

# 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证 券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司的董事会、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。本半年度报告由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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。

上海东方证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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 2016 年 01 月 01 日起至 06 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>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 11        |
| 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 13        |
| 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>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 13        |
| 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 托管人对本半年度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.....                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 16        |
| 6.4 报表附注.....                                | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 38        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 39        |
| 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.....       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 42        |
| 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.....      | 42        |
| 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.....   | 42        |
| 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.....   | 42        |
| 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.....      | 42        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 43        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 43        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 43        |

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....              | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 44        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 45        |
| 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的情况..... | 45        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....               | 45        |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b> .....              | <b>46</b> |
| <b>§10 重大事件揭示</b> .....                | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 46        |
| 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.....  | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 47        |
| 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.....     | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 47        |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 48        |
| <b>§11 备查文件目录</b> .....                | <b>49</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                       | 49        |
| 11.2 存放地点.....                         | 49        |
| 11.3 查阅方式.....                         | 49        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                         |                  |
|-----------------|-------------------------|------------------|
| 基金名称            | 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 |                  |
| 基金简称            | 东方红策略精选混合               |                  |
| 基金主代码           | 001405                  |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式、发起式              |                  |
| 基金合同生效日         | 2015 年 6 月 5 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           | 中国建设银行股份有限公司            |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 111,832,843.39 份        |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                     |                  |
| 下属分级基金的基金简称:    | 东方红策略精选混合 A             | 东方红策略精选混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码:    | 001405                  | 001406           |
| 下属分级基金的前端交易代码   | 001405                  | 001406           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,730,642.99 份         | 100,102,200.40 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。                            |
| 投资策略   | 本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略，在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略实现基金资产的稳定增值。           |
| 业绩比较基准 | 同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。                                      |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 |

### 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      | 上海东方证券资产管理有限公司        | 中国建设银行股份有限公司      |
| 信息披露负责人 | 姓名                    | 唐涵颖               |
|         | 联系电话                  | 021-63325888      |
|         | 电子邮箱                  | service@dfham.com |
| 客户服务电话  | 4009200808            | 010-67595096      |
| 传真      | 021-63326981          | 010-66275853      |
| 注册地址    | 上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层 | 北京市西城区金融大街 25 号   |
| 办公地址    | 上海市黄浦区中山南路 318        | 北京市西城区闹市口大街 1 号   |

|       |             |        |
|-------|-------------|--------|
|       | 号 2 号楼 31 层 | 院 1 号楼 |
| 邮政编码  | 200010      | 100033 |
| 法定代表人 | 陈光明（授权代表）   | 王洪章    |

## 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，证券时报   |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.dfham.com  |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层<br>中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址               |
|--------|----------------|--------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 中国北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## § 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

| 基金级别          | 东方红策略精选混合 A                           | 东方红策略精选混合 C                           |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 1,166,575.07                          | 9,164,190.62                          |
| 本期利润          | 211,877.00                            | -7,232,936.74                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0038                                | -0.0054                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.37%                                 | -0.54%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.54%                                 | 1.01%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末可供分配利润      | -76,583.54                            | -5,233,425.63                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0065                               | -0.0523                               |
| 期末基金资产净值      | 12,333,239.08                         | 100,504,694.72                        |
| 期末基金份额净值      | 1.051                                 | 1.004                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 基金份额累计净值增长率   | 5.10%                                 | 0.40%                                 |

注：1、上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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日；“本期”指 2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日。

### 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

东方红策略精选混合 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      | 0.96%    | 0.17%       | 0.33%      | 0.01%         | 0.63% | 0.16% |
| 过去三个月      | 1.64%    | 0.18%       | 1.02%      | 0.01%         | 0.62% | 0.17% |
| 过去六个月      | 2.54%    | 0.14%       | 2.07%      | 0.01%         | 0.47% | 0.13% |
| 过去一年       | 4.89%    | 0.22%       | 4.36%      | 0.01%         | 0.53% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.10%    | 0.23%       | 4.73%      | 0.01%         | 0.37% | 0.22% |

东方红策略精选混合 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      | 1.01%    | 0.16%       | 0.33%      | 0.01%         | 0.68%  | 0.15% |
| 过去三个月      | 0.30%    | 0.16%       | 1.02%      | 0.01%         | -0.72% | 0.15% |
| 过去六个月      | 1.01%    | 0.13%       | 2.07%      | 0.01%         | -1.06% | 0.12% |
| 过去一年       | 0.20%    | 0.20%       | 4.36%      | 0.01%         | -4.16% | 0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.40%    | 0.21%       | 4.73%      | 0.01%         | -4.33% | 0.20% |

注：1、自基金合同生效日起至今指 2015 年 6 月 5 日-2016 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同有关规定，本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，封闭期内 t 日收益率（ $benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 100\% * [ (\text{三年期银行定期存款税后收益率} + 1.5\%) / 365 ]$$

