
东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2016 年 7 月 11 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
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.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3 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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
8.6 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.....	47
8.7 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.....	47

8.8 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	47
8.9 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	47
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
8.12 投资组合报告附注	48
§9 基金份额持有人信息	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
9.3 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	49
§10 开放式基金份额变动	49
§11 重大事件揭示	49
11.1 基金份额持有人大会决议	49
11.2 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	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4 基金投资策略的改变	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.8 其他重大事件	51
§12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东方红沪港深混合
基金主代码	002803
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 11 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,176,565,198.15 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对宏观经济形势、行业发展趋势和企业基本面的深入研究，把握沪港通等后续资本市场开放形势下 A 股与港股市场互联互通的投资机会，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金是一只灵活配置的混合型基金，采取主动管理的投资模式。在投资策略上，先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，即确定权益类资产和固定收益类资产的投资比例；然后通过比较各行业所处的发展阶段、竞争趋势、景气程度和发展空间等在不同行业间进行动态配置；最后通过比较 A 股与港股市场同类公司的质地及估值水平等要素，进行个券选择，构建合理的投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数×40%+恒生指数×40%+中国债券总指数收益率×20%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐涵颖	郭明
	联系电话	021-63325888	010-66105799
	电子邮箱	service@dfham.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009200808	95588

传真	021-63326981	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	陈光明	易会满

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, 上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金年度报告备置地点	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 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区南京东路 61 号 4-11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 7 月 11 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	9,837,773.28
本期利润	24,400,990.25
加权平均基金份额本期利润	0.0274
本期加权平均净值利润率	2.69%
本期基金份额净值增长率	3.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末
期末可供分配利润	12,604,133.95
期末可供分配基金份额利润	0.0107
期末基金资产净值	1,211,347,506.08
期末基金份额净值	1.030
3.1.3 累计期末指标	2016 年末

基金份额累计净值增长率	3.00%
-------------	-------

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日；“本期”指 2016 年 7 月 11 日（基金合同生效日）-2016 年 12 月 31 日。

2、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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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。

4、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）。

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	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
过去三个月	1.98%	0.42%	-2.04%	0.58%	4.02%	-0.16%
自基金合同生效起至今	3.00%	0.37%	4.03%	0.59%	-1.03%	-0.22%

注：本基金合同于 2016 年 7 月 11 日生效。

自基金合同生效日起至今指 2016 年 7 月 11 日-2016 年 12 月 31 日。

根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数×40%+恒生指数×40%+中国债券总指数收益率×20%

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

$$benchmark_t = 40\% * [t \text{ 日沪深 300 指数} / (t-1 \text{ 日沪深 300 指数}) - 1] + 40\% * [t \text{ 日恒生指数} / (t-1 \text{ 日恒生指数}) - 1] + 20\% * [t \text{ 日中国债券总指数} / (t-1 \text{ 日中国债券总指数}) - 1] +$$

