

东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金
2018 年半年度报告
(摘要)

2018 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

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。本半年度报告由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金简称 | 东方红战略精选混合 | |
| 基金主代码 | 003044 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 8 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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 749,471,072.07 份 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 东方红战略精选混合 A | 东方红战略精选混合 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 003044 | 003045 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 693,470,750.63 份 | 56,000,321.44 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求资产净值的长期稳健增值。 |
| 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 | 中债综合指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+沪深 300 指数收益率×10%。 |
| 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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 任莉 |
| | 联系电话 | 021-63325888 |
| | 电子邮箱 | service@dfham.com |
| 客户服务电话 | 4009200808 | 95528 |
| 传真 | 021-63326981 | 021-63602540 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|------------------------------------------------------------------------|
| 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 上海浦东发展银行股份有限公司 上海市中山东一路 12 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 | 东方红战略精选混合 A | 东方红战略精选混合 C |
|---------------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018 年 1 月 1 日- 2018 年 6 月 30 日) | 报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 7,670,382.57 | 463,714.71 |
| 本期利润 | -7,317,308.98 | -662,802.26 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0088 | -0.0101 |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.33% | -1.54% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018 年 6 月 30 日) | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0375 | 0.0293 |
| 期末基金资产净值 | 719,499,084.27 | 57,643,929.13 |
| 期末基金份额净值 | 1.0375 | 1.0293 |

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日；“本期”指 2018 年 1 月 1 日 - 2018 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，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

东方红战略精选混合 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 | -1.68% | 0.55% | -1.00% | 0.23% | -0.68% | 0.32% |
| 过去三个月 | -1.87% | 0.48% | -0.56% | 0.22% | -1.31% | 0.26% |
| 过去六个月 | -1.33% | 0.49% | 0.14% | 0.22% | -1.47% | 0.27% |
| 过去一年 | 4.27% | 0.39% | 1.61% | 0.18% | 2.66% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.77% | 0.32% | 0.38% | 0.17% | 8.39% | 0.15% |

东方红战略精选混合 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 | -1.71% | 0.55% | -1.00% | 0.23% | -0.71% | 0.32% |
| 过去三个月 | -1.98% | 0.48% | -0.56% | 0.22% | -1.42% | 0.26% |
| 过去六个月 | -1.54% | 0.49% | 0.14% | 0.22% | -1.68% | 0.27% |
| 过去一年 | 3.83% | 0.39% | 1.61% | 0.18% | 2.22% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.93% | 0.32% | 0.38% | 0.17% | 7.55% | 0.15% |

注：1、本基金合同于 2016 年 8 月 30 日生效。

2、自基金合同生效日起至今指 2016 年 8 月 30 日-2018 年 6 月 30 日。

3、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=中债综合指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+沪深 300 指数收益率×10%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中国债券总指数。

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：

$$\text{benchmark}_t = 80\% * [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 10\% * [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1}$$

日恒生指数)-1] +10%* [t 日中国债券总指数/(t-1 日中国债券总指数)-1];

