

东方人工智能主题混合型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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 2024 年 7 月 18 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|--------------------|
| 基金简称 | 东方人工智能主题混合 | |
| 基金主代码 | 005844 | |
| 前端交易代码 | 005844 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 6 月 7 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 3,256,742,473.66 份 | |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，通过深入研究人工智能主题相关行业，挖掘具备成长潜力的上市公司，结合积极主动的资产配置，力争获得基金的长期稳定增值。 | |
| 投资策略 | 本基金根据各类资产的市场趋势和收益风险水平进行分析，对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整，采用多因素分析框架，综合考虑宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等进行基金的大类资产配置。 | |
| 业绩比较基准 | 中证人工智能主题指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 东方人工智能主题混合 A | 东方人工智能主题混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005844 | 017811 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 620,789,009.60 份 | 2,635,953,464.06 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
| | 东方人工智能主题混合 A | 东方人工智能主题混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -21,642,908.04 | -102,199,607.10 |
| 2. 本期利润 | -54,386,219.44 | -203,230,499.97 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0856 | -0.0676 |
| 4. 期末基金资产净值 | 500,747,004.96 | 2,116,088,337.41 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8066 | 0.8028 |

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

东方人工智能主题混合 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 | -9.80% | 2.17% | -2.68% | 1.41% | -7.12% | 0.76% |
| 过去六个月 | -18.34% | 2.54% | -3.71% | 1.77% | -14.63% | 0.77% |
| 过去一年 | -29.21% | 2.28% | -17.23% | 1.57% | -11.98% | 0.71% |
| 过去三年 | -43.46% | 2.34% | -24.63% | 1.48% | -18.83% | 0.86% |
| 过去五年 | -12.93% | 2.06% | 3.02% | 1.51% | -15.95% | 0.55% |
| 自基金合同生效起至今 | -19.34% | 1.95% | -2.61% | 1.56% | -16.73% | 0.39% |