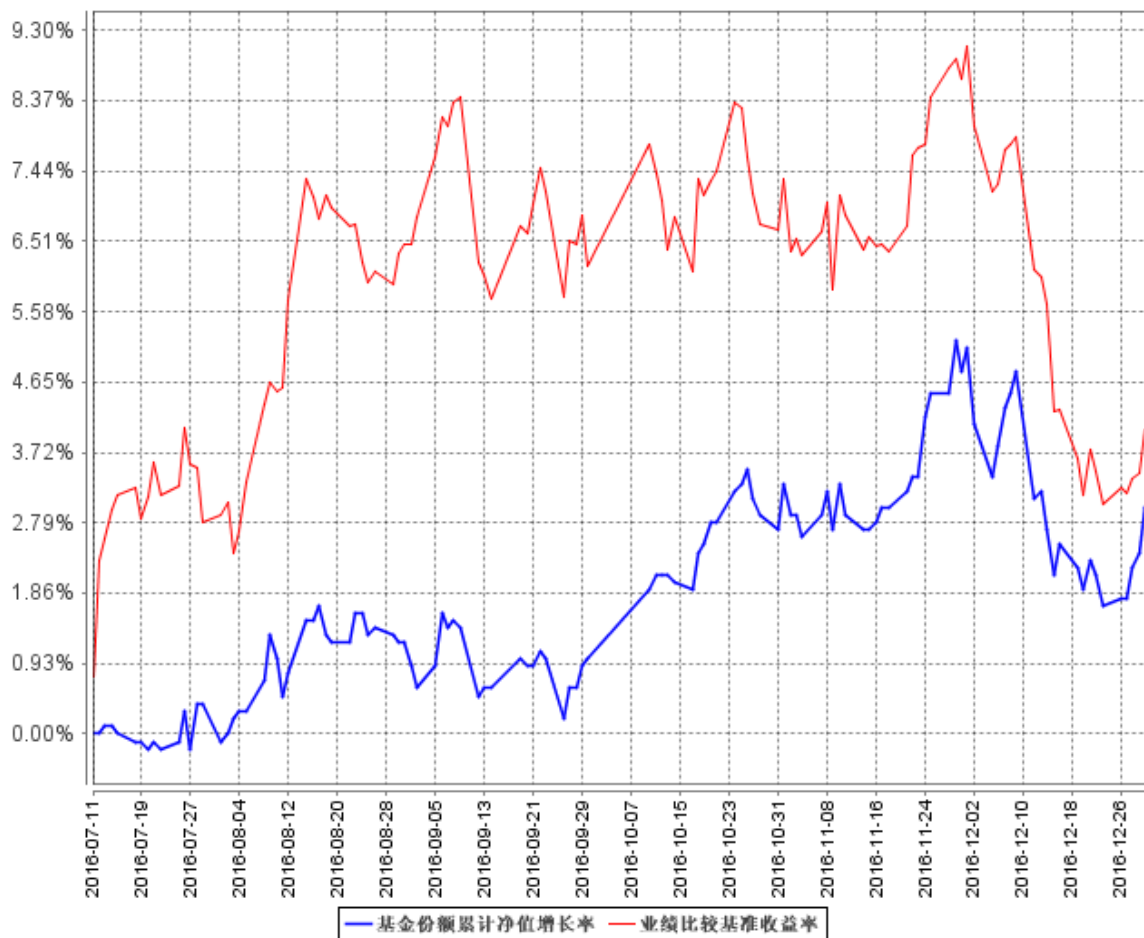
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ，T 表示时间截至日；

t 日至 T 日的期间收益率（ $benchmark_{t:T}$ ）按下列公式计算：

$$benchmark_{t:T} = [\prod_{i=t}^T (1 + benchmark_i)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{i=t}^T (1 + benchmark_i)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + benchmark_i)$ 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