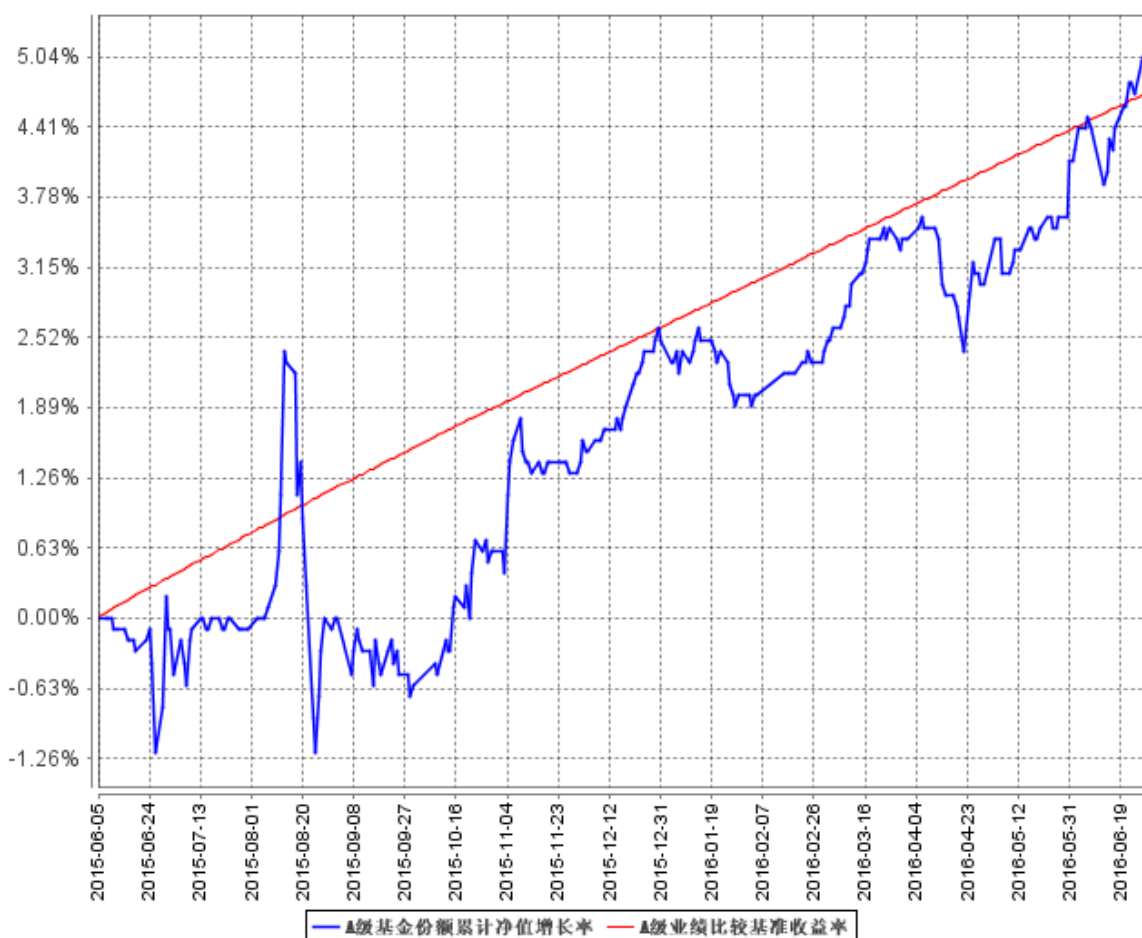
其中,  $t=1, 2, 3, \dots, T$ ,  $T$  表示时间截至日;

$t$  日至  $T$  日的期间收益率 (  $\text{benchmark}_T^t$  ) 按下列公式计算:

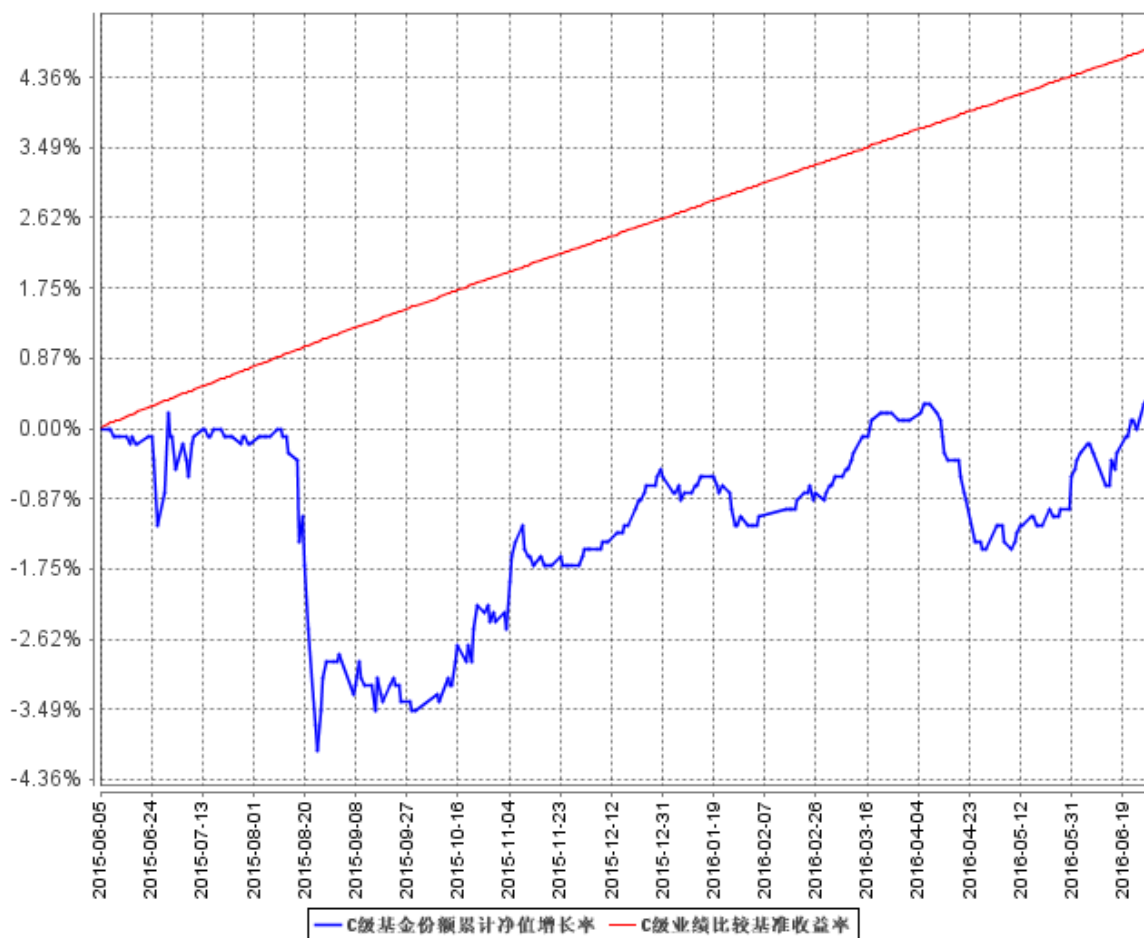
$$\text{benchmark}_T^t = [ \prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t) ] - 1$$

其中,  $T=2, 3, 4, \dots$ ;  $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。

### 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







注：（1）截止日期为 2016 年 6 月 30 日。

（2）本基金建仓期 6 个月，即从 2015 年 6 月 5 日起至 2015 年 12 月 4 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 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

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资

资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金二十只证券投资基金。

#### 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 |        |  |
| 刚登峰 | 本基金基金经理，兼东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015年6月5日       | -    | 7年     | 硕士，曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资经理助理，资深研究员、投资主办人；现任东方红睿丰混合、东方红睿阳混合、东方红睿元混合、东方红策略精选混合、东方红优势精选混合、东方红睿轩沪港深混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 纪文静 | 本基金基金经理，兼任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总监、东方红领先精选混合型证   | 2015年7月14日      | -    | 9年     | 硕士，曾任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员、德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理、上海东方证券资产管理有限公司固定收益部副总监；2014年10月  |

|  |   |  |  |   |
|--|---|--|--|---|
|  | 券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。 |  |  | 加入上海东方证券资产管理有限公司，现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总监兼任东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红策略精选混合、东方红纯债债券、东方红信用债债券、东方红收益增强债券、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红稳添利纯债基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
|--|---|--|--|---|