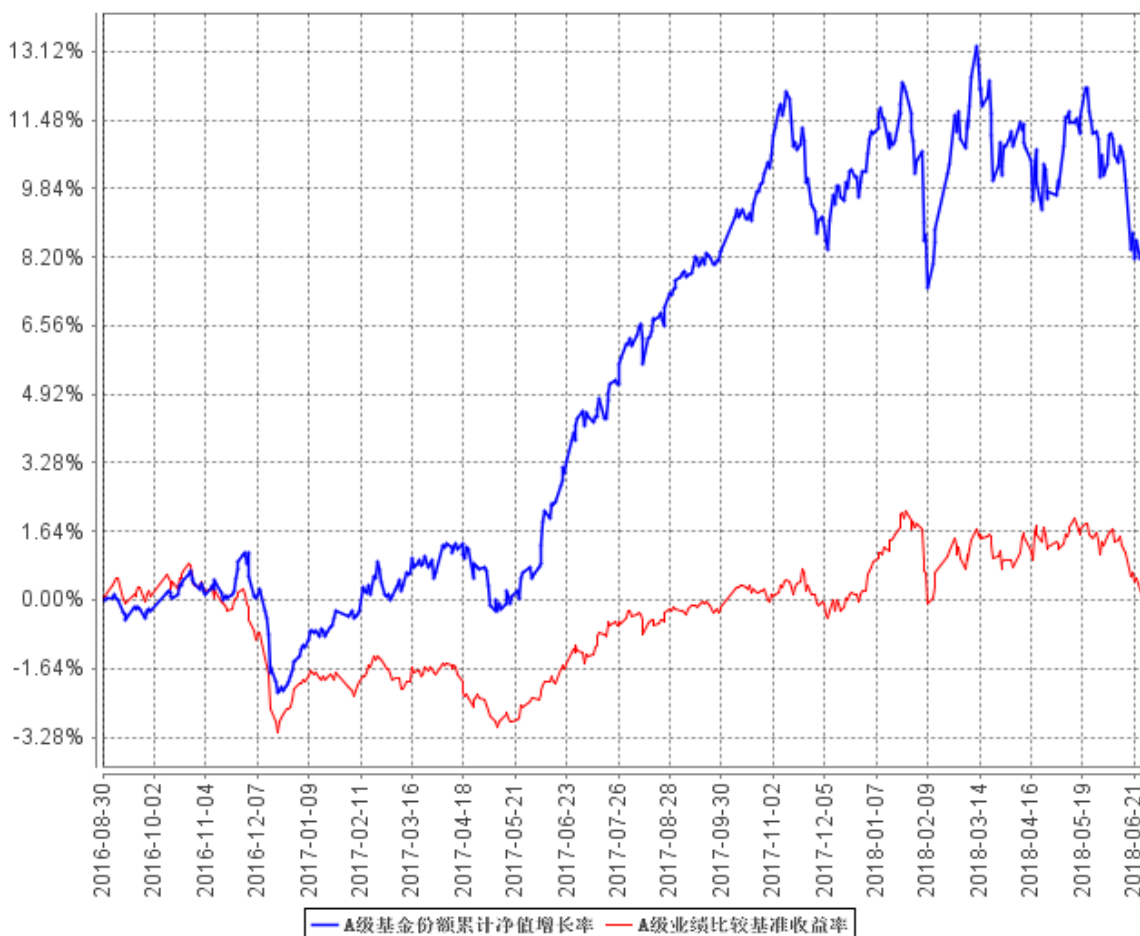
其中, t=1,2,3,... T, T 表示时间截至日;

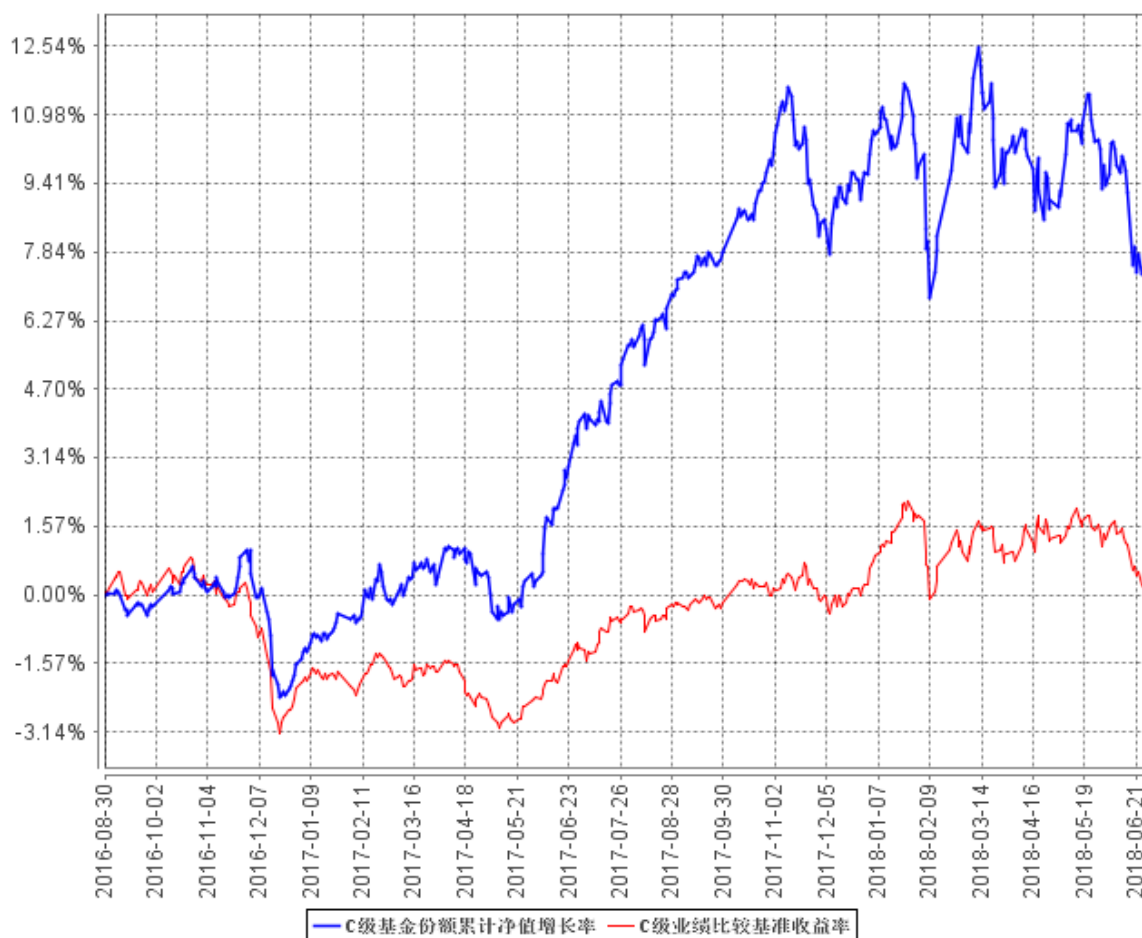
t 日至 T 日的期间收益率 (benchmarkT) 按下列公式计算:

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

其中, T=2,3,4,...; $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 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：截止日期为 2018 年 6 月 30 日。

§ 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 2018 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（LOF）、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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 6 个月定期开放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、东方红策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、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金三十三只证券投资基金。

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 | | |
| 纪文静 | 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经理、兼任东方红领先精选混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券 | 2016 年 8 月 30 日 | - | 11 年 | 硕士，曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理，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；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经理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 6 个月定开纯债、东方红收益增强债券、东方红信用债债券、东方红稳添利纯债、东方红策略精选混合、东方红价值精选混合、东方红益鑫纯债债券、东方红智逸沪港深定开 |

| | | | | |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|------------------------------------|
| | <p>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 6 个月定期开放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、</p> | | | <p>混合、东方红货币基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|------------------------------------|

| | | | | | |
|-----|----------------------------------------------------------|------------------|-----------------|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 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、东方红货币市场基金基金经理。 | | | | |
| 李家春 | 上海东方证券资产管理有限公司执行董事、公募固定收益投资部总经理。 | 2016 年 10 月 18 日 | 2018 年 6 月 22 日 | 19 年 | 硕士，曾任长江证券有限责任公司债券基金事业部投资经理，汉唐证券有限责任公司债券业务管理总部投资主管，泰信基金管理有限公司投资管理部高级研究员、投资管理部副经理，交银施罗德基金管理公司固定收益部副总经理、基金经理，富国基金管理有限公司固定收益部投资副总监；现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事、公募固定收益投资部总经理。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

权益方面，2018 年上半年市场出现了一定幅度的调整，上证综指上半年下跌 13.9%，沪深 300 下跌 12.9%，创业板指下跌 8.33%。从行业表现来看，休闲服务、医药生物、食品饮料等几个防御性行业出现了正收益。通信、电气设备、机械设备、有色金属等部分行业出现比较大的跌幅。调整的原因来自多个方面：海外方面，伴随开年各个主要经济体经济数据的相对疲软，全球共振复苏的预期开始受到挑战，而贸易战的升温也给经济环境带来的更多的不确定性，对国内权益市场也产生了一定程度的负面影响；国内方面，信用收缩的环境带来了经济预期的下调，违约事件的增多也抑制了市场的风险偏好。本产品在个股选择上以业绩稳健增长且估值合理的优质龙头企业为主，包括消费品行业龙头、竞争优势突出的制造业龙头以及一些受益供给侧收缩的周期性行业龙头等。同时根据宏观环境变化对仓位和配置方向进行适度调整，以起到降低组合波动、提升夏普比例的组合优化作用。

债券方面，2018 年上半年经济下行压力逐步体现，中美贸易摩擦持续、信用违约事件不断。“宽货币、紧信用”的政策组合使得债券市场走出了结构性牛市行情：一方面宽松的资金面、基本面下滑的预期以及信用事件下投资者风险偏好的下降都促使利率债及高等级信用债收益率大幅