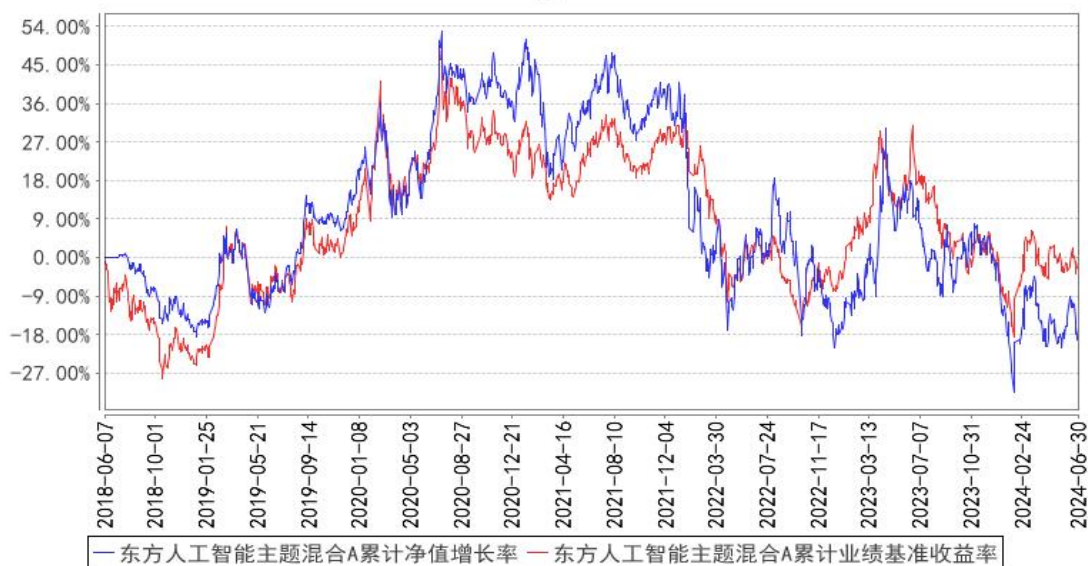
东方人工智能主题混合 C

| 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

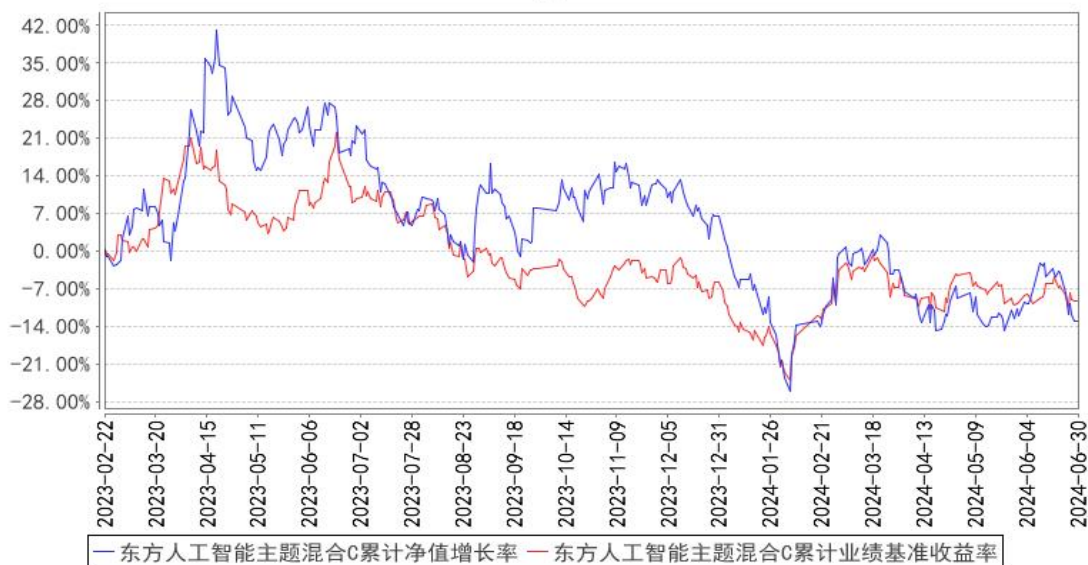
| | | | | ④ | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三个月 | -9.88% | 2.17% | -2.68% | 1.41% | -7.20% | 0.76% |
| 过去六个月 | -18.51% | 2.54% | -3.71% | 1.77% | -14.80% | 0.77% |
| 过去一年 | -29.49% | 2.28% | -17.23% | 1.57% | -12.26% | 0.71% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.15% | 2.41% | -9.16% | 1.64% | -3.99% | 0.77% |

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

东方人工智能主题混合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



东方人工智能主题混合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 | | |
| 严凯 | 本基金基金经理 | 2020 年 4 月 30 日 | - | 13 年 | 北京大学微电子学与固体电子学专业硕士，13 年证券从业经历。曾任中航证券有限公司行业与策略研究员、国都证券有限公司行业与策略研究员。2015 年 8 月加盟本基金管理人，曾任权益研究部研究员，东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理助理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理，现任东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技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。

4.1.1 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》、《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、《东方人工智能主题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的内向交易价差、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 报告期内基金的投资策略和运作分析

经济高质量发展的推动下，我国各行各业积极转变为更合理、高效、可持续的发展模式，而人工智能则成为这一进程中的重要推动力。人工智能为产业的数字化转型创造了必要条件，推动数字经济的发展。随着以 5G、大数据、人工智能为代表的新一代信息技术的蓬勃发展，数字经济已逐渐成为我国产业结构中的重要组成部分。

作为现代高端制造的基石，半导体芯片为人工智能、大数据及云计算等领域提供了底层硬件支持。随着人工智能应用场景的落地，对硬件的需求也将呈现爆发式增长。人工智能产业链主要分为数据、算法、算力及场景应用等环节，而要解决算力问题，则必须加快半导体产业的建设。中国大陆是全球最大的半导体销售市场，吸引着全球半导体产业向大陆迁移。面对国内外新形势，新型举国体制成为我们实现技术突破的重要方式。政府在产业政策、税收、人才培养等方面大力支持，推进本土半导体制造的规模化和高端化。近年来，考虑到供应链安全和自主可控的重要性和紧迫性，半导体晶圆制造及其配套国产半导体设备、材料及零组件厂商等作为半导体产业的基石，加速发展势在必行。