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

（3）基金管理人于 2016 年 8 月 5 日公告，刚登峰先生于 2016 年 8 月 5 日离任本基金的基金经理。

## 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 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

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 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

2016 年上半年，权益市场出现了较大幅度的下跌，尤其以 1 月的下跌最为惨烈。上证综指下跌 17.22%，深证成指下跌 17.17%，沪深 300 下跌 15.47%，创业板下跌 17.92%，中小板下跌 17.88%。2016 年上半年债券市场也在经历了一季度的下行后市场出现了较大分歧，并最终在 4 月出现了较大幅度的回调，但在基本面数据回落，市场对利率长周期处于下行通道的一致预期下，最终于 5 月开始逐步修复前期调整，债券收益率回落，中债总财富指数上涨 1.35%。

本产品上半年积极参与股票和转债一级市场，以获取无风险收益为主；同时在债券配置上更为重视，适时调仓，控制久期和杠杆，获取了稳定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.051 元，份额累计净值为 1.051 元，C 类份额净值为 1.004 元，份额累计净值为 1.004 元。报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 2.54%，同期业绩比较基准收益率为 2.07%，C 类份额净值增长率为 1.01%，同期业绩比较基准收益率为 2.07%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年上半年制造业投资仍然低迷；基建投资略有回升，起到托底作用；而房地产投资复苏明显，是推动此轮经济企稳的最主要动力。但地产销售拐点已现，地产投资存在一定的滞后性，因此下半年短期经济仍然保持稳定，但后期下滑风险已在临近。此外，“供给侧”改革仍然是主基调，产能出清仍将延续，政府仍更偏重于积极财政政策，货币政策则相对稳健、适度宽松。

从债券市场来看，中国经济长长周期进入下行通道，利率长期也将下行，债券市场仍然有机会。但随着信用风险的加速暴露，信用利差分化较大，因此在信用债操作上，个券选择尤其重要。

从权益市场来看，短期内经济稳定、通胀回落、美联储加息风险缓解，都使得股票具备反弹的环境。此外，债券等固定收益资产收益率的下行以及信用风险的频发，也倒逼资金向高波动性

的权益市场寻求超额收益。因此，高分红、业绩稳定、估值合理的个股仍然受青睐。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。同时，公司设估值决策小组，成员包括：公司总经理、公司联席总经理、合规总监(督察长)、交易总监、运营总监、市场总监、投资经理、基金会计主管。基金经理不参与基金日常估值业务，对于属于东证资管估值政策范围内的特殊估值变更可参与讨论，但最终决策由估值决策小组讨论决策并联名审批。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议，由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 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

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

## 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

# § 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：东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2016年6月30日         | 上年度末<br>2015年12月31日         |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                           |                             |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 604,776.79                | 9,517,674.04                |
| 结算备付金           |            | 3,026,001.67              | 3,663,854.84                |
| 存出保证金           |            | 91,966.35                 | 146,414.52                  |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 75,955,368.17             | 2,131,491,554.37            |
| 其中：股票投资         |            | 14,277,981.07             | 101,805,171.87              |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | 61,677,387.10             | 2,029,686,382.50            |
| 资产支持证券投资        |            | -                         | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 30,000,000.00             | 550,000,895.00              |
| 应收证券清算款         |            | 2,539,545.41              | 61,797,816.00               |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 1,247,431.78              | 25,198,538.20               |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 113,465,090.17            | 2,781,816,746.97            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2015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     |          | -              | 52,239,000.00    |
| 应付证券清算款       |          | -              | -                |
| 应付赎回款         |          | -              | -                |
| 应付管理人报酬       |          | 73,537.93      | 1,840,530.73     |
| 应付托管费         |          | 9,192.25       | 230,066.34       |
| 应付销售服务费       |          | 40,938.57      | 1,115,199.04     |
| 应付交易费用        | 6.4.7.7  | 314,200.28     | 250,785.78       |
| 应交税费          |          | -              | -                |
| 应付利息          |          | -              | -                |
| 应付利润          |          | -              | -                |
| 递延所得税负债       |          | -              | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 189,287.34     | 160,000.00       |
| 负债合计          |          | 627,156.37     | 55,835,581.89    |
| <b>所有者权益:</b> |          |                |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 111,832,843.39 | 2,739,005,317.80 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 1,005,090.41   | -13,024,152.72   |
| 所有者权益合计       |          | 112,837,933.80 | 2,725,981,165.08 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 113,465,090.17 | 2,781,816,746.97 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金 A 类份额净值为 1.051 元，C 类份额净值为 1.004 元，基金 A 类份额总额 11,730,642.99 份，C 类份额总额 100,102,200.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目              | 附注号      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 5 日(基金合<br>同生效日)至 2015 年 6<br>月 30 日 |
|------------------|----------|--|--|
| <b>一、收入</b>      |          | 5,114,157.57                             | 3,608,772.84   |
| 1.利息收入           |          | 29,834,503.17                            | 1,206,794.25   |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.11 | 226,104.94                               | 420,365.89   |
| 债券利息收入           |          | 29,139,428.73                            | -  |
| 资产支持证券利息收入       |          | -  | -  |
| 买入返售金融资产收入       |          | 468,969.50                               | 786,428.36   |
| 其他利息收入           |          | -  | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | -7,602,028.34                            | 1,626,320.09   |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.12 | -2,086,383.75                            | 1,626,320.09   |
| 基金投资收益           |          | -  | -  |

|                            |            |                |              |
|----------------------------|------------|----------------|--------------|
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13   | -5,606,611.49  | -            |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.13.5 | -              | -            |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.14   | -              | -            |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.15   | -              | -            |
| 股利收益                       | 6.4.7.16   | 90,966.90      | -            |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.17   | -17,351,825.43 | 775,456.85   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -              | -            |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.18   | 233,508.17     | 201.65       |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 12,135,217.31  | 777,182.64   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 5,681,794.77   | 399,959.74   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 710,224.31     | 49,994.97    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 3,407,929.69   | 9.50         |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 202,115.45     | 307,009.03   |
| 5. 利息支出                    |            | 1,959,059.22   | -            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 1,959,059.22   | -            |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 174,093.87     | 20,209.40    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -7,021,059.74  | 2,831,590.20 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -7,021,059.74  | 2,831,590.20 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                |                   |
|--------------------------|---------------------------------------|----------------|-------------------|
|                          | 实收基金                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）          | 2,739,005,317.80                      | -13,024,152.72 | 2,725,981,165.08  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | -                                     | -7,021,059.74  | -7,021,059.74     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数     | -2,627,172,474.41                     | 21,050,302.87  | -2,606,122,171.54 |