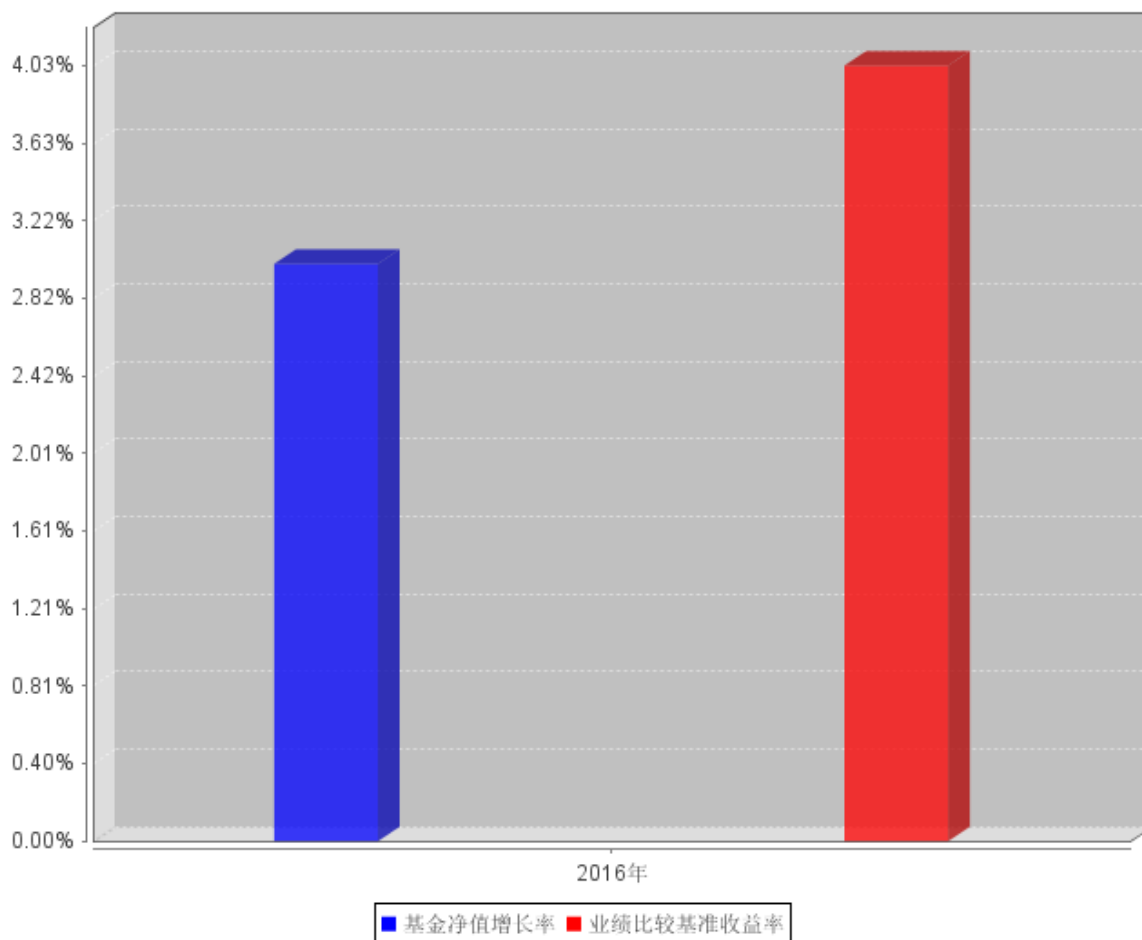


注：1、截止日期为 2016 年 12 月 31 日。

2、本基金合同于 2016 年 7 月 11 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

3、本基金建仓期 6 个月，即从 2016 年 7 月 11 日起至 2017 年 1 月 10 日，至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1. 本基金合同生效日期为 2016 年 7 月 11 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自 2016 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日未进行利润分配。

§ 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

资基金业务。截至 2016 年 12 月 31 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、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金二十六只证券投资基金。

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		
林鹏	本基金基金经理，兼任上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募权益投资部总监，兼任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	2016 年 7 月 11 日	-	19 年	硕士，曾任东方证券研究所研究员、资产管理业务总部投资经理，上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理、专户投资部资深投资经理、执行董事；现任上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募权益投资部总监兼任东方红睿丰混合、东方红睿阳混合、东方红睿元混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红睿华沪港深混合、东方红沪港深混合、东方红中国优势混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

	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、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。				
--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》

等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统当中的公平交易模块进行交易执行和分配，合规与风险管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析，校验公平交易执行情况。对于同向交易，合规与风险管理部侧重于对公司管理的不同产品（包含了公募产品、私募产品）的整体收益率差异、投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差按两两组合进行显著性检验，并根据显著性检验结果，对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录，通过逐笔检查或抽样分析的方法，分析相应交易行为的公平性。对同一投资人员管理的不同产品，则持续监控和跟踪其同向交易价差，如价差显著不为零，则在逐笔分析相关交易记录的基础上，对投资人员进行访谈，要求其进行相关的解释和说明，以更为审慎地判断其合理性。对于反向交易，除程序化交易外原则上禁止组合内部及组合之间的日内反向交易，如有投资策略或流动性等特殊需要的，需由投资经理提供投资依据，经投资决策委员会审慎审批后留档备查。本年度未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

4.3.2 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。

4.3.3 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 年宏观经济在房地产以及实体经济补库存的拉动下出现了回暖的态势，但货币宽松的大背景也随之出现了改变，在金融去杠杆的大背景之下，社会流动性开始趋紧，债券市场出现了比较大幅度的调整。同时，特朗普的当选意味着未来美国可能会加大财政投入，这引发了对通胀和