尽管市场波动时有所涟漪，但我们始终追求长期的投资价值。在科技自立自强的时代，国内半导体产业链的自主可控进程将加速推进，特别是在设备领域。这为我们带来了更多的投资机遇。我们优选空间大、技术壁垒高、竞争力强、国家产业政策强力支持的行业与公司。

本报告期内，本基金保持高仓位运作，主要持有的人工智能产业链中短板明显和政策支持力度大的环节，例如半导体设备、半导体材料及零组件。本基金主要持仓结构未发生重大变化。

综上所述，半导体产业的发展是推动数字经济发展的重要支撑。我们将继续关注半导体产业的发展趋势，积极寻找投资机遇，以期获得更好的长期回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-9.80%，业绩比较基准收益率为-2.68%，低于业绩比较基准 7.12%；本基金 C 类净值增长率为-9.88%，业绩比较基准收益率为-2.68%，低于业绩比较基准 7.20%。

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 | 2,478,031,388.65 | 89.86 |
| | 其中：股票 | 2,478,031,388.65 | 89.86 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 188,535,064.74 | 6.84 |
| | 其中：债券 | 188,535,064.74 | 6.84 |
| | 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 | 61,070,191.19 | 2.21 |
| 8 | 其他资产 | 30,034,284.57 | 1.09 |
| 9 | 合计 | 2,757,670,929.15 | 100.00 |

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 | 2,404,492,410.90 | 91.89 |
| 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 | - | - |
| 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 | 500,825.00 | 0.02 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 73,038,152.75 | 2.79 |
| 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 | 2,478,031,388.65 | 94.70 |

5.2.2 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。

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 | 002371 | 北方华创 | 752,079 | 240,582,551.31 | 9.19 |
| 2 | 688012 | 中微公司 | 1,659,733 | 234,453,883.58 | 8.96 |
| 3 | 688082 | 盛美上海 | 2,752,372 | 232,602,957.72 | 8.89 |
| 4 | 688120 | 华海清科 | 1,223,232 | 231,900,322.56 | 8.86 |
| 5 | 688596 | 正帆科技 | 6,974,787 | 230,167,971.00 | 8.80 |
| 6 | 688037 | 芯源微 | 2,554,167 | 227,320,863.00 | 8.69 |
| 7 | 688072 | 拓荆科技 | 1,891,164 | 227,147,708.04 | 8.68 |
| 8 | 300567 | 精测电子 | 4,016,169 | 226,953,710.19 | 8.67 |
| 9 | 688361 | 中科飞测 | 4,760,197 | 225,157,318.10 | 8.60 |
| 10 | 688409 | 富创精密 | 3,860,476 | 142,605,983.44 | 5.45 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 188,535,064.74 | 7.20 |
| 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 | 188,535,064.74 | 7.20 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019709 | 23 国债 16 | 571,000 | 57,991,620.41 | 2.22 |
| 2 | 019733 | 24 国债 02 | 494,000 | 49,930,095.83 | 1.91 |
| 3 | 019727 | 23 国债 24 | 480,000 | 48,873,139.73 | 1.87 |
| 4 | 019740 | 24 国债 09 | 165,000 | 16,556,407.40 | 0.63 |
| 5 | 019698 | 23 国债 05 | 150,000 | 15,183,801.37 | 0.58 |

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

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

本基金所持仓富创精密（688409.SH）于 2024 年 6 月 17 日收到监管工作函。

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。

本基金投资富创精密主要基于以下原因：公司是国家高新技术企业、国家级专精特新“小巨人”企业、国家高新区瞪羚企业、国家“02 重大专项”及国家智能制造新模式应用项目承担单位、集成电路装备零部件精密制造技术国家地方联合工程研究中心依托单位。看好公司长期投资价值。

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。

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 | 634,167.88 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,638,074.15 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 26,762,042.54 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 30,034,284.57 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东方人工智能主题混合 A | 东方人工智能主题混合 C |
|---------------------------|----------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 639,559,223.37 | 2,635,358,089.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 229,014,292.31 | 2,817,853,550.58 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 247,784,506.08 | 2,817,258,175.53 |
| 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 | 620,789,009.60 | 2,635,953,464.06 |

§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

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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 一、《东方人工智能主题混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方人工智能主题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

2024 年 7 月 19 日