|  |  |               |                   |
|--|--|---------------|-------------------|
| (净值减少以“-”号填列)                          |  |               |                   |
| 其中：1.基金申购款                             | -  | -             | -                 |
| 2. 基金赎回款                               | -2,627,172,474.41                        | 21,050,302.87 | -2,606,122,171.54 |
| 四、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) | -  | -             | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 111,832,843.39                           | 1,005,090.41  | 112,837,933.80    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年6月30日 |               |                   |
|  | 实收基金                                     | 未分配利润         | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 10,082,466.40                            | -             | 10,082,466.40     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -  | 2,831,590.20  | 2,831,590.20      |
| 三、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)      | 1,019,926,464.34                         | -1,154,831.23 | 1,018,771,633.11  |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,019,926,464.34                         | -1,154,831.23 | 1,018,771,633.11  |
| 2. 基金赎回款                               | -  | -             | -                 |
| 四、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) | -  | -             | -                 |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 1,030,008,930.74                         | 1,676,758.97  | 1,031,685,689.71  |

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 5 日。

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：

\_\_\_\_\_ 陈光明 \_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 任莉 \_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 詹朋 \_\_\_\_\_

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督

管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]947 号文)准予注册,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2015 年 6 月 5 日生效。本基金为契约型开放式,发起式,存续期限不定期。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金于 2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 2 日向社会公开募集,扣除认购费后的有效认购资金 10,082,466.40 元,利息转份额 0.00 元,募集规模为 10,082,466.40 份。上述募集资金已由立信会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红策略精选灵活配置混合型发起式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发行的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、股指期货、国债期货、权证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的相关规定)。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。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规

定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[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、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 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。

(3)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。

(4)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。

### 6.4.7 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<br>2016 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 604,776.79             |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 604,776.79             |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 |               |               |
|---------------|------------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 12,589,710.05          | 14,277,981.07 | 1,688,271.02  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | 61,700,749.12 | 61,677,387.10 |
|               | 银行间市场                  | -             | -             |
|               | 合计                     | 61,700,749.12 | 61,677,387.10 |
| 资产支持证券        | -                      | -             | -             |
| 基金            | -                      | -             | -             |
| 其他            | -                      | -             | -             |
| 合计            | 74,290,459.17          | 75,955,368.17 | 1,664,909.00  |

### 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

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2016年6月30日 |           |
|--------|-------------------|-----------|
|        | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 30,000,000.00     | -         |
| 合计     | 30,000,000.00     | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末，未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 574.69            |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 1,225.53          |
| 应收债券利息     | 1,187,157.71      |
| 应收买入返售证券利息 | 3,316.67          |
| 应收申购款利息    | 55,119.92         |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 37.26             |
| 合计         | 1,247,431.78      |

### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末，未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 300,995.68        |
| 银行间市场应付交易费用 | 13,204.60         |
| 合计          | 314,200.28        |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提费用        | 189,287.34        |
| 合计          | 189,287.34        |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 东方红策略精选混合 A   |                            |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 81,208,861.61              | 81,208,861.61  |
| 本期申购          | -                          | -              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -69,478,218.62             | -69,478,218.62 |
| 本期末           | 11,730,642.99              | 11,730,642.99  |

金额单位：人民币元

| 东方红策略精选混合 C   |                            |                   |
|---------------|----------------------------|-------------------|
| 项目            | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                   |
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额              |
| 上年度末          | 2,657,796,456.19           | 2,657,796,456.19  |
| 本期申购          | -                          | -                 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,557,694,255.79          | -2,557,694,255.79 |
| 本期末           | 100,102,200.40             | 100,102,200.40    |

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 东方红策略精选混合 A    |               |               |               |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | -2,483,682.42 | 4,546,011.59  | 2,062,329.17  |
| 本期利润           | 1,166,575.07  | -954,698.07   | 211,877.00    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,240,523.81  | -2,912,133.89 | -1,671,610.08 |
| 其中：基金申购款       | -             | -             | -             |
| 基金赎回款          | 1,240,523.81  | -2,912,133.89 | -1,671,610.08 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |

|     |            |            |            |
|-----|------------|------------|------------|
| 本期末 | -76,583.54 | 679,179.63 | 602,596.09 |
|-----|------------|------------|------------|

单位：人民币元

| 东方红策略精选混合 C    |                 |                 |                |
|----------------|-----------------|-----------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | -160,035,885.39 | 144,949,403.50  | -15,086,481.89 |
| 本期利润           | 9,164,190.62    | -16,397,127.36  | -7,232,936.74  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 145,638,269.14  | -122,916,356.19 | 22,721,912.95  |
| 其中：基金申购款       | -               | -               | -              |
| 基金赎回款          | 145,638,269.14  | -122,916,356.19 | 22,721,912.95  |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -              |
| 本期末            | -5,233,425.63   | 5,635,919.95    | 402,494.32     |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 145,452.75                 |
| 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 | 79,764.83                  |
| 其他        | 887.36                     |
| 合计        | 226,104.94                 |

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 88,468,517.87              |
| 减：卖出股票成本总额 | 90,554,901.62              |
| 买卖股票差价收入   | -2,086,383.75              |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股 | -5,606,611.49              |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 及债券到期兑付) 差价收入  |               |
| 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             | -5,606,611.49 |

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 4,591,891,523.58     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,536,537,044.98     |
| 减：应收利息总额               | 60,961,090.09        |
| 买卖债券差价收入               | -5,606,611.49        |

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 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。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期末未进行贵金属投资。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无贵金属申购差价收入。



### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 90,966.90                  |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 90,966.90                  |

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -17,351,825.43             |
| ——股票投资     | -5,755,169.37              |
| ——债券投资     | -11,596,656.06             |
| ——资产支持证券投资 | -                          |
| ——贵金属投资    | -                          |
| ——其他       | -                          |
| 2. 衍生工具    | -                          |
| ——权证投资     | -                          |
| 3. 其他      | -                          |
| 合计         | -17,351,825.43             |