下行；另一方面企业再融资难度加大、投资者结构的变化都使得中低评级信用债信用利差大幅拉升。上半年 10 年国债收益率下行超 50BP，回落至 3.5% 以下，10 年国开收益率下行超 100BP，回落至 4.1% 以下。本产品债券配置上精选个券，有效防范信用风险，调整组合久期和杠杆，力争获取稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东方红战略精选混合 A 基金份额净值为 1.0375 元，份额累计净值 1.0875 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.33%；截至本报告期末东方红战略精选混合 C 基金份额净值为 1.0293 元，份额累计净值 1.0793 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.54%；同期业绩比较基准收益率为 0.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年上半年基建投资大幅下滑、社融数据大幅回落，叠加贸易战持续发酵，紧信用格局下经济下行压力显现。展望下半年，紧信用政策逐步有边际放松的迹象，社融及基建投资数据有望企稳，制造业投资预计仍能继续低位抬升，地产投资逐步下行。通胀方面，CPI 低位平稳，PPI 重回下行通道，整体通胀压力有限。

权益方面，展望下半年，我们仍然判断今年股票投资的不确定性仍然要高于去年，但一些积极的因素也在陆续出现。一方面经过上半年的调整，股票的估值水平更具吸引力；另一方面也要关注货币政策的边际变化，对权益市场开始有所支撑。我们仍然坚持价值投资理念，注重自下而上精选个股。主要关注估值合理、基本面稳健的消费类价值股；业绩高增长、估值合理的细分子行业的成长龙头；一些行业处于底部，有望出现反转的优质行业龙头公司；以及一些估值处于历史较低位置，业绩仍有保障的周期类优质龙头。

债券方面，我们认为下半年基本面及货币政策环境均较为有利，宽松的资金面以及较低的回购利率使得债券票息收益更为确定，因此下半年杠杆息差策略仍将可能为组合提供丰厚的回报。而长端利率债短期或因财政政策加码后经济数据回落不及预期出现小幅波动。虽信用紧缩环境有所放松，但监管趋势未变，操作上仍需精选个券，力争有效防范信用风险。

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》以及中国证监会于 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《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》和《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等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。基金管理人对外投资品种的估值程序及技术保持一致性原则，为确保估值程序和技术持续使用性，基金管理人建立了定期复核和审阅机制。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负责研究、指导和审议基金估值业务，成员包括：公司总经理、合规总监（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，保证基金估值的公平合理，保持估值政策和程序的一贯性。

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、本基金的同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取销售服务费情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

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同一类别的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某类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。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《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、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由上海东方证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 20,755,876.18 | 31,154,954.36 |
| 结算备付金 | 23,391,476.88 | 34,797,516.50 |
| 存出保证金 | 94,023.38 | 1,696,740.62 |
| 交易性金融资产 | 952,904,856.92 | 1,374,430,745.07 |
| 其中：股票投资 | 189,566,167.71 | 323,835,391.95 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 758,123,689.21 | 1,043,551,353.12 |
| 资产支持证券投资 | 5,215,000.00 | 7,044,000.00 |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 399,933.43 | 12,016,327.51 |
| 应收利息 | 11,404,933.78 | 13,980,378.90 |
| 应收股利 | 161,108.38 | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,009,112,208.95 | 1,468,076,662.96 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 227,500,000.00 | 325,206,000.00 |
| 应付证券清算款 | 11.56 | 3,936,639.23 |
| 应付赎回款 | 1,313,658.03 | 4,606,553.42 |
| 应付管理人报酬 | 460,885.52 | 679,638.94 |
| 应付托管费 | 131,681.57 | 194,182.55 |
| 应付销售服务费 | 19,472.99 | 32,342.43 |
| 应付交易费用 | 2,144,184.09 | 1,978,880.80 |
| 应交税费 | 47,921.69 | - |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 应付利息 | 202,614.39 | 12,026.67 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 148,765.71 | 301,951.54 |
| 负债合计 | 231,969,195.55 | 336,948,215.58 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 749,471,072.07 | 1,076,259,046.37 |
| 未分配利润 | 27,671,941.33 | 54,869,401.01 |
| 所有者权益合计 | 777,143,013.40 | 1,131,128,447.38 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,009,112,208.95 | 1,468,076,662.96 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金 A 类份额净值 1.0375 元，基金 A 类份额总额 693,470,750.63 份；基金 C 类份额净值 1.0293 元，基金 C 类份额总额 56,000,321.44 份。东方红战略精选混合份额总额合计为 749,471,072.07 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入 | 2,811,167.90 | 88,403,265.06 |
| 1.利息收入 | 15,236,177.33 | 19,920,726.42 |
| 其中：存款利息收入 | 451,314.12 | 1,282,708.37 |
| 债券利息收入 | 14,671,435.33 | 18,602,881.72 |
| 资产支持证券利息收入 | 111,287.94 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 2,139.94 | 35,136.33 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 3,551,941.60 | 46,057,436.25 |
| 其中：股票投资收益 | 14,508,889.68 | 54,836,602.16 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -12,636,757.05 | -11,792,681.38 |
| 资产支持证券投资收益 | 66,495.83 | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 1,613,313.14 | 3,013,515.47 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -16,114,208.52 | 22,325,265.15 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 137,257.49 | 99,837.24 |

