

---

东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证  
券投资基金  
2017 年半年度报告

2017 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 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>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
<b>§5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18

6.4 报表附注.....	19
<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.....	38
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.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
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
<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>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
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.....	49
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
11.1 备查文件目录.....	52

11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东方红优享红利混合
基金主代码	003396
前端交易代码	003396
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 10 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,338,542,598.05 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于现金股息率高、分红稳定的优质上市公司，通过上市公司的高比例分红收益，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用定量和定性相结合的方式，通过大类资产配置、红利证券筛选，精选股息率高、分红稳定的优质公司作为本基金的主要投资对象。在中国经济增长模式转型的大背景下，红利策略为证券提供了高安全边际，同时在震荡市中具有较高的防御性。本基金重点关注具有良好盈利能力和持续成长能力的红利型股票，通过构建证券基础库、精选证券，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×60% +恒生指数收益率×20% + 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。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	招商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	唐涵颖	张燕
	联系电话	021-63325888	0755-83199084
	电子邮箱	service@dfham.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	4009200808	95555	
传真	021-63326981	0755-83195201	
注册地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦	
办公地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦	
邮政编码	200010	518040	
法定代表人	陈光明	李建红	

## 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 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
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	63,755,570.80
本期利润	404,042,456.17
加权平均基金份额本期利润	0.2481
本期加权平均净值利润率	22.64%
本期基金份额净值增长率	22.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	75,517,538.05
期末可供分配基金份额利润	0.0323
期末基金资产净值	2,851,701,519.77
期末基金份额净值	1.2194
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	21.94%

注：1、本基金合同于 2016 年 10 月 31 日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一年。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2017 年 6 月 30 日；“本期”指 2017 年 1 月 1 日-2017 年 6 月 30 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
过去一个月	7.69%	0.81%	2.87%	0.46%	4.82%	0.35%
过去三个月	12.71%	0.61%	3.99%	0.44%	8.72%	0.17%
过去六个月	22.99%	0.54%	10.03%	0.42%	12.96%	0.12%
自基金合同生效起至今	21.94%	0.52%	8.71%	0.47%	13.23%	0.05%

注：自基金合同生效日起至今指 2016 年 10 月 31 日-2017 年 6 月 30 日。

根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准=中证红利指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+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：

$$benchmark_t = 60\% * [t \text{ 日中证红利指数} / (t-1 \text{ 日中证红利指数}) - 1] + 20\% * [t \text{ 日恒生指数} / (t-1 \text{ 日恒生指数}) - 1] + 20\% * [t \text{ 日中国债券总指数} / (t-1 \text{ 日中国债券总指数}) - 1];$$

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 2017 年 6 月 30 日。

2、本基金合同于 2016 年 10 月 31 日生效，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

3、本基金建仓期 6 个月，即从 2016 年 10 月 31 日起至 2017 年 4 月 30 日，建仓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 2017 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、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、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金二十七只证券投资基金。

#### 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	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	2016 年 10 月 31 日	-	8 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；现任东方红睿元混

	金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。			合、东方红优势精选混合、东方红睿轩沪港深混合、东方红优享红利混合基金经理。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。

## 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》的规定。

### 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

2017 年上半年 A 股市场结构性的行情依然非常明显，在整体市场风险偏好下降的情况下，市场的存量资金仍然在向估值相对较低的龙头公司倾斜；另一个层面，增量资金主要来自于通过沪港通深港通北上的海外资金，这些资金一向比较青睐有竞争力的低估值龙头企业，导致市场的盘面分化更加加剧，市场的结构化行情一度引发了漂亮 50 的广泛讨论。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2194 元，份额累计净值为 1.2194 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 22.99%，同期业绩比较基准收益率为 10.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为年内市场或将仍以震荡消化泡沫为主，市场还是以结构性机会为主。下半年继续看好具有较好稳定性和高分红低估值的优质龙头企业，如消费龙头、医药创新与医药服务龙头和供给侧收缩有效的部分周期品龙头，同时，也看好高端精密制造的产业集群和国产汽车实现跨越中的投资机会。同时继续看好港股的龙头公司的历史性机会。随着国内市场经济的不断发展和产业链的升级，相信会有更多的投资机会被发掘。

我们仍将追随社会发展的大趋势而选择收益的品种，选择优秀的公司，期望给投资者带来回报。

#### 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，公司设估值决策委员会，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。

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

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%；

3、若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

4、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；

5、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；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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**

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——招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