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 233,508.17                 |
| 合计      | 233,508.17                 |

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 168,440.45                 |
| 银行间市场交易费用 | 33,675.00                  |

|    |              |
|----|--------------|
| 合计 | 202, 115. 45 |
|----|--------------|

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 29, 835. 26                           |
| 信息披露费 | 99, 452. 08                           |
| 账户维护费 | 18, 600. 00                           |
| 银行费用  | 26, 206. 53                           |
| 合计    | 174, 093. 87                          |

### 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

截至资产负债表日, 本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日, 本基金无需要披露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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 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         |
|--------------------------|-----------------|
| 上海东方证券资产管理有限公司           | 基金管理人、基金销售机构    |
| 中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”） | 基金托管人           |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）       | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至<br>2015 年 6 月 30 日 |                  |
|-------|---------------------------------------|------------------|--|------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期股票<br>成交总额的比例 |

|      |               |         |                |         |
|------|---------------|---------|----------------|---------|
| 东方证券 | 95,931,385.87 | 100.00% | 235,352,659.10 | 100.00% |
|------|---------------|---------|----------------|---------|

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2015年6月5日(基金合同生效日)至<br>2015年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|--|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 东方证券  | 882,308,677.22             | 100.00%          | 0.00   | 0.00%            |

注：本基金合同生效日为2015年6月5日，本基金上年度可比区间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                    | 上年度可比期间<br>2015年6月5日(基金合同生效日)至2015<br>年6月30日 |                    |
|-------|----------------------------|--------------------|--|--------------------|
|       | 回购成交金额                     | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 | 回购成交金额                                       | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 |
| 东方证券  | 10,664,460,000.00          | 100.00%            | 800,000,000.00                               | 100.00%            |

#### 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<br>2016年1月1日至2016年6月30日               |                |            |                  |
|-------|--|----------------|------------|------------------|
|       | 当期佣金                                     | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 东方证券  | 70,154.70                                | 100.00%        | 300,995.68 | 100.00%          |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年6月5日(基金合同生效日)至2015年6月30日 |                |            |                  |
|       | 当期佣金                                     | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 东方证券  | 214,264.72                               | 100.00%        | 214,264.72 | 100.00%          |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元

的资格；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

### 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)<br>至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 5,681,794.77                             | 399,959.74  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -  | -   |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准，本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付给销售机构的客户维护费。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)<br>至 2015 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 710,224.31                               | 49,994.97   |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

|          |    |
|----------|----|
| 获得销售服务费的 | 本期 |
|----------|----|

| 各关联方名称         | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日                     |              |              |
|----------------|---|--------------|--------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                    |              |              |
|                | 东方红策略精选混合 A   | 东方红策略精选混合 C  | 合计           |
| 上海东方证券资产管理有限公司 | -   | 3,407,929.69 | 3,407,929.69 |
| 合计             | -   | 3,407,929.69 | 3,407,929.69 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日 |              |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                    |              |              |
|                | 东方红策略精选混合 A   | 东方红策略精选混合 C  | 合计           |
| 上海东方证券资产管理有限公司 | -   | 9.50         | 9.50         |
| 合计             | -   | 9.50         | 9.50         |

注：本基金 C 类份额的销售服务费率按前一日 C 类基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |               |                |       |      |       |      |
|---------------------------------------|---------------|----------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                        | 债券交易金额        |                | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                       | 基金买入          | 基金卖出           | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 建设银行                                  | 30,673,890.00 | 163,630,360.46 | -     | -    | -     | -    |

注：本基金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。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目               | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |             |
|------------------|---------------------------------------|-------------|
|                  | 东方红策略精选混合 A                           | 东方红策略精选混合 C |
| 基金合同生效日(2015 年 6 | -                                     | -           |

|                       |               |   |
|-----------------------|---------------|---|
| 月 5 日 ) 持有的基金份额       |               |   |
| 期初持有的基金份额             | 10,000,000.00 | - |
| 期间申购/买入总份额            | -             | - |
| 期间因拆分变动份额             | -             | - |
| 减: 期间赎回/卖出总份额         | -             | - |
| 期末持有的基金份额             | 10,000,000.00 | - |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 85.2468%      | - |

| 项目                                | 上年度可比期间                                  |             |
|-----------------------------------|--|-------------|
|                                   | 2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日 |             |
|                                   | 东方红策略精选混合 A                              | 东方红策略精选混合 C |
| 基金合同生效日( 2015 年 6 月 5 日 ) 持有的基金份额 | 10,000,000.00                            | -           |
| 期初持有的基金份额                         | 10,000,000.00                            | -           |
| 期间申购/买入总份额                        | -  | -           |
| 期间因拆分变动份额                         | -  | -           |
| 减: 期间赎回/卖出总份额                     | -  | -           |
| 期末持有的基金份额                         | 10,000,000.00                            | -           |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例             | 0.9709%                                  | -           |

注: 1、上表中“期末持有的基金份额占基金总份额比例”的分母为各自级别的份额。

2、上述基金管理人运用自有资金于 2015 年 6 月 2 日认购东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金, 按照招募说明书规定, 认购费 1000 元。

3、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 5 日。

#### 6.4.10.4.2 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

报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

#### 6.4.10.5 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2015 年 6 月 5 日(基金合同生效日)至<br>2015 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    |
| 建设银行股份有限公司 | 604,776.79                            | 145,452.75 | 259,667,883.66   | 94,159.18 |

注: 本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管, 按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2016 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           | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 300520               | 科大国创 | 2016 年 6 月 30 日 | 2016 年 7 月 8 日 | 新股流通受限 | 10.05 | 10.05  | 671          | 6,743.55 | 6,743.55 | -  |
| 002805               | 丰元股份 | 2016 年 6 月 29 日 | 2016 年 7 月 7 日 | 新股流通受限 | 5.80  | 5.80   | 971          | 5,631.80 | 5,631.80 | -  |

| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |      |                 |                |        |        |        |              |            |            |    |
|----------------------|------|-----------------|----------------|--------|--------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：张) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 127003               | 海印转债 | 2016 年 6 月 15 日 | 2016 年 7 月 1 日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 1,000        | 100,000.00 | 100,000.00 | -  |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期             | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期           | 复牌开盘单价 | 数量（股）   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------------|--------|--------|----------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 000002 | 万科 A | 2015 年 12 月 18 日 | 重大事项停牌 | 18.20  | 2016 年 7 月 4 日 | 21.99  | 280,000 | 3,920,381.42 | 5,096,000.00 | -  |
| 600005 | 武钢股份 | 2016 年 6 月 27 日  | 重大事项停牌 | 2.76   | -              | -      | 500,000 | 1,665,000.00 | 1,380,000.00 | -  |

|        |      |           |        |       |   |   |        |            |            |   |
|--------|------|-----------|--------|-------|---|---|--------|------------|------------|---|
| 601900 | 南方传媒 | 2016年6月6日 | 重大事项停牌 | 17.67 | - | - | 18,362 | 112,559.06 | 324,456.54 | - |
|--------|------|-----------|--------|-------|---|---|--------|------------|------------|---|

