

东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:东方阿尔法基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 28 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2018年8月27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2月8日起至6月30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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	11
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	14
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
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
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
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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情况	53

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	东方阿尔法精选混合	
基金主代码	005358	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月08日	
基金管理人	东方阿尔法基金管理有限公司	
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	1,167,223,835.83份	
基金合同存续期	不定期	
旗下基金份额类别的简称	东方阿尔法精选混合 A	东方阿尔法精选混合 C
旗下基金份额类别的交易代码	005358	005359
报告期末下属类别基金的份额总额	628,607,139.54份	538,616,696.29份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础之上，通过灵活、主动的投资管理方式力求实现组合资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下9个方面内容：</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>基金管理人将根据国内外宏观经济情况、国内外证券市场估值水平阶段性不断调整权益类资产和其他资产之间的大类资产配置比例。</p> <p>2、个股优选策略</p> <p>基金管理人将采用定量分析与定性分析相结合的方式对上市公司进行分析，建立备选股票池。并以备选股票池成份股未来两年的PE衡量作为动态性价比作为选择其进入投资组合的重要依据。</p> <p>3、港股投资策略</p> <p>本基金港股投资将重点关注 A 股稀缺性行业个</p>

股、A 股缺乏投资标的行业、具有持续领先优势或核心竞争力的企业、符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股以及与 A 股同类公司相比具有估值优势的公司。

4、债券类资产投资策略

本基金的债券投资将采取较为积极的策略，通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等，研判各类属固定收益类资产的风险趋势与收益预期，精选个券进行投资。

5、权证投资策略

采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资的价值基准，并根据权证标的股票基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证趋势投资。

6、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

7、融资买入股票策略

本基金将根据融资买入股票成本以及其他投资工具收益率综合评估是否采用融资方式买入股票。

8、国债期货的投资策略

基金管理人将结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。

9、中小企业私募债券投资策略

本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤，重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素，采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估，选择发行主体资质优良，估值合理且流通相对充分的品种进行适度

	投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

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	东方阿尔法基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曾健
	联系电话	0755-21872901
	电子邮箱	service@dfa66.com
客户服务电话	400-930-6677	95555
传真	0755-21872902	0755-83195201
注册地址	广东省深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦西区23楼BC单元	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518034	518040
法定代表人	刘明	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	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dfa66.com
基金半年度报告备置地点	广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦西区23楼BC单元

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

金融运营服务机构	招商证券股份有限公司	广东省深圳市南山区高新南九道9号金地威新软件科技园6号楼
----------	------------	------------------------------

§ 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(2018年02月08日(基金合同生效日)-2018年06月30日)	
	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C
本期已实现收益	5,755,804.05	3,575,744.82
本期利润	-42,612,407.55	-34,738,859.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0660	-0.0683
本期加权平均净值利润率	-6.68%	-6.92%
本期基金份额净值增长率	-6.67%	-6.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-41,931,032.64	-36,903,546.18
期末可供分配基金份额利润	-0.0667	-0.0685
期末基金资产净值	586,676,106.90	501,713,150.11
期末基金份额净值	0.9333	0.9315
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-6.67%	-6.85%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4. 本基金合同生效日为2018年2月8日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满1年。

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

东方阿尔法精选混合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	-3.57%	0.93%	-3.84%	0.72%	0.27%	0.21%
过去三个月	-7.47%	0.76%	-3.98%	0.64%	-3.49%	0.12%
自基金合同生效起至今	-6.67%	0.68%	-4.95%	0.67%	-1.72%	0.01%

东方阿尔法精选混合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	-3.61%	0.93%	-3.84%	0.72%	0.23%	0.21%
过去三个月	-7.59%	0.76%	-3.98%	0.64%	-3.61%	0.12%
自基金合同生效起至今	-6.85%	0.68%	-4.95%	0.67%	-1.90%	0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%

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



2、本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。截至本报告期末，建仓期尚未结束。

§ 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

东方阿尔法基金管理有限公司（以下简称“东方阿尔法基金”）于2017年6月24日经中国证监会批准，2017年7月4日注册成立，公司总部设在广东省深圳市，业务范围包括基金募集、基金销售、基金管理、特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。截至报告期末，注册资本为1亿元人民币。

