23 | 1,534,807.79 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 414,373,965.17 | 64,425,942.89 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| 项目 | 东方红中证竞争力指数 A | 东方红中证竞争力指数 C |
|--------------------------|---------------|--------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 19,777,178.64 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 10,005,850.58 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 9,771,328.06 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 2.36 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率(%) |
|----|------|------------|----------------|----------------|---------|
| 1 | 赎回 | 2023-08-09 | -10,005,850.58 | -11,751,871.51 | 0.0000 |
| 合计 | | | -10,005,850.58 | -11,751,871.51 | |

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|--------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 9,771,328.06 | 2.04 | 10,005,850.58 | 2.09 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 9,771,328.06 | 2.04 | 10,005,850.58 | 2.09 | 3年 |

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

10.3 查阅方式

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

上海东方证券资产管理有限公司

2023 年 10 月 25 日