| | | |
|----------------------------|---------------|---------------|
| 列) | | |
| 减：二、费用 | 10,791,279.14 | 13,985,565.05 |
| 1. 管理人报酬 | 3,279,621.08 | 4,834,355.09 |
| 2. 托管费 | 937,034.52 | 1,381,244.41 |
| 3. 销售服务费 | 136,924.21 | 282,862.51 |
| 4. 交易费用 | 508,694.84 | 1,916,721.79 |
| 5. 利息支出 | 5,722,128.18 | 5,406,668.13 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 5,722,128.18 | 5,406,668.13 |
| 6. 税金及附加 | 37,471.54 | - |
| 7. 其他费用 | 169,404.77 | 163,713.12 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -7,980,111.24 | 74,417,700.01 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -7,980,111.24 | 74,417,700.01 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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） | 1,076,259,046.37 | 54,869,401.01 | 1,131,128,447.38 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -7,980,111.24 | -7,980,111.24 |
| 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） | -326,787,974.30 | -19,217,348.44 | -346,005,322.74 |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | -326,787,974.30 | -19,217,348.44 | -346,005,322.74 |
| 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 | 749,471,072.07 | 27,671,941.33 | 777,143,013.40 |

| 项目 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| | 金净值) | | |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,588,458,644.91 | -23,599,450.20 | 1,564,859,194.71 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 74,417,700.01 | 74,417,700.01 |
| 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) | -502,345,500.04 | -4,278,122.05 | -506,623,622.09 |
| 其中：1.基金申购款 | 49,407,484.37 | 343,987.52 | 49,751,471.89 |
| 2.基金赎回款 | -551,752,984.41 | -4,622,109.57 | -556,375,093.98 |
| 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) | 1,086,113,144.87 | 46,540,127.76 | 1,132,653,272.63 |

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：

潘鑫军 任莉 詹朋
 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

东方红战略精选沪港深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”)证监许可[2016]1443号《关于准予东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金注册的批复》核准,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》和《东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,681,130,825.28元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1158号验资报告

予以验证。经向中国证监会备案,《东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,681,411,100.31 份基金份额,其中认购资金利息折合 280,275.03 份基金份额,其中东方红战略精选 A 的基金份额总额为 1,455,142,784.34 份,包含认购资金利息折合 244,006.23 份,东方红战略精选 C 基金份额总额为 226,268,315.97,包含认购资金利息折合 36,268.80 份。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金合同》和《东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金招募说明书》,本基金自募集期起根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费,而不计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,各类别基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红战略精选沪港深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(含中小板、创业及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、固定收益类金融工具、权证、股指期货、国债期货及经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%-30%;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:中债综合指数收益率 \times 80%+恒生指数收益率 \times 10%+沪深 300 指数收益率 \times 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简

称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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[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政策的补充通知》、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》、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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值

税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通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/深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/深港通买卖、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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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（“东证资管”） | 管理人、基金直销机构 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”） | 托管人、基金代销机构 |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 上海东证期货有限公司（“东证期货”） | 受东方证券控制的公司 |

注：本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 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 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 东方证券 | 236,941,502.22 | 87.10% | 1,029,673,216.80 | 91.38% |

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 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 成交总额的比例 |
| 东方证券 | 351,304,764.65 | 81.65% | 568,791,008.47 | 89.31% |

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 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 | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 |
| 东方证券 | 31,308,400,000.00 | 99.58% | 35,406,700,000.00 | 99.66% |

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018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 | 185,323.89 | 88.13% | 2,118,138.51 | 98.83% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | 801,551.03 | 92.06% | 1,422,833.05 | 95.56% |

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，本公司已在深证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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 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 | 3,279,621.08 | 4,834,355.09 |
| 其中：支付销售机构的客 | - | 2,291,676.81 |

| | | |
|------|--|--|
| 户维护费 | | |
|------|--|--|

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2018年1月1日至2018年6月30日 | 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 | 937,034.52 | 1,381,244.41 |

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|----------------------|-------------|-----------|
| | 2018年1月1日至2018年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 东方红战略精选混合 A | 东方红战略精选混合 C | 合计 |
| 上海东方证券资产管理有限公司 | - | 10,502.70 | 10,502.70 |
| 浦发银行 | - | 12,199.97 | 12,199.97 |
| 东方证券 | - | 13,827.31 | 13,827.31 |
| 合计 | - | 36,529.98 | 36,529.98 |

