

东方互联网嘉混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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

报告送出日期：二〇二一年十月二十六日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方互联网嘉混合
基金主代码	002174
交易代码	002174
前端交易代码	002174
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 6 日
报告期末基金份额总额	146,992,516.94 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金从国际化视野审视中国经济和资本市场，全面分析影响股票市场和债券市场走势的各种因素，深入地评估股票市场和债券市场的运行趋势。根据影响证券市场运行的各种因素的变化趋势，及时调整大类资产的配置比例，控制系统性风险。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债总全价指数收益率
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。
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

§ 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（2021年7月1日—2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	6,130,500.21
2. 本期利润	-3,145,857.44
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0217
4. 期末基金资产净值	168,977,693.09
5. 期末基金份额净值	1.1496

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

②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。

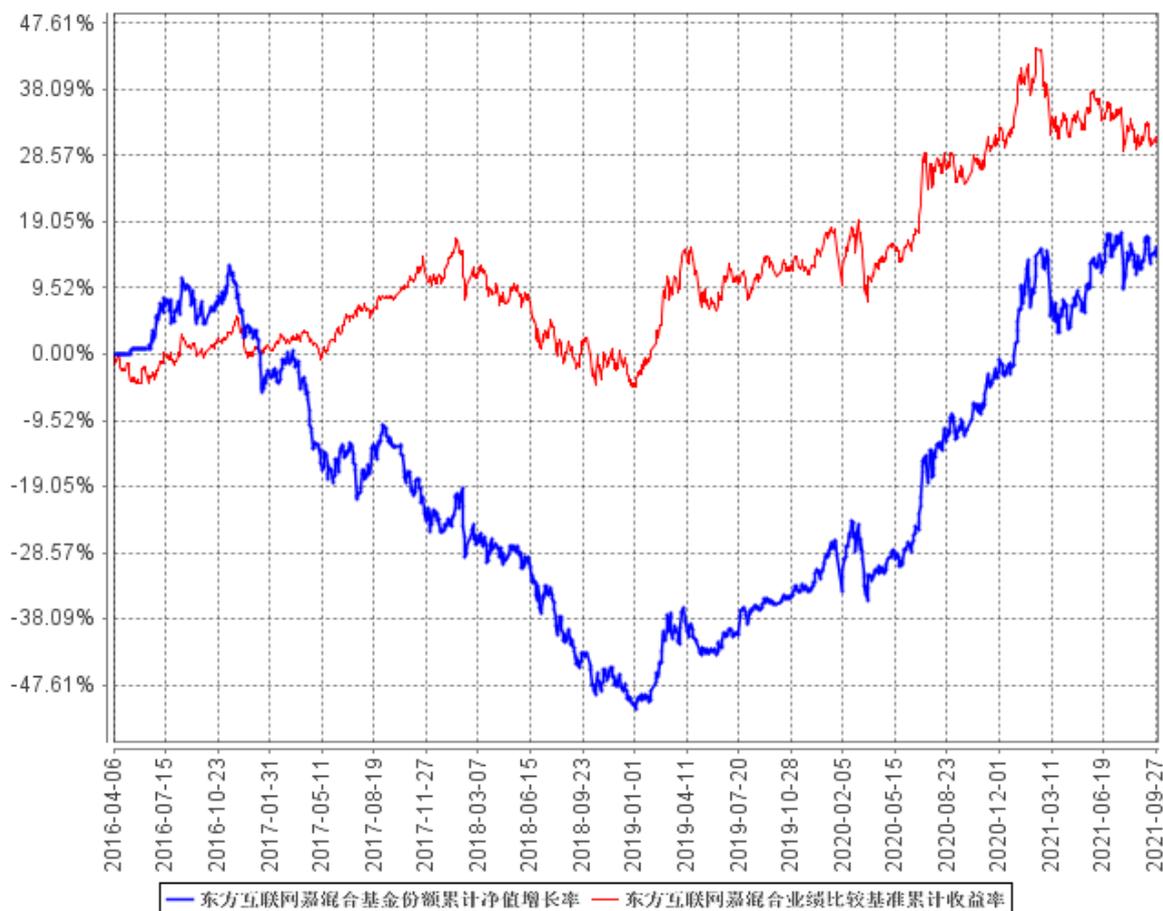
3.2 基金净值表现

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	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	-1.97%	1.06%	-3.58%	0.72%	1.61%	0.34%
过去六个月	8.98%	0.99%	-1.33%	0.66%	10.31%	0.33%
过去一年	28.94%	1.08%	5.10%	0.73%	23.84%	0.35%
过去三年	101.79%	1.20%	27.95%	0.80%	73.84%	0.40%
过去五年	9.68%	1.16%	30.93%	0.71%	-21.25%	0.45%
自基金合同 生效起至今	14.96%	1.13%	31.11%	0.70%	-16.15%	0.43%

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

东方互联网嘉混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（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		
周思越（先生）	本基金基金经理	2020年8月28日	-	12年	新加坡国立大学经济专业硕士，12年证券从业经历。曾任长盛基金管理有限公司专户理财部理财经理、东方基金研究部研究员、中信证券股份有限公司资产管理部副

					<p>总裁（VP）。2017 年 9 月加盟本基金管理人，曾任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理助理，现任东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------

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。

4.1.1 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

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方互联网嘉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作基金资产，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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A 股市场的波动明显加大，主流指数均以下跌报收，特别是前期涨幅显著的科创板出现大幅调整。行业方面，煤炭钢铁有色等传统周期行业表现优异，医药消费科技等热点板块跌幅居前，金融地产相对抗跌。报告期内，本基金维持二季度末的九成仓位，并以沪深 300 行业权重为基础均衡配置，获取了一定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日，本基金净值增长率为-1.97%，业绩比较基准收益率为-3.58%，高于业绩比较基准 1.61%。