美元加大加息力度的担忧，导致人民币汇率出现大幅贬值。这些不稳定因素都打击了市场的风险偏好，使得股票市场在年底也随之出现震荡调整。

在这个震荡的时间段，本产品加大了建仓的力度，主要方向依然是我们长期看好、并且与宏观经济关联度相对不大的消费、医药、科技等行业。同时，我们在 A 股和港股市场以同样的价值投资理念选择低估的优秀公司，在报告期内对港股投资标的也有较大幅度的增持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.030 元，份额累计净值为 1.030 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 3.00%，同期业绩比较基准收益率为 4.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对未来的经济走势，我们总体谨慎但不悲观。实体经济没有显著起色，人民币汇率贬值预期加重，特朗普主政下的中美贸易政策存在变数。但另一方面，我们也看到在供给侧改革的背景下，一些细分行业有过剩产能出清的迹象；消费升级的趋势、工程师的红利等投资主线也能够促进很多行业的成长。我们认为很多行业龙头公司已经进入合理的估值区间，具备长期配置的价值。我们更看重自下而上对公司基本面的挖掘，看重本土行业龙头成长为全球冠军过程中的市值空间。

市场很难预测，我们仍将坚持“幸运的行业，能干的管理层，合理的估值”的投资理念，力争为持有人继续创造稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人日常监察稽核工作主要由合规与风险管理部承担，2016 年开展了如下主要工作：

（一）切实履行日常监察稽核各项职责，保障公司经营管理活动的持续合规。

1、顺利完成了公司 2016 年相关审查、检查工作任务。2、及时完成公司各类合规与风险管理报告工作。3、积极对监管政策提出建议及意见。4、完善员工执业行为管理工作。5、完成反洗钱各项基础工作。6、开展合规与风险管理培训与考试。

（二）以公司全面风险管理体系架构为基础，不断推进和完善风险管理工作。

1、在系统建制方面，合规与风险管理部已完成对金仕达全面风险管理系统的测试和上线，实现了事后风险管理的功能；同时，合规与风险管理部完成了对衡泰风控系统的系统评估、立项，目前该系统正在实施过程中。2、在投资组合风控方面，合规与风险管理部进一步细化了投资组合风险控制工作。

（三）进一步加强了公司制度流程建设。

合规与风险管理部根据业务发展需要对公司多项制度的修订提出了审核意见，与业务部门协同梳理了债券申购流程、定期存款流程、基金投资流程、定向增发、新股申购、商品期货风控流程等业务操作流程，有效提升流程处理效率。

（四）根据母子公司内部控制规范化实施工作方案，完善内部控制建设。

在母公司的组织下，由合规与风险管理部牵头启动内部控制规范化项目，实施范围覆盖了公司治理、产品管理、投资管理、研究管理、交易业务、营销与销售、后台运营管理、合规与风险管理、财务管理、人力资源管理等业务及管理流程。

（五）持续支持公司创新业务发展。

合规与风险管理部对资产证券化业务的产品设计提出相关建议和意见，提供法律论证意见、业务合同拟定与审核等法律支持，并采取配套的风险管理措施。

4.7 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、合规总监(或督察长)、交易总监、运营总监、基金会计主管等。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。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：1、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；2、

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

本基金本报告期末进行利润分配。

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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——中国工商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2017]第ZA30222号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“东方红沪港深混合”）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年 7 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是东方红沪港深混合的基金管理人的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金财务报表在所有重大方面按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

注册会计师的姓名	王 斌	唐 成
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号 4-11 楼	
审计报告日期	2017-03-24	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	206,926,192.67
结算备付金		19,804,998.35
存出保证金		1,969,014.13
交易性金融资产	7.4.7.2	737,199,120.96
其中：股票投资		737,199,120.96
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	383,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	320,398.20
应收股利		-
应收申购款		926,788.35
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,350,146,512.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		134,592,381.02

应付赎回款		1,277,310.86
应付管理人报酬		1,497,131.82
应付托管费		249,521.95
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	994,734.01
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	187,926.92
负债合计		138,799,006.58
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	1,176,565,198.15
未分配利润	7.4.7.10	34,782,307.93
所有者权益合计		1,211,347,506.08
负债和所有者权益总计		1,350,146,512.66

注：1、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度末可比数据，本报告期的财务报表附注亦无同期对比数据。

2、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.030 元，基金份额总额 1,176,565,198.15 份。