### 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 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责在董事会授权范围内的重大经营项目和创新业务的风险评估；在业务操作层面风险管理职责主要由合规与风险管理部和风险管理人员负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的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，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均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<br>2016年6月30日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 4,997,000.00      | 392,428,000.00      |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | 540,742,000.00      |
| 合计     | 4,997,000.00      | 933,170,000.00      |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本期末“A-1”包含期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票。

### 6.4.13.2.2 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<br>2016年6月30日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 24,426,600.00     | 189,702,001.80      |
| AAA 以下 | 32,253,787.10     | 524,198,317.60      |
| 未评级    | -                 | 382,616,063.10      |
| 合计     | 56,680,387.10     | 1,096,516,382.50    |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本期末“AAA”包含期限在一年以上的国债、政策性金融债、央票。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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，因此除在附注 6.4.12 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，其余均能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2016年6月<br>30日 | 1个月以内         | 1-3个月        | 3个月-1年       | 1-5年          | 5年以上       | 不计息           | 合计             |
|-----------------------|---------------|--------------|--------------|---------------|------------|---------------|----------------|
| 资产                    |               |              |              |               |            |               |                |
| 银行存款                  | 604,776.79    | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 0.00          | 604,776.79     |
| 结算备付金                 | 3,026,001.67  | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 0.00          | 3,026,001.67   |
| 存出保证金                 | 91,966.35     | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 0.00          | 91,966.35      |
| 交易性金融<br>资产           | 0.00          | 4,267,600.00 | 9,112,600.00 | 48,197,187.10 | 100,000.00 | 14,277,981.07 | 75,955,368.17  |
| 买入反售金<br>融资产          | 30,000,000.00 | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 0.00          | 30,000,000.00  |
| 应收证券清<br>算款           | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 2,539,545.41  | 2,539,545.41   |
| 应收利息                  | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 1,247,431.78  | 1,247,431.78   |
| 资产总计                  | 33,722,744.81 | 4,267,600.00 | 9,112,600.00 | 48,197,187.10 | 100,000.00 | 18,064,958.26 | 113,465,090.17 |
| 负债                    |               |              |              |               |            |               |                |
| 卖出回购金<br>融资产款         | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 0.00          | 0.00           |
| 应付赎回款                 | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 0.00          | 0.00           |
| 应付管理人<br>报酬           | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 73,537.93     | 73,537.93      |
| 应付托管费                 | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 9,192.25      | 9,192.25       |
| 应付销售服<br>务费           | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 40,938.57     | 40,938.57      |
| 应付交易费<br>用            | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 314,200.28    | 314,200.28     |
| 应付利息                  | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 189,287.34    | 189,287.34     |
| 应交税费                  | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 0.00          | 0.00           |
| 其他负债                  | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 0.00          | 0.00           |
| 负债总计                  | 0.00          | 0.00         | 0.00         | 0.00          | 0.00       | 627,156.37    | 627,156.37     |
| 利率敏感度<br>缺口           | 33,722,744.81 | 4,267,600.00 | 9,112,600.00 | 48,197,187.10 | 100,000.00 | 17,437,801.89 | 112,837,933.80 |
| 上年度末<br>2015年12       | 1个月以内         | 1-3个月        | 3个月-1年       | 1-5年          | 5年以上       | 不计息           | 合计             |

| 月 31 日    |                |               |                |                |                |                |                  |
|-----------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 资产        |                |               |                |                |                |                |                  |
| 银行存款      | 9,517,674.04   | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 9,517,674.04     |
| 结算备付金     | 3,663,854.84   | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 3,663,854.84     |
| 存出保证金     | 146,414.52     | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 146,414.52       |
| 交易性金融资产   | 22,777,063.10  | 81,045,000.00 | 996,212,160.00 | 777,412,159.40 | 152,240,000.00 | 101,805,171.87 | 2,131,491,554.37 |
| 买入反售金融资产  | 550,000,000.00 | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 895.00         | 550,000,895.00   |
| 应收证券清算款   | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 61,797,816.00  | 61,797,816.00    |
| 应收利息      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 25,198,538.20  | 25,198,538.20    |
| 资产总计      | 586,105,006.50 | 81,045,000.00 | 996,212,160.00 | 777,412,159.40 | 152,240,000.00 | 188,802,421.07 | 2,781,816,746.97 |
| 负债        |                |               |                |                |                |                |                  |
| 卖出回购金融资产款 | 52,239,000.00  | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 52,239,000.00    |
| 应付赎回款     | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00             |
| 应付管理人报酬   | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 1,840,530.73   | 1,840,530.73     |
| 应付托管费     | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 230,066.34     | 230,066.34       |
| 应付销售服务费   | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 1,115,199.04   | 1,115,199.04     |
| 应付交易费用    | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 250,785.78     | 250,785.78       |
| 应付利息      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00             |
| 应交税费      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 0.00             |
| 其他负债      | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 160,000.00     | 160,000.00       |
| 负债总计      | 52,239,000.00  | 0.00          | 0.00           | 0.00           | 0.00           | 3,596,581.89   | 55,835,581.89    |
| 利率敏感度缺口   | 533,866,006.50 | 81,045,000.00 | 996,212,160.00 | 777,412,159.40 | 152,240,000.00 | 185,205,839.18 | 2,725,981,165.08 |

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |  |                             |                   |
|----|--|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金于本报告期末的利率风险状况；                      |                             |                   |
|    | 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动25个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； |                             |                   |
|    | 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。              |                             |                   |
| 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（2016年6月30日）             | 上年度末（2015年12月31日） |
|    | 上升0.25%  | -425,517.64                 | -9,993,360.37     |

|  |          |            |              |
|--|----------|------------|--------------|
|  | 下降 0.25% | 425,517.64 | 9,993,360.37 |
|--|----------|------------|--------------|

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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