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|--------------------------------------------|-------------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 东方红战略精选混合 A | 东方红战略精选混合 C | 合计 |
| 上海东方证券资产管理有限公司 | - | 553.61 | 553.61 |
| 浦发银行 | - | 16,734.46 | 16,734.46 |
| 东方证券 | - | 29,054.19 | 29,054.19 |
| 合计 | - | 46,342.26 | 46,342.26 |

注：1、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 0.4% 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：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 |
| 浦发银行 | 20,755,876.18 | 208,884.92 | 54,437,291.45 | 425,147.13 |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金支付给东证期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2018 年 6 月 30 日，本基金无应付交易手续费余额(2017 年 6 月 30 日：同)。2018 年度，本基金当期无交易手续费支出(2017 年度：同)。本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，存出保证金不计息。于 2018 年 6 月 30 日，本基金的结算备付金余额为 1,412.61 元，存出保证金余额为 0.00 元(2017 年 6 月 30 日：结算备付金 1,402.35 元，存出保证金 0.00 元)。于 2018 年 6 月 30 日，本基金当期结算备付金利息收入 5.12 元(2017 年同期：1,402.35 元)。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

| 6.4.9.1.1 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 |
| 603693 | 江苏新能 | 2018 年 6 月 25 日 | 2018 年 7 月 3 日 | 新股流通受限 | 9.00 | 9.00 | 5,384 | 48,456.00 | 48,456.00 | - |
| 603706 | 东方环宇 | 2018 年 6 月 29 日 | 2018 年 7 月 9 日 | 新股流通受限 | 13.09 | 13.09 | 1,765 | 23,103.85 | 23,103.85 | - |
| 603105 | 芯能科技 | 2018 年 6 月 29 日 | 2018 年 7 月 9 日 | 新股流通受限 | 4.83 | 4.83 | 3,410 | 16,470.30 | 16,470.30 | - |

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末股票中不存在暂时停牌流通受限的情况。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 227,500,000.00 元，于 2018 年 07 月 02 日、07 月 10 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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 2018 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 295747330.11 元，第二层次的余额为 657157526.81 元，无属于第三层次的余额。

于上年度末 2017 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 396,631,831.71 元，第二层次的余额为 977,798,913.36 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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 2018 年 6 月 30 日及上年度末 2017 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。

§ 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 | 189,566,167.71 | 18.79 |
| | 其中：股票 | 189,566,167.71 | 18.79 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 763,338,689.21 | 75.64 |
| | 其中：债券 | 758,123,689.21 | 75.13 |
| | 资产支持证券 | 5,215,000.00 | 0.52 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 44,147,353.06 | 4.37 |
| 8 | 其他各项资产 | 12,059,998.97 | 1.20 |
| 9 | 合计 | 1,009,112,208.95 | 100.00 |

注：通过港股通交易机制持有的港股期末公允价值为 53,832,573.53 元，占基金资产净值比例 6.93%。

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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,410,000.00 | 0.44 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 69,263,434.24 | 8.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 71,559.85 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,184,422.00 | 0.41 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 22,097,000.00 | 2.84 |
| J | 金融业 | 11,520,000.00 | 1.48 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,729,200.00 | 0.99 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,376,751.95 | 2.36 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 81,226.14 | 0.01 |
| 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 | 135,733,594.18 | 17.47 |

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（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|---------------|--------------|
| A 基础材料 | - | - |
| B 消费者非必需品 | 25,799,696.80 | 3.32 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | 7,157,072.00 | 0.92 |
| F 医疗保健 | 5,075.45 | 0.00 |
| G 工业 | 4,777,609.28 | 0.61 |
| H 信息技术 | 10,319,520.00 | 1.33 |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | 5,773,600.00 | 0.74 |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 53,832,573.53 | 6.93 |