本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	626,139,181.68	191,440,658.53
结算备付金		20,881,128.77	12,456,518.61
存出保证金		1,190,661.20	837,872.95
交易性金融资产	6.4.7.2	2,220,647,070.58	488,205,786.92
其中：股票投资		2,220,647,070.58	488,205,786.92
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	292,300,000.00
应收证券清算款		-	219,788.98
应收利息	6.4.7.5	154,372.51	247,423.77
应收股利		1,365,689.42	-
应收申购款		23,808,197.95	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,894,186,302.11	985,708,049.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		-	-
应付证券清算款		14,180,798.32	2,934,674.54
应付赎回款		22,567,544.26	-
应付管理人报酬		3,236,762.00	1,251,607.70
应付托管费		539,460.33	208,601.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,772,703.15	456,684.37
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	187,514.28	130,000.00
负债合计		42,484,782.34	4,981,567.90
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,338,542,598.05	989,179,597.10
未分配利润	6.4.7.10	513,158,921.72	-8,453,115.24
所有者权益合计		2,851,701,519.77	980,726,481.86
负债和所有者权益总计		2,894,186,302.11	985,708,049.76

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2194 元，基金份额总额 2,338,542,598.05 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		422,143,258.15
1.利息收入		4,187,874.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,940,790.74
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		2,247,083.63
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		76,756,786.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	48,327,595.46
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	28,429,191.24
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	340,286,885.37
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	911,711.71
<b>减：二、费用</b>		18,100,801.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,091,524.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,181,920.73



基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金(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”)《关于准予东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金的注册的批复》(证监许可[2016]1258)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《东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2016年10月31日生效。本基金为契约型开放式基金,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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金于2016年10月24日向社会公开募集,并于2016年10月24日提前结束募集,扣除认购费后的有效认购资金989,089,780.91元,利息结转份额89,816.19元,募集规模为989,179,597.10份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红优享红利沪港深灵活配置混合型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,包括国内依法发行的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、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、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。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%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%);本基金投资于红利型证券不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货和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:中证红利指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中国债券总指数收益率×20%。

## 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 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。

## 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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。

## 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[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。基金通过港股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。基金通过港股通买卖、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。

#### 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	626,139,181.68
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	626,139,181.68

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,889,349,774.87	2,220,647,070.58	331,297,295.71
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	1,889,349,774.87	2,220,647,070.58	331,297,295.71

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	145,402.45
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	7,642.55
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	150.73
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,176.78
合计	154,372.51

### 6.4.7.6 其他资产

本基金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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,772,703.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,772,703.15

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	48,665.56
预提费用	138,848.72
合计	187,514.28

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	989,179,597.10	989,179,597.10
本期申购	1,641,468,193.19	1,641,468,193.19
本期赎回(以“-”号填列)	-292,105,192.24	-292,105,192.24
本期末	2,338,542,598.05	2,338,542,598.05

注：申购份额含红利再投份额（本基金暂未开通基金转换业务）。

### 6.4.7.10 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
上年度末	536,474.42	-8,989,589.66	-8,453,115.24
本期利润	63,755,570.80	340,286,885.37	404,042,456.17
本期基金份额交易产生的变动数	11,225,492.83	106,344,087.96	117,569,580.79
其中：基金申购款	15,857,360.49	138,975,964.30	154,833,324.79
基金赎回款	-4,631,867.66	-32,631,876.34	-37,263,744.00
本期已分配利润	-	-	-

本期末	75,517,538.05	437,641,383.67	513,158,921.72
-----	---------------	----------------	----------------

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	1,803,503.88
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	131,439.45
其他	5,847.41
合计	1,940,790.74

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	455,383,412.44
减：卖出股票成本总额	407,055,816.98
买卖股票差价收入	48,327,595.46

#### 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

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 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。

##### 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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	28,429,191.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	28,429,191.24

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	340,286,885.37
——股票投资	340,286,885.37
——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	340,286,885.37

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	911,711.71
合计	911,711.71

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	2,627,314.80
银行间市场交易费用	-
合计	2,627,314.80

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	99,177.14
律师费	45,000.00
银行费用	1,193.42
持有人大会费用	15,000.00
合计	200,042.14

## 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券	1,547,240,583.38	68.75%

注：本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未进行债券交易。本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30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	8,177,700,000.00	100.00%

注：本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.4 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。本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30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	1,154,799.24	69.78%	1,494,817.24	84.32%

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、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。

3、本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,091,524.31
其中：支付销售机构的客户维护费	7,208,449.89

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。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、本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2, 181, 920. 73

注：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。

本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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

基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

##### 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	626, 139, 181. 68	1, 803, 503. 88

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期参与关联方承销的证券。本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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。本基金于 2016 年 10 月 31 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（ 2017 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-