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 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	156,132,532.67	92.16
	其中：股票	156,132,532.67	92.16
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	13,181,718.79	7.78
8	其他资产	92,698.08	0.05
9	合计	169,406,949.54	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,750,089.03	1.04
B	采矿业	4,946,977.00	2.93
C	制造业	81,624,978.71	48.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,355,038.22	5.54
E	建筑业	2,383,933.30	1.41
F	批发和零售业	718,662.11	0.43
G	交通运输、仓储和邮政业	3,988,524.40	2.36
H	住宿和餐饮业	300,206.40	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,741,267.64	3.40
J	金融业	34,062,500.40	20.16
K	房地产业	3,233,893.00	1.91
L	租赁和商务服务业	2,489,544.00	1.47
M	科学研究和技术服务业	2,939,626.14	1.74
N	水利、环境和公共设施管理业	45,768.10	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	113,820.00	0.07

Q	卫生和社会工作	1,820,422.60	1.08
R	文化、体育和娱乐业	617,281.62	0.37
S	综合	-	-
	合计	156,132,532.67	92.40

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	4,400	8,052,000.00	4.77
2	600905	三峡能源	907,763	6,299,875.22	3.73
3	600036	招商银行	88,500	4,464,825.00	2.64
4	601318	中国平安	73,500	3,554,460.00	2.10
5	000858	五粮液	14,100	3,093,399.00	1.83
6	000333	美的集团	37,300	2,596,080.00	1.54
7	601012	隆基股份	30,980	2,555,230.40	1.51
8	300059	东方财富	66,920	2,300,040.40	1.36
9	603259	药明康德	12,300	1,879,440.00	1.11
10	601166	兴业银行	101,200	1,851,960.00	1.10

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 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。

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受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有的药明康德(603259)公司股东上海瀛翊投资中心(有限合伙)于2021-06-17被中国证券监督管理委员会立案调查。主要违法事实：2021年5月14日至6月7日，公司股东上海瀛翊通过上海证券交易所集中竞价交易系统减持公司16107986股(2020年度权益分派前)A股股份，2021年6月8日上海瀛翊通过上海证券交易所集中竞价交易系统减持公司1141700股(2020年度权益分派后)A股股份。上海瀛翊在实施本次减持之前未能遵守其作为委托投票方作出的有关减持公司股份的相关承诺，未提前通知公司，也没有提前15个交易日通过公司披露减持计划履行公告等相关程序。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的贵州茅台(600519)公司因未依法履行其他职责受到上海证券交易所的监管关注。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。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的招商银行(600036)公司因业务违规受到中国人民银行、各地银保监会的行政处罚。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。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的兴业银行(601166)公司因业务违规受到各地银保监会的行政处罚。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。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

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

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

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

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

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

本基金投资药明康德主要基于以下原因：公司是全球领先的制药以及医疗器械研发开放式能力和技术平台企业。公司向全球制药公司、生物技术公司以及医疗器械公司提供一系列全方位的实验室研发、研究生产服务，服务范围贯穿从小分子药物发现到推向市场的全过程，以及细胞治疗和基因治疗从产品开发到商业化生产服务、医疗器械测试服务等。

本基金投资贵州茅台主要基于以下原因：作为白酒行业的龙头，公司茅台酒与系列酒双轮驱动的策略明确，直销渠道的扩张有望提升产品吨价，公司产品量价有进一步提升的空间。虽然行业短期存在扰动，但从长期发展趋势来看，高端白酒行业整体扩容趋势不变，行业马太效应明显，公司有上行空间。

本基金投资招商银行主要基于以下原因：公司是国内领先的零售银行，通过多年来零售战略的执行，公司的零售客户不仅存在规模优势，而且客户质量优质，客户结构中私行客户占比高，客户潜在价值空间大。公司在零售领域建立了强大的护城河，创新能力行业领先，业务结构稳健，业绩稳定，资产质量好于行业竞争对手。

本基金投资兴业银行主要基于以下原因：公司是运营稳健的商业银行，估值便宜，资产质量扎实，具备很好的防御属性。

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本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	86,341.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,469.74
5	应收申购款	3,886.79
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	92,698.08

5.11.4 报告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

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	600905	三峡能源	6,299,875.22	3.73	新股锁定限售

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	141,802,366.09
报告期期间基金总申购份额	11,887,556.57
减：报告期期间基金总赎回份额	6,697,405.72
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	146,992,516.94

§ 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

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品	1	20210701 - 20210930	38,499,826.62	-	-	38,499,826.62	26.19%
产品特有风险							
基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。 (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。 (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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

截止 2021 年 9 月 30 日,本基金持有科创板流通受限股票。其中利元亨(688499),公允价值占基金资产净值比例为 0.17%; 复旦微电(688385),公允价值占基金资产净值比例为 0.15%; 凯立新材(688269),公允价值占基金资产净值比例为 0.11%; 壹石通(688733),公允价值占

基金资产净值比例为 0.10%；东威科技（688700），公允价值占基金资产净值比例为 0.09%；博众精工（688097），公允价值占基金资产净值比例为 0.09%；诺禾致源（688315），公允价值占基金资产净值比例为 0.09%；时代电气（688187），公允价值占基金资产净值比例为 0.08%；智明达（688636），公允价值占基金资产净值比例为 0.07%；瑞可达（688800），公允价值占基金资产净值比例为 0.07%；新风光（688663），公允价值占基金资产净值比例为 0.06%；正元地信（688509），公允价值占基金资产净值比例为 0.05%；圣诺生物（688117），公允价值占基金资产净值比例为 0.03%。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

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

东方基金管理股份有限公司

2021 年 10 月 26 日