本基金承受的其他市场价格风险，主要是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。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券的涨跌趋势的影响，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其他市场价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 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<br>2016年6月30日 |                          | 上年度末<br>2015年12月31日 |                      |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|----------------------|
|               | 公允价值              | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金资<br>产净值比<br>例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 14,277,981.07     | 12.65                    | 101,805,171.87      | 3.73                 |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -                        | -                   | -                    |
| 交易性金融资产—债券投资  | 61,677,387.10     | 54.66                    | 2,029,686,382.50    | 74.46                |
| 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            | 75,955,368.17     | 67.31                    | 2,131,491,554.37    | 78.19                |

注：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发行的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、股指期货、国债期货、权证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的相关规定）。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                                     |
|----|-------------------------------------|
| 假设 | 基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密 |
|----|-------------------------------------|

|    |                      |                             |                   |
|----|----------------------|-----------------------------|-------------------|
|    | 相关；                  |                             |                   |
|    | 除沪深300指数以外的其他市场变量保持。 |                             |                   |
| 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（2016年6月30日）             | 上年度末（2015年12月31日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 459,350.92                  | 4,088,971.75      |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | -459,350.92                 | -4,088,971.75     |

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准对应的股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

|    |                        |                 |                   |
|----|------------------------|-----------------|-------------------|
| 假设 | 1. 置信区间 95%            |                 |                   |
|    | 2. 观察期 统计日之前的 250 个交易日 |                 |                   |
| 分析 | 风险价值<br>(单位：人民币元)      | 本期末（2016年6月30日） | 上年度末（2015年12月31日） |
|    | 1 天                    | 357,042.72      | 3,816,373.63      |
|    | 1 周                    | 798,371.78      | 8,533,670.87      |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 7,465,149.18 元，第二层次的余额为 68,490,218.99 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,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股票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,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本基金采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值,并将相关债券的公允价值确定为第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | 14,277,981.07 | 12.58         |
|    | 其中:股票             | 14,277,981.07 | 12.58         |
| 2  | 固定收益投资            | 61,677,387.10 | 54.36         |
|    | 其中:债券             | 61,677,387.10 | 54.36         |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | 30,000,000.00 | 26.44         |
|    | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,630,778.46  | 3.20          |

|   |        |                |        |
|---|--------|----------------|--------|
| 7 | 其他各项资产 | 3,878,943.54   | 3.42   |
| 8 | 合计     | 113,465,090.17 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

## 7.2 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              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 8,829,557.93  | 7.82         |
| 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  | 27,966.60     | 0.02         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | 5,096,000.00  | 4.52         |
| 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        | 324,456.54    | 0.29         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 14,277,981.07 | 12.65        |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

## 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         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 000002 | 万 科 A | 280,000 | 5,096,000.00 | 4.52         |
| 2  | 000538 | 云南白药  | 50,000  | 3,215,000.00 | 2.85         |
| 3  | 002415 | 海康威视  | 121,500 | 2,607,390.00 | 2.31         |
| 4  | 603508 | 思维列控  | 14,605  | 1,451,883.05 | 1.29         |
| 5  | 600005 | 武钢股份  | 500,000 | 1,380,000.00 | 1.22         |
| 6  | 601900 | 南方传媒  | 18,362  | 324,456.54   | 0.29         |
| 7  | 300516 | 久之洋   | 368     | 64,462.56    | 0.06         |
| 8  | 300515 | 三德科技  | 1,084   | 50,807.08    | 0.05         |
| 9  | 002799 | 环球印务  | 864     | 37,704.96    | 0.03         |
| 10 | 300518 | 盛讯达   | 453     | 21,223.05    | 0.02         |
| 11 | 002802 | 洪汇新材  | 1,106   | 16,678.48    | 0.01         |
| 12 | 300520 | 科大国创  | 671     | 6,743.55     | 0.01         |
| 13 | 002805 | 丰元股份  | 971     | 5,631.80     | 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  | 600036 | 招商银行 | 4,132,868.00 | 0.15           |
| 2  | 600005 | 武钢股份 | 3,330,000.00 | 0.12           |
| 3  | 603377 | 东方时尚 | 113,750.40   | 0.00           |
| 4  | 601900 | 南方传媒 | 112,559.06   | 0.00           |
| 5  | 002791 | 坚朗五金 | 85,697.61    | 0.00           |
| 6  | 603608 | 天创时尚 | 78,341.20    | 0.00           |
| 7  | 603919 | 金徽酒  | 72,247.76    | 0.00           |
| 8  | 002792 | 通宇通讯 | 70,678.14    | 0.00           |
| 9  | 002788 | 鹭燕医药 | 68,314.95    | 0.00           |
| 10 | 603868 | 飞科电器 | 59,372.79    | 0.00           |
| 11 | 002790 | 瑞尔特  | 50,104.76    | 0.00           |
| 12 | 300511 | 雪榕生物 | 48,307.04    | 0.00           |
| 13 | 603861 | 白云电器 | 34,476.00    | 0.00           |
| 14 | 002789 | 建艺集团 | 33,795.00    | 0.00           |
| 15 | 300474 | 景嘉微  | 33,649.88    | 0.00           |
| 16 | 601020 | 华钰矿业 | 31,426.86    | 0.00           |



|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 17 | 603101 | 汇嘉时代 | 31,390.03 | 0.00 |
| 18 | 603528 | 多伦科技 | 29,408.40 | 0.00 |
| 19 | 002797 | 第一创业 | 27,664.00 | 0.00 |
| 20 | 603027 | 千禾味业 | 26,687.76 | 0.00 |

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（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  | 600036 | 招商银行 | 19,720,560.83 | 0.72           |
| 2  | 600066 | 宇通客车 | 18,064,848.32 | 0.66           |
| 3  | 600079 | 人福医药 | 9,670,923.55  | 0.35           |
| 4  | 300059 | 东方财富 | 7,681,271.20  | 0.28           |
| 5  | 000651 | 格力电器 | 6,993,800.84  | 0.26           |
| 6  | 000538 | 云南白药 | 6,627,465.67  | 0.24           |
| 7  | 002415 | 海康威视 | 3,641,105.84  | 0.13           |
| 8  | 600005 | 武钢股份 | 1,735,257.00  | 0.06           |
| 9  | 300496 | 中科创达 | 1,377,647.20  | 0.05           |
| 10 | 002781 | 奇信股份 | 1,319,728.50  | 0.05           |
| 11 | 603936 | 博敏电子 | 748,120.56    | 0.03           |
| 12 | 300494 | 盛天网络 | 606,347.00    | 0.02           |
| 13 | 603996 | 中新科技 | 592,173.70    | 0.02           |
| 14 | 002782 | 可立克  | 570,842.56    | 0.02           |
| 15 | 002786 | 银宝山新 | 493,185.00    | 0.02           |
| 16 | 603778 | 乾景园林 | 465,081.20    | 0.02           |
| 17 | 002787 | 华源包装 | 453,990.20    | 0.02           |
| 18 | 603299 | 井神股份 | 415,182.53    | 0.02           |
| 19 | 300493 | 润欣科技 | 398,672.04    | 0.01           |
| 20 | 002780 | 三夫户外 | 386,743.00    | 0.01           |