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前十名股票投资明细

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 | 600079 | 人福医药 | 1,965,225 | 25,980,274.50 | 3.34 |
| 2 | 300012 | 华测检测 | 3,123,100 | 17,926,594.00 | 2.31 |
| 3 | 300166 | 东方国信 | 900,000 | 13,257,000.00 | 1.71 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 800,000 | 11,520,000.00 | 1.48 |
| 5 | 300054 | 鼎龙股份 | 1,200,000 | 10,464,000.00 | 1.35 |
| 6 | 00981 | 中芯国际 | 1,200,000 | 10,319,520.00 | 1.33 |
| 7 | 00175 | 吉利汽车 | 600,000 | 10,294,260.00 | 1.32 |
| 8 | 300271 | 华宇软件 | 500,000 | 8,840,000.00 | 1.14 |
| 9 | 002008 | 大族激光 | 160,000 | 8,510,400.00 | 1.10 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 300,000 | 8,370,000.00 | 1.08 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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 | 00175 | 吉利汽车 | 21,004,581.48 | 1.86 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 15,832,232.69 | 1.40 |
| 3 | 300054 | 鼎龙股份 | 6,130,319.00 | 0.54 |
| 4 | 01093 | 石药集团 | 4,617,593.15 | 0.41 |
| 5 | 00371 | 北控水务集团 | 3,365,781.80 | 0.30 |
| 6 | 06886 | HTSC | 2,790,430.21 | 0.25 |
| 7 | 02238 | 广汽集团 | 2,613,746.83 | 0.23 |
| 8 | 00868 | 信义玻璃 | 2,586,979.43 | 0.23 |
| 9 | 601111 | 中国国航 | 2,465,290.00 | 0.22 |
| 10 | 02601 | 中国太保 | 2,461,303.14 | 0.22 |
| 11 | 300012 | 华测检测 | 2,373,714.00 | 0.21 |
| 12 | 01999 | 敏华控股 | 2,334,555.74 | 0.21 |
| 13 | 00981 | 中芯国际 | 1,890,770.38 | 0.17 |
| 14 | 01072 | 东方电气 | 1,801,919.38 | 0.16 |
| 15 | 600029 | 南方航空 | 1,643,192.00 | 0.15 |
| 16 | 600079 | 人福医药 | 868,928.50 | 0.08 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 17 | 002926 | 华西证券 | 282,324.24 | 0.02 |
| 18 | 300750 | 宁德时代 | 257,961.54 | 0.02 |
| 19 | 600901 | 江苏租赁 | 155,843.75 | 0.01 |
| 20 | 601828 | 美凯龙 | 134,064.15 | 0.01 |

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 | 601166 | 兴业银行 | 31,730,825.00 | 2.81 |
| 2 | 01177 | 中国生物制药 | 16,910,190.42 | 1.49 |
| 3 | 00700 | 腾讯控股 | 16,567,466.87 | 1.46 |
| 4 | 06886 | HTSC | 15,796,735.18 | 1.40 |
| 5 | 00175 | 吉利汽车 | 11,900,044.54 | 1.05 |
| 6 | 02386 | 中石化炼化工程 | 10,298,080.44 | 0.91 |
| 7 | 300054 | 鼎龙股份 | 9,989,304.40 | 0.88 |
| 8 | 01999 | 敏华控股 | 9,967,567.28 | 0.88 |
| 9 | 01919 | 中远海控 | 9,614,861.79 | 0.85 |
| 10 | 00981 | 中芯国际 | 8,336,930.92 | 0.74 |
| 11 | 600426 | 华鲁恒升 | 7,512,711.90 | 0.66 |
| 12 | 300166 | 东方国信 | 6,166,803.80 | 0.55 |
| 13 | 01093 | 石药集团 | 5,376,571.96 | 0.48 |
| 14 | 600486 | 扬农化工 | 5,142,228.40 | 0.45 |
| 15 | 00371 | 北控水务集团 | 3,899,234.59 | 0.34 |
| 16 | 002400 | 省广集团 | 3,745,849.23 | 0.33 |
| 17 | 01898 | 中煤能源 | 2,917,687.24 | 0.26 |
| 18 | 600887 | 伊利股份 | 2,890,811.00 | 0.26 |
| 19 | 601888 | 中国国旅 | 2,521,037.00 | 0.22 |
| 20 | 02601 | 中国太保 | 2,419,533.11 | 0.21 |

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 | 77,036,752.37 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 197,265,504.53 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 134,488,500.00 | 17.31 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,150,000.00 | 6.45 |
| 4 | 企业债券 | 398,765,897.30 | 51.31 |
| 5 | 企业短期融资券 | 29,949,000.00 | 3.85 |
| 6 | 中期票据 | 49,976,000.00 | 6.43 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 144,944,291.91 | 18.65 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | | |
| 10 | 合计 | 758,123,689.21 | 97.55 |