300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

#### 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 2017 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 2017 年 6 月 30 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。

#### 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。

### 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。本基金投资于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

本基金本报告期末未持有债券

#### 6.4.13.2.2 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债券

### 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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

### 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持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、存出保证金及买入返售金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月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	626,139,181.68	-	-	-	-	-	626,139,181.68
结算备付金	20,881,128.77	-	-	-	-	-	20,881,128.77
存出保证金	1,190,661.20	-	-	-	-	-	1,190,661.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,220,647,070.58	-2,220,647,070.58
应收利息	-	-	-	-	-	154,372.51	154,372.51
应收股利	-	-	-	-	-	1,365,689.42	1,365,689.42
应收申购款	159,870.38	-	-	-	-	23,648,327.57	23,808,197.95
资产总计	648,370,842.03	-	-	-	-	-2,245,815,460.08	2,894,186,302.11
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14,180,798.32	14,180,798.32
应付赎回款	-	-	-	-	-	22,567,544.26	22,567,544.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,236,762.00	3,236,762.00
应付托管费	-	-	-	-	-	539,460.33	539,460.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,772,703.15	1,772,703.15
其他负债	-	-	-	-	-	187,514.28	187,514.28
负债总计	-	-	-	-	-	42,484,782.34	42,484,782.34
利率敏感度缺口	648,370,842.03	-	-	-	-	-2,203,330,677.74	2,851,701,519.77
上年度末 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	191,440,658.53	-	-	-	-	-	191,440,658.53
结算备付金	12,456,518.61	-	-	-	-	-	12,456,518.61
存出保证金	837,872.95	-	-	-	-	-	837,872.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	488,205,786.92	488,205,786.92
买入返售金融资	292,300,000.00	-	-	-	-	-	292,300,000.00

产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	219,788.98	219,788.98
应收利息	-	-	-	-	-	247,423.77	247,423.77
资产总计	497,035,050.09	-	-	-	-	488,672,999.67	985,708,049.76
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,934,674.54	2,934,674.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,251,607.70	1,251,607.70
应付托管费	-	-	-	-	-	208,601.29	208,601.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	456,684.37	456,684.37
其他负债	-	-	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	4,981,567.90	4,981,567.90
利率敏感度缺口	497,035,050.09	-	-	-	-	483,691,431.77	980,726,481.86

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇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，因此存在一定的外汇风险。

外汇风险敞口：截至 2017 年 6 月 30 日，以港币计价的资产中，资产公允价值合计 422,587,245.00 元人民币，负债合计 0 元人民币，资产负债表外汇风险敞口净额为 422,587,245.00 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，截至 2017 年 6 月 30 日，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为 21,129,362.25 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- 21,129,362.25 元人民币。假设除汇率外其他市场变量保持不变，截至 2016 年 12 月 31 日，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为 3,550,281.00 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-3,550,281.00 元人民币。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,220,647,070.58	77.87	488,205,786.92	49.78
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	2,220,647,070.58	77.87	488,205,786.92	49.78

#### 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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	上升 5%	109,854,806.56	25,785,998.94
	下降 5%	-109,854,806.56	-25,785,998.94

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。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

-			
假设	1. 置信区间 百分之九十五		
	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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1 天	24,510,760.20	14,679,525.86
	1 周	54,807,725.98	32,824,417.69

#### 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 2017 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 2,220,523,387.48 元，属于第二层次的余额为 123,683.10 元，无属于第三层次的余额。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 487,831,130.92 元，属于第二层次的余额为 374,656.00 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 2017 年 6 月 30 日及 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	2,220,647,070.58	76.73
	其中：股票	2,220,647,070.58	76.73
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	-	-
	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	647,020,310.45	22.36
7	其他各项资产	26,518,921.08	0.92
8	合计	2,894,186,302.11	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 422,587,245.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 14.82%。

### 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	86,108,861.50	3.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,303,039,348.89	45.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,778.24	0.00
F	批发和零售业	51,432,587.90	1.80
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	69,748,780.39	2.45
J	金融业	250,021,168.42	8.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	37,670,300.24	1.32
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	1,798,059,825.58	63.05

### 7.2.2 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（%）
A 基础材料	21,898,240.00	0.77
B 消费者非必需品	266,967,320.00	9.36
C 消费者常用品	24,807,475.00	0.87
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	67,602,170.00	2.37
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	41,312,040.00	1.45
合计	422,587,245.00	14.82