7.2 利润表

会计主体：东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		33,906,419.13
1. 利息收入		4,587,601.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	993,801.47
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,593,800.06
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,399,298.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,899,266.30
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-

贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	500,032.29
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	14,563,216.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	356,302.04
减：二、费用		9,505,428.88
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,416,162.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,069,360.47
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,834,815.69
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	185,090.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,400,990.25
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,400,990.25

注：本基金于 2016 年 7 月 11 日成立，无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 7 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 7 月 11 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 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）	771,371,084.49-	-	771,371,084.49-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,400,990.25	24,400,990.25
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）	405,194,113.66	10,381,317.68	415,575,431.34
其中：1. 基金申购款	541,163,556.07	14,430,581.74	555,594,137.81
2. 基金赎回款	-135,969,442.41	-4,049,264.06	-140,018,706.47
四、本期向基金份额持有	-	-	-

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×40% +恒生指数×40% +中国债券总指数收益率×20%。

7.4.2 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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 11 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金合同于 2016 年 7 月 11 日生效。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类

应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期

权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小

的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：本基金收益分配应遵循下列原则：每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。

本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国

债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 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), 按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1)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。

对基金通过沪港深股票市场交易互联互通机制投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	206,926,192.67
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	
合计：	206,926,192.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	722,635,903.99	737,199,120.96	14,563,216.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	722,635,903.99	737,199,120.96	14,563,216.97

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	383,000,000.00	-
合计	383,000,000.00	-

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	34,218.15
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	3,909.24
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	282,155.44
应收申购款利息	26.37
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	89.00
合计	320,398.20

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	994,734.01
银行间市场应付交易费用	-

合计	994,734.01
----	------------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,926.92
预提费用	185,000.00
合计	187,926.92

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	771,371,084.49	771,371,084.49
本期申购	541,163,556.07	541,163,556.07
本期赎回(以“-”号填列)	-135,969,442.41	-135,969,442.41
本期末	1,176,565,198.15	1,176,565,198.15

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金于2016年5月18日至2016年7月4日向社会公开募集，扣除认购费后的有效认购资金771,314,932.48元，利息结转份额56,152.01元，募集规模为771,371,084.49份。在本基金成立后，折算为771,371,084.49份，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,837,773.28	14,563,216.97	24,400,990.25
本期基金份额交易产生的变动数	2,766,360.67	7,614,957.01	10,381,317.68
其中：基金申购款	3,614,976.15	10,815,605.59	14,430,581.74
基金赎回款	-848,615.48	-3,200,648.58	-4,049,264.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,604,133.95	22,178,173.98	34,782,307.93

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	914,876.91
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	65,448.09
其他	13,476.47
合计	993,801.47

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	392,745,968.28
减：卖出股票成本总额	378,846,701.98
买卖股票差价收入	13,899,266.30

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金在本报告期末进行债券投资。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 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。

7.4.7.13.4 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。

7.4.7.13.5 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期末进行贵金属投资。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.14.3 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。

7.4.7.14.4 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。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.15.2 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。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	500,032.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	500,032.29

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	14,563,216.97
——股票投资	14,563,216.97
——债券投资	-
——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	14,563,216.97

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	356,302.04
合计	356,302.04

注：本基金本报告期无转出补偿费等其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,834,815.69
银行间市场交易费用	-
合计	1,834,815.69

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	85,000.00
信息披露费	100,000.00
银行费用	90.00
合计	185,090.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，

以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金截止 2016 年 12 月 31 日止期间的财务状况和经营成果无影响。

截至财务报表批准报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度可比期间。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券	1,133,746,482.25	76.07%

注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度同期对比数据。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券	8,975,500,000.00	100.00%

本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券	843,599.67	76.38%	843,599.67	84.81%

注：1、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度可比期间数据。

2、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。

3、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；截至报告期末，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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	2,595,508.67

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

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。

3、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,069,360.47

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

2、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2016年7月11日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	206,926,192.67	914,876.91

注：1、本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同生效日为2016年7月11日，无上年度可比期间数据。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	2,701	62,555.16	62,555.16	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-