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 | 136687 | 16 中泰 01 | 600,000 | 58,818,000.00 | 7.57 |
| 2 | 180404 | 18 农发 04 | 500,000 | 50,150,000.00 | 6.45 |
| 3 | 136689 | 16 绿水 01 | 500,000 | 48,560,000.00 | 6.25 |
| 4 | 143607 | 18 国君 G2 | 400,000 | 40,000,000.00 | 5.15 |
| 5 | 143571 | 18 南水 01 | 400,000 | 39,988,000.00 | 5.15 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------|---------|--------------|---------------|
| 1 | 061605001 | 16 沪公积金 1A | 100,000 | 5,215,000.00 | 0.67 |

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

本基金持有的兴业银行(代码:601166)发行主体兴业银行股份有限公司(以下简称“公司”),因公司存在重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告等十二项违法违规行为,中国银保监会于 2018 年 4 月 19 日对公司作出行政处罚决定(银保监银罚决字〔2018〕1 号),处以 5870 万元罚款。本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定,本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。本基金持有的前十名证券中其余九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 | 94,023.38 |
| 2 | 应收证券清算款 | 399,933.43 |
| 3 | 应收股利 | 161,108.38 |
| 4 | 应收利息 | 11,404,933.78 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,059,998.97 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1 | 113013 | 国君转债 | 23,098,680.00 | 2.97 |
| 2 | 128016 | 雨虹转债 | 20,764,000.00 | 2.67 |
| 3 | 123006 | 东财转债 | 19,243,200.00 | 2.48 |
| 4 | 110034 | 九州转债 | 15,902,015.00 | 2.05 |
| 5 | 110033 | 国贸转债 | 10,403,000.00 | 1.34 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 6 | 120001 | 16 以岭 EB | 8,717,589.16 | 1.12 |
| 7 | 132005 | 15 国资 EB | 7,678,300.00 | 0.99 |
| 8 | 113009 | 广汽转债 | 3,981,021.00 | 0.51 |
| 9 | 132007 | 16 凤凰 EB | 2,566,875.00 | 0.33 |
| 10 | 128029 | 太阳转债 | 371,447.35 | 0.05 |

7.12.5 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。

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 |
| 东方红战略精选混合 A | 6,489 | 106,868.66 | - | - | 693,470,750.63 | 100.00% |
| 东方红战略精选混合 C | 579 | 96,719.04 | 2,754,017.94 | 4.92% | 53,246,303.50 | 95.08% |
| 合计 | 7,068 | 106,037.22 | 2,754,017.94 | 0.37% | 746,717,054.13 | 99.63% |

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 | 东方红战略精选混合 A | 11,391.20 | 0.0016% |
| | 东方红战略精选混合 C | - | - |
| | 合计 | 11,391.20 | 0.0015% |

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东方红战略精选混合A | 东方红战略精选混合C |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016年8月30日）基金份额总额 | 1,455,142,784.34 | 226,268,315.97 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 988,815,481.43 | 87,443,564.94 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - |

| | | |
|--------------------------|----------------|---------------|
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 295,344,730.80 | 31,443,243.50 |
| 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 | 693,470,750.63 | 56,000,321.44 |

§ 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

本基金管理人于 2018 年 3 月 8 日发布公告,陈光明同志自 2018 年 3 月 7 日起辞去公司董事长职务,由潘鑫军同志担任公司董事长职务;

于 2018 年 5 月 11 日发布公告,林鹏同志自 2018 年 5 月 10 日起任职公司副总经理职务。

本报告披露日前,本基金管理人于 2018 年 7 月 21 日发布公告,唐涵颖同志自 2018 年 7 月 20 日起离任公司督察长职务,由任莉同志代为履行公司督察长职务。

本报告期内,本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据工作需要,任命孔建先生担任公司资产托管部总经理,主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

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。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 | 236,941,502.22 | 87.10% | 185,323.89 | 88.13% | - |
| 国盛证券 | 1 | 26,874,453.93 | 9.88% | 19,115.94 | 9.09% | - |
| 中泰证券 | 1 | 8,230,886.11 | 3.03% | 5,854.64 | 2.78% | - |

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；本公司已在深证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、本基金本报告期内新增券商交易单元情况：新增国盛证券 1 个交易单元。

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 | 成交金额 | 占当期债券回购 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的 |

| | | 例 | | 成交总额 的比例 | | 比例 |
|------|----------------|--------|-------------------|-------------|---|----|
| 东方证券 | 351,304,764.65 | 81.65% | 31,308,400,000.00 | 99.58% | - | - |
| 国盛证券 | 42,345,168.00 | 9.84% | 18,500,000.00 | 0.06% | - | - |
| 中泰证券 | 36,596,361.92 | 8.51% | 114,500,000.00 | 0.36% | - | - |

上海东方证券资产管理有限公司
2018 年 8 月 27 日