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（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 | 8,782,880.19  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 88,468,517.87 |

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

### 7.5 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      | 4,997,000.00  | 4.43         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 56,580,387.10 | 50.14        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 100,000.00    | 0.09         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 61,677,387.10 | 54.66        |

### 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  | 122465 | 15 广越 01 | 100,000 | 10,192,000.00 | 9.03         |
| 2  | 136140 | 16 富力 01 | 100,000 | 10,119,000.00 | 8.97         |
| 3  | 136186 | 16 苏新债   | 100,000 | 10,060,000.00 | 8.92         |
| 4  | 136208 | 16 广新 02 | 100,000 | 10,012,000.00 | 8.87         |
| 5  | 019533 | 16 国债 05 | 50,000  | 4,997,000.00  | 4.43         |

### 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投资。

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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进行股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 7.11.2 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进行国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金持有的前十名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。

### 7.12.2

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。

### 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   | 91,966.35    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,539,545.41 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,247,431.78 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 3,878,943.54 |
|---|----|--------------|

### 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处于转股期的可转债。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1  | 000002 | 万科A  | 5,096,000.00 | 4.52          | 重大事项停牌   |
| 2  | 600005 | 武钢股份 | 1,380,000.00 | 1.22          | 重大事项停牌   |
| 3  | 601900 | 南方传媒 | 324,456.54   | 0.29          | 重大事项停牌   |

### 7.12.6 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。

## § 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 |
| 东方红策略精选混合A | 9         | 1,303,404.78  | 10,000,000.00  | 85.25% | 1,730,642.99 | 14.75% |
| 东方红策略精选混合C | 3         | 33,367,400.13 | 100,000,000.00 | 99.90% | 102,200.40   | 0.10%  |
| 合计         | 12        | 9,319,403.62  | 110,000,000.00 | 98.36% | 1,832,843.39 | 1.64%  |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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 | 东方红策略精选混合 A | 0.00      | 0.0000%  |
|                  | 东方红策略精选混合 C | 0.00      | 0.0000%  |
|                  | 合计          | 0.00      | 0.0000%  |

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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的情况

| 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 | 东方红策略精选混合 A | 0                 |
|                                | 东方红策略精选混合 C | 0                 |
|                                | 合计          | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 东方红策略精选混合 A | 0                 |
|                                | 东方红策略精选混合 C | 0                 |
|                                | 合计          | 0                 |

### 8.4 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   | 10,000,000.00 | 8.94            | 10,000,000.00 | 8.94            | 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          | 10,000,000.00 | 8.94            | 10,000,000.00 | 8.94            | 3 年        |

注：截止日期 2016 年 6 月 30 日。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 东方红策略精选<br>混合 A | 东方红策略精选<br>混合 C  |
|-------------------------------|-----------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 5 日）基金份额总额 | 10,054,466.40   | 28,000.00        |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 81,208,861.61   | 2,657,796,456.19 |
| 本报告期基金总申购份额                   | -               | -                |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 69,478,218.62   | 2,557,694,255.79 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）      | -               | -                |
| 本报告期末基金份额总额                   | 11,730,642.99   | 100,102,200.40   |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期本基金管理人于 2016 年 3 月 25 日发布公告，同意王国斌先生自 2016 年 3 月 24 日起辞去公司董事长职务，由公司总经理陈光明先生代为履行公司董事长职务。

本报告期本基金管理人于 2016 年 6 月 16 日发布公告，自 2016 年 6 月 15 日起任命饶刚同志担任基金管理人副总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是立信会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 |    |
| 东方证券 | 2      | 95,931,385.87 | 100.00%      | 70,154.70 | 100.00%    | -  |

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）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

##### （1）选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

##### （2）选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

4、本基金本报告期内无交易单元变更情况。

#### 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 |
| 东方证券 | 882,308,677.22 | 100.00%      | 10,664,460,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

### 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  | 上海东方证券资产管理有限公司关于《上海东方证券资产管理有限公司关于新增基金高级管理人员的公告》的更正公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2016 年 1 月 4 日  |
| 2  | 上海东方证券资产管理有限公司旗下基金 2015 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2016 年 1 月 4 日  |
| 3  | 上海东方证券资产管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告                  | 公司网站                  | 2016 年 1 月 4 日  |
| 4  | 上海东方证券资产管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报      | 2016 年 1 月 5 日  |
| 5  | 上海东方证券资产管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告                  | 公司网站                  | 2016 年 1 月 7 日  |
| 6  | 上海东方证券资产管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2016 年 1 月 8 日  |
| 7  | 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(摘要)(2015 年第 2 号)     | 中国证券报、证券时报、公司网站       | 2016 年 1 月 15 日 |
| 8  | 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(2015 年第 2 号)         | 公司网站                  | 2016 年 1 月 15 日 |
| 9  | 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2015 年第 4 季度报告                | 中国证券报、证券时报、公司网站       | 2016 年 1 月 20 日 |
| 10 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2016 年 2 月 4 日  |
| 11 | 上海东方证券资产管理有限公司关于董事长变更的公告                              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2016 年 3 月 25 日 |
| 12 | 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金                               | 中国证券报、公司网站            | 2016 年 3 月 26 日 |



|    |   |                       |                 |
|----|---|-----------------------|-----------------|
|    | 2015 年年度报告（摘要）                            |                       |                 |
| 13 | 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金<br>2015 年年度报告     | 公司网站                  | 2016 年 3 月 26 日 |
| 14 | 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金<br>2016 年第 1 季度报告 | 中国证券报、证券时报、公司网站       | 2016 年 4 月 21 日 |
| 15 | 上海东方证券资产管理有限公司关于新增基金高级管理人员的公告             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2016 年 6 月 16 日 |

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 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。

### 11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层。

### 11.3 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  
2016 年 8 月 29 日