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

### 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	600887	伊利股份	12,892,112	278,340,698.08	9.76
2	00175	吉利汽车	14,300,000	209,066,000.00	7.33
3	601318	中国平安	2,825,013	140,148,894.93	4.91
4	000333	美的集团	3,184,739	137,071,166.56	4.81
5	600066	宇通客车	5,984,754	131,485,045.38	4.61
6	002415	海康威视	3,171,975	102,454,792.50	3.59
7	002475	立讯精密	3,502,646	102,417,369.04	3.59
8	600104	上汽集团	3,148,447	97,759,279.35	3.43
9	600703	三安光电	4,764,533	93,861,300.10	3.29
10	002041	登海种业	6,498,782	86,108,861.50	3.02
11	000895	双汇发展	3,125,731	74,236,111.25	2.60
12	002311	海大集团	3,192,111	58,319,867.97	2.05

13	000651	格力电器	1,380,000	56,814,600.00	1.99
14	601398	工商银行	10,521,400	55,237,350.00	1.94
15	600030	中信证券	3,199,000	54,446,980.00	1.91
16	300408	三环集团	2,122,300	44,547,077.00	1.56
17	300166	东方国信	3,191,279	42,858,876.97	1.50
18	002202	金风科技	2,691,165	41,632,322.55	1.46
19	00371	北控水务集团	7,854,000	41,312,040.00	1.45
20	02869	绿城服务	10,000,000	37,100,000.00	1.30
21	02020	安踏体育	1,420,000	31,793,800.00	1.11
22	600600	青岛啤酒	888,900	31,200,390.00	1.09
23	300058	蓝色光标	3,759,132	29,396,412.24	1.03
24	600693	东百集团	2,192,530	27,011,969.60	0.95
25	002439	启明星辰	1,445,283	26,882,263.80	0.94
26	002470	金正大	3,567,407	26,862,574.71	0.94
27	01999	敏华控股	4,294,000	26,107,520.00	0.92
28	600271	航天信息	1,241,793	25,630,607.52	0.90
29	01112	合生元	1,446,500	24,807,475.00	0.87
30	600297	广汇汽车	3,243,110	24,420,618.30	0.86
31	02899	紫金矿业	9,776,000	21,898,240.00	0.77
32	02128	中国联塑	2,977,000	15,510,170.00	0.54
33	01919	中远海控	4,685,000	14,992,000.00	0.53
34	002027	分众传媒	601,300	8,273,888.00	0.29
35	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
36	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
37	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
38	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
39	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
40	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
41	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
42	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
43	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
44	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
45	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
46	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
47	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
48	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
49	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
50	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00

51	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
52	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
53	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
54	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
55	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	600887	伊利股份	232,079,397.03	23.66
2	601318	中国平安	121,098,319.99	12.35
3	00175	吉利汽车	118,829,788.75	12.12
4	601939	建设银行	118,229,910.11	12.06
5	600066	宇通客车	93,151,603.46	9.50
6	002041	登海种业	77,073,996.70	7.86
7	002475	立讯精密	71,545,027.38	7.30
8	600104	上汽集团	71,183,987.10	7.26
9	000333	美的集团	58,552,884.67	5.97
10	600030	中信证券	55,233,999.02	5.63
11	601398	工商银行	53,894,886.00	5.50
12	000895	双汇发展	52,952,720.78	5.40
13	300408	三环集团	44,157,429.01	4.50
14	300166	东方国信	41,060,809.86	4.19
15	02869	绿城服务	36,018,968.17	3.67
16	600703	三安光电	30,570,907.62	3.12
17	300058	蓝色光标	30,200,343.46	3.08
18	600196	复星医药	29,975,935.48	3.06
19	600600	青岛啤酒	29,555,980.00	3.01
20	002415	海康威视	28,391,800.15	2.89
21	002439	启明星辰	27,664,406.46	2.82
22	02020	安踏体育	27,581,616.13	2.81
23	002470	金正大	26,277,169.66	2.68
24	000651	格力电器	25,737,981.57	2.62

25	02899	紫金矿业	25,578,466.34	2.61
26	002311	海大集团	25,375,808.57	2.59
27	01999	敏华控股	25,182,930.77	2.57
28	600271	航天信息	24,035,724.88	2.45
29	600297	广汇汽车	23,144,669.00	2.36
30	00371	北控水务集团	20,949,773.23	2.14
31	01112	H & H国际控股	20,890,583.29	2.13