603266	天龙股份	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	新股流 通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年 12月28 日	2017年 1月5 日	新股流 通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年 12月29 日	2017年 1月10 日	新股流 通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年 12月28 日	2017年 1月6 日	新股流 通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年 12月26 日	2017年 1月3 日	新股流 通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	新股流 通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年 12月26 日	2017年 1月4 日	新股流 通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300588	熙菱信息	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止本报告期末，本基金未持有因暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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部负责，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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31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	206,926,192.67	-	-	-	-	-	206,926,192.67
结算备付金	19,804,998.35	-	-	-	-	-	19,804,998.35
存出保证金	1,969,014.13	-	-	-	-	-	1,969,014.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-737,199,120.96	737,199,120.96
买入返售金融资产	383,000,000.00	-	-	-	-	-	383,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	320,398.20	320,398.20
应收申购款	-	-	-	-	-	926,788.35	926,788.35
资产总计	611,700,205.15	-	-	-	-	738,446,307.51	1,350,146,512.66
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-134,592,381.02	134,592,381.02
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,277,310.86	1,277,310.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,497,131.82	1,497,131.82
应付托管费	-	-	-	-	-	249,521.95	249,521.95
应付交易费用	-	-	-	-	-	994,734.01	994,734.01
其他负债	-	-	-	-	-	187,926.92	187,926.92
负债总计	-	-	-	-	-	-138,799,006.58	138,799,006.58

利率敏感度缺口	611,700,205.15	-	-	-	-599,647,300.930	1,211,347,506.08
---------	----------------	---	---	---	------------------	------------------

注：1、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。

2、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度末可比数据。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。本基金持有部分以非记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

截至 2016 年 12 月 31 日，以外币计价的资产中，资产公允价值合计 183,546,456.93 元人民币，负债合计 0 元，资产负债表外汇风险敞口净额为 183,546,456.93 元人民币。

外汇风险的敏感性分析：假设除汇率外其他市场变量保持不变，港币相对人民币升值 5%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额 9,177,322.8470 元人民币；港币相对人民币贬值 5%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额-9,177,322.8470 元人民币。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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证券涨跌趋势的影响，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	737,199,120.96	60.86
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	737,199,120.96	60.86

注：1、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度末可比数据。

7.4.13.4.3.2 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不变	
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 12 月 31 日）
	上升 5%	38,728,165.48
	下降 5%	-38,728,165.48

注：1、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。

2、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度末可比数据。

7.4.13.4.4 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 (单位：人民币元)	本期末（2016 年 12 月 31 日）
	1 天	17,698,728.47
	1 周	39,575,559.97

注：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度末可比数据。

7.4.14 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 12 月 31 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 736,802,810.36 元，第二层次的余额为 396,310.60 元，无属于第三层次的余额。本基金合同生效日为 2016 年 7 月 11 日，无上年度末可比数据。

(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 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	737,199,120.96	54.60
	其中：股票	737,199,120.96	54.60
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	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	383,000,000.00	28.37
	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	226,731,191.02	16.79
7	其他各项资产	3,216,200.68	0.24
8	合计	1,350,146,512.66	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 183,546,456.93 元人民币，占期末基金资产净值比例 15.15%。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	535,704,129.10	44.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,705,917.66	0.22
E	建筑业	118,924.74	0.01
F	批发和零售业	4,725.01	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	293,486.70	0.02
J	金融业	293,262.14	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,522,760.00	1.20
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	553,652,664.03	45.71
----	----------------	-------

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
B 消费者非必需品	103,107,215.82	8.51
E 金融	30,252,328.20	2.50
F 医疗保健	8,497,845.00	0.70
G 工业	6,749,077.95	0.56
J 公用事业	34,939,989.96	2.88
合计	183,546,456.93	15.15

注：以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

8.3 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	002415	海康威视	3,299,251	78,555,166.31	6.48
2	000333	美的集团	2,217,696	62,472,496.32	5.16
3	600887	伊利股份	3,184,800	56,052,480.00	4.63
4	0175	吉利汽车	8,370,000	55,479,030.87	4.58
5	600519	贵州茅台	160,853	53,749,029.95	4.44
6	2020	安踏体育	2,300,000	47,628,184.95	3.93
7	600196	复星医药	1,949,812	45,118,649.68	3.72
8	601012	隆基股份	3,199,934	42,847,116.26	3.54
9	600660	福耀玻璃	1,633,217	30,426,832.71	2.51
10	1336	新华保险	950,000	30,252,328.20	2.50
11	600426	华鲁恒升	2,167,306	28,716,804.50	2.37
12	002311	海大集团	1,673,897	25,192,149.85	2.08
13	0371	北控水务集团	5,128,000	23,669,163.96	1.95
14	600276	恒瑞医药	414,861	18,876,175.50	1.56
15	603899	晨光文具	1,013,963	18,454,126.60	1.52
16	603001	奥康国际	778,328	17,823,711.20	1.47
17	600005	宝钢股份	5,000,000	17,050,000.00	1.41
18	300058	蓝色光标	1,428,000	14,522,760.00	1.20
19	002475	立讯精密	646,431	13,413,443.25	1.11
20	0958	华能新能源	5,000,000	11,270,826.00	0.93
21	600486	扬农化工	277,600	10,512,712.00	0.87

22	02196	复星医药	400,000	8,497,845.00	0.70
23	2128	中国联塑	1,500,000	6,749,077.95	0.56
24	000039	中集集团	300,000	4,386,000.00	0.36
25	601717	郑煤机	500,000	3,515,000.00	0.29
26	002470	金正大	400,000	3,160,000.00	0.26
27	600886	国投电力	400,000	2,668,000.00	0.22
28	600600	青岛啤酒	79,700	2,346,368.00	0.19
29	300408	三环集团	91,400	1,451,432.00	0.12
30	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.02
31	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.01
32	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
33	603098	森特股份	4,293	103,332.51	0.01
34	603323	吴江银行	6,475	100,103.50	0.01
35	300570	太辰光	1,810	100,093.00	0.01
36	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
37	002820	桂发祥	1,772	86,934.32	0.01
38	600926	杭州银行	4,085	85,580.75	0.01
39	603928	兴业股份	2,670	74,359.50	0.01
40	603585	苏利股份	1,041	72,578.52	0.01
41	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
42	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.01
43	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
44	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
45	603228	景旺电子	2,701	62,555.16	0.01
46	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	0.01
47	603033	三维股份	1,160	59,821.20	0.00
48	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.00
49	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
50	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.00
51	603559	中通国脉	899	48,447.11	0.00
52	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
53	603389	亚振家具	1,963	47,327.93	0.00
54	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
55	603319	湘油泵	721	40,736.50	0.00
56	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.00
57	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
58	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
59	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
60	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00

61	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
62	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
63	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
64	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
65	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
66	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
67	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
68	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
69	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
70	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
71	603777	来伊份	89	4,725.01	0.00
72	603816	顾家家居	83	3,929.22	0.00
73	603421	鼎信通讯	83	3,347.39	0.00
74	600908	无锡银行	73	797.89	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	83,250,868.66	6.87
2	601318	中国平安	75,458,966.90	6.23
3	600519	贵州茅台	62,808,131.43	5.18
4	000333	美的集团	62,412,636.93	5.15
5	600887	伊利股份	58,194,829.36	4.80
6	0175	吉利汽车	54,614,160.97	4.51
7	601012	隆基股份	47,557,577.63	3.93
8	600196	复星医药	45,124,900.41	3.73
9	2020	安踏体育	44,226,221.82	3.65
10	600486	扬农化工	31,253,159.03	2.58
11	1336	新华保险	30,190,302.60	2.49
12	600030	中信证券	27,438,208.90	2.27
13	600660	福耀玻璃	26,663,779.04	2.20
14	002311	海大集团	25,351,483.68	2.09
15	002475	立讯精密	23,124,707.29	1.91
16	0371	北控水务集团	23,104,732.50	1.91

17	600426	华鲁恒升	21,237,324.15	1.75
18	600104	上汽集团	20,274,948.99	1.67
19	601169	北京银行	19,662,885.00	1.62
20	603899	晨光文具	19,100,160.63	1.58