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	601939	建设银行	122,488,595.57	12.49
2	600104	上汽集团	44,462,021.33	4.53
3	600196	复星医药	34,736,191.38	3.54
4	001979	招商蛇口	33,926,357.27	3.46
5	00175	吉利汽车	26,330,825.04	2.68
6	601318	中国平安	19,520,222.42	1.99
7	600660	福耀玻璃	18,908,439.54	1.93
8	000625	长安汽车	18,065,774.72	1.84
9	600887	伊利股份	18,000,362.61	1.84
10	002714	牧原股份	17,168,307.16	1.75
11	000983	西山煤电	16,323,872.67	1.66
12	000997	新大陆	16,226,753.96	1.65
13	00958	华能新能源	13,691,578.37	1.40
14	002415	海康威视	13,015,384.77	1.33
15	601888	中国国旅	10,488,258.65	1.07
16	600886	国投电力	7,397,556.00	0.75
17	600466	蓝光发展	6,967,270.00	0.71
18	000786	北新建材	2,362,897.94	0.24
19	002041	登海种业	1,484,140.00	0.15
20	601881	中国银河	541,128.37	0.06

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	1,799,210,215.27
卖出股票收入（成交）总额	455,383,412.44

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券

### 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。

### 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	1,190,661.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,365,689.42
4	应收利息	154,372.51
5	应收申购款	23,808,197.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,518,921.08

#### 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债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末前十名股票中不存在流通受限情况

#### 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

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
31,973	73,141.17	0.00	0.00%	2,338,542,598.05	100.00%

### 8.2 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	57,969.55	0.0025%

### 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 10 月 31 日 ）基金份额总额	989,179,597.10
本报告期期初基金份额总额	989,179,597.10
本报告期基金总申购份额	1,641,468,193.19
减：本报告期基金总赎回份额	292,105,192.24
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,338,542,598.05

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）。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议了《关于东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金调整基金投资范围的议案》。大会表决投票时间自 2017 年 5 月 10 日起，至 2017 年 6 月 15 日 17:00 时止。

本次基金份额持有人大会通过了《关于东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金调整基金投资范围的议案》，2017 年 6 月 19 日起生效。基金管理人已按照有关规定将表决通过的事项报中国证券监督管理委员会备案。

### 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

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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普华永道中天会计师事务所（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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元数量	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	备注
东方证券	2	1,547,240,583.38	68.75%	1,154,799.24	69.78%	-
光大证券	1	375,923,056.71	16.70%	267,394.45	16.16%	-
华创证券	1	327,334,128.87	14.54%	232,833.51	14.07%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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 10 月 31 日生效，本期新增光大证券深圳席位 1 个、招商证券深圳席位 1 个。

**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	-	-	8,177,700,000.00	100.00%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 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旗下基金 2016 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、证券日报和公司网站	2017 年 1 月 3 日
2	东方红优享红利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、上海证券报和公司网站	2017 年 1 月 18 日
3	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金在招商银行开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 1 月 18 日
4	东方红优享红利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、上海证券报和公司网站	2017 年 1 月 19 日
5	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 1 月 20 日
6	关于东方红优享红利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、上海证券报和公司网站	2017 年 1 月 23 日
7	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金增加东方证券股份有限公司为代理销售机构并开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 1 月 25 日
8	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 2 月 17 日
9	关于东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金增加上海东方证券资产管理有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 3 月 20 日
10	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 3 月 22 日
11	关于东方红优享红利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、上海证券报和公司网站	2017 年 3 月 28 日
12	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告	公司网站	2017 年 3 月 30 日

13	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	上海证券报和公司网站	2017 年 3 月 30 日
14	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	中国证券报	2017 年 3 月 31 日
15	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红优享红利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、上海证券报和公司网站	2017 年 3 月 31 日
16	关于东方红优享红利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、上海证券报和公司网站	2017 年 4 月 13 日
17	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额申购）业务的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 4 月 20 日
18	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 4 月 21 日
19	关于东方红优享红利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、上海证券报和公司网站	2017 年 4 月 27 日
20	关于召开东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 5 月 3 日
21	关于召开东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 5 月 4 日
22	关于召开东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 5 月 5 日
23	上海东方证券资产管理有限公司关于开通网上直销平台基金定投业务及开展基金定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站	2017 年 5 月 10 日
24	关于东方红优享红利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、上海证券报和公司网站	2017 年 5 月 23 日
25	关于召开东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的补充公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 5 月 31 日
26	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 6 月 8 日

27	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）	公司网站	2017 年 6 月 8 日
28	关于东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人可授权招商银行参与持有人大会的补充公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 6 月 12 日
29	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 6 月 21 日
30	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同	公司网站	2017 年 6 月 21 日
31	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2017 年 6 月 21 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红优享红利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。

### 11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市中山南路 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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2017 年 8 月 28 日