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	77,697,384.59	6.41
2	600030	中信证券	27,820,112.71	2.30
3	600486	扬农化工	25,209,097.82	2.08
4	601169	北京银行	20,230,469.63	1.67
5	600104	上汽集团	19,260,478.53	1.59
6	001979	招商蛇口	16,897,210.79	1.39
7	600409	三友化工	15,999,288.89	1.32
8	002400	省广股份	15,833,931.40	1.31
9	000651	格力电器	15,774,692.25	1.30
10	600066	宇通客车	14,648,694.52	1.21
11	002475	立讯精密	14,327,236.31	1.18
12	600519	贵州茅台	13,080,972.26	1.08
13	600267	海正药业	12,966,850.82	1.07
14	600362	江西铜业	12,244,542.00	1.01
15	000338	潍柴动力	9,531,188.00	0.79
16	600297	广汇汽车	9,355,700.00	0.77
17	000002	万科A	8,461,605.00	0.70
18	600993	马应龙	7,990,290.06	0.66
19	601933	永辉超市	7,554,970.00	0.62
20	600271	航天信息	7,118,933.65	0.59

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。

8.4.3 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	1,101,482,605.97
卖出股票收入（成交）总额	392,745,968.28

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。

8.5 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。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行股指期货投资。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2 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	1,969,014.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	320,398.20
5	应收申购款	926,788.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,216,200.68

8.12.3 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。

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
7,782	151,190.59	322,380,028.80	27.40%	854,185,169.35	72.60%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,635,678.27	0.1390%

9.3 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年7月11日）基金份额总额	771,371,084.49
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	541,163,556.07
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	135,969,442.41
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,176,565,198.15

注：总申购份额含红利再投份额（本基金暂未开通基金转换业务）。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

本基金管理人于2016年7月29日发布公告，自2016年7月28日起任命陈光明同志担任基

金管理人董事长。

本基金管理人于 2016 年 7 月 29 日发布公告，自 2016 年 7 月 28 日起任命任莉同志担任基金管理人总经理。

本基金管理人于 2016 年 9 月 20 日发布公告，自 2016 年 9 月 19 日起任命卢强同志担任基金管理人副总经理。

本基金管理人于 2016 年 9 月 19 日发布公告，本基金管理人法定代表人变更为陈光明先生。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

11.5 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。本基金本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 8.5 万元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	1,133,746,482.25	76.07%	843,599.67	76.38%	-
中信建投	1	356,731,648.23	23.93%	260,880.01	23.62%	-

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，此事已向中国证监会报告，并等待进一步指示与解决；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、本基金合同于 2016 年 7 月 11 日生效，上表所列示券商交易单元均为本报告期内新增。

11.7.2 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	-	-	8,975,500,000.00	100%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 12 日
2	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售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、证券日报、公司网站	2016 年 7 月 14 日
3	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在上海好买基	中国证券报、上海证券报、证券时报、公	2016 年 7 月 22 日

	金销售有限公司开展定投业务起点金额的更正公告	司网站	
4	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（总经理）	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 29 日
5	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告（董事长）	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 7 月 29 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 9 月 19 日
7	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 9 月 20 日
8	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构并开通定投的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 27 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金在部分渠道开通定投及参加基金网上交易申购、定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 27 日
10	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 27 日
11	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金关于非港股通交易日	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 27 日

	暂停申购、赎回等业务的公告		
12	关于东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金主要投资市场节假日暂停申购（含定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 28 日
13	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 10 月 11 日
14	上海东方证券资产管理有限公司关于直销机构开展东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 12 日
15	关于东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2016 年 10 月 21 日（非港股通交易日）暂停申购（含定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 22 日
16	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 26 日
17	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金在部分渠道开通定投及参加基金网上交易申购、定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 28 日
18	上海东方证券资产管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 11 月 11 日
19	上海东方证券资产管理有限公司	中国证券报、上海证	2016 年 11 月 18 日

	关于旗下部分开放式基金参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	券报、证券日报、公司网站	
20	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金在工商银行开通定投及参加基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 8 日
21	上海东方证券资产管理有限公司关于调整旗下基金最低持有份额计算口径的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 12 月 15 日
22	关于东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金主要投资市场节假日暂停申购（含定期定额投资）、赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 23 日
23	东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金关于非港股通交易日暂停申购（含定期定额投资）、赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 28 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 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。

12.3 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
2017 年 3 月 30 日