东方阿尔法基金作为华南地区首家纯员工持股的公募基金管理公司，公司股权结构为刘明、珠海共同成长股权投资基金合伙企业（有限合伙）、肖冰、雷振锋、曾健分别持有公司39.96%、39.56%、13.98%、4.5%和2%的股权。

截至报告期末，东方阿尔法基金管理资产规模超过17.10亿元，旗下管理1只开放式基金和1只专户理财投资组合。

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		
刘明	本基金基金经理、公司总经理、公司首席投资官	2018-02-08	-	17.5	经济学硕士。曾任厦门证券公司鹭江营业部总经理、厦门产权交易中心副总经理、香港时富金融服务集团投资经理、大成基金管理有限公司基金经理、投资部副总监、投资部总监、首席投资官、公司助理总经理、股票投资决策委员会主席、公司副总经理,并兼任社保组合基金经理。2015年5月至2017年6月任东方阿尔法基金管理有限公司筹备组组长。现任东方阿尔法基金管理有限公司总经理、首席投资官以及东方

					阿尔法精选混合基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------------

注： 1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内不存在同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的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

2018年的上半年，中国经济的内外部经济环境异常复杂。内部面临政府和企业去杠杆、经济结构调整、资管新规推行、中央及地方财政收支再平衡等一系列重大变革，同时叠加外部中美贸易冲突的新问题，在这样一个大背景下，宏观经济政策体现出多变化性

以及高度的不确定性，导致对行业以及上市公司未来前景判断的难度大大提高，A股市场上半年通过系统性的大幅回调来回应这种不确定性。

本基金自2月8日成立以来，在上半年的建仓期内采取相对保守、谨慎的建仓策略。我们计划通过前期积累一定的安全垫之后，再逐步增加股票仓位。无论在股票仓位、行业配置以及个股选择方面，本基金均采用“不追高，跌敢买”的建仓策略。在积累了一定“安全垫”的前提下，我们设置了一个合适的股票仓位。但即使这样，由于大盘系统性的下跌，在报告期内本基金净值仍产生了一定程度的亏损。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东方阿尔法精选混合A基金份额净值为0.9333元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.67%，同期业绩比较基准收益率为-4.95%；截至报告期末东方阿尔法精选混合C基金份额净值为0.9315元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.85%，同期业绩比较基准收益率为-4.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前的市场弥漫着浓厚的悲观情绪，并存在着一种倾向，就是将对长期存在的一些经济方面的问题的担忧过度短期化，导致很多基本面优秀的个股持续下跌。

当前A股市场的整体估值水平，无论从历史的纵向以及与国际市场的横向对比来看，都处于一个比较低的水平。A股有相当多的个股，在经历此轮下跌调整后，从一个偏长期的角度而言，持有2-3年，可以获取不错的绝对回报。

从这个时点上展望下半年的A股市场，我们需要以更理性、更积极的心态去分析和应对。随着中美贸易的问题逐步明朗，无论是问题更严重，还是更加平和，中美之间终究会寻找到双方关系的新平衡点，国内宏观政治经济政策将会在新的平衡点的基础上由不确定性走向确定，不确定性消除的过程，也就是国内A股市场逐步走出底部的过程。虽然这个过程可能比较煎熬，但是机会往往总是给有准备之人，因为连续的调整是释放风险。相反，今年初逼空式的连续上涨，恰恰是风险的集聚。

本基金发行成立至今，在一个逐渐下跌的过程中建仓，尽管从短期而言有一定的净值损失，但从一个相对长期（2-3年）的角度，可以说遇到了获取长期收益的好时机。本基金管理人将会一如既往地勤勉尽责，抓住机遇，充分发挥“自下而上、精选个股”的优势，努力为持有人创造超额回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人已将本基金的基金估值核算业务外包给本基金的金融运营服务机构——招商证券股份有限公司。本基金金融运营服务机构按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金金融

运营服务机构使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。金融运营服务机构改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。同时，本基金管理人建立了估值小组，由总经理、督察长及运作保障部、投资部、研究部、中央交易室和监察稽核部业务骨干组成，负责指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各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。由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一基金份额类别的每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无

§ 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：东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	225,640,867.55
结算备付金		5,964,380.21
存出保证金		173,003.71
交易性金融资产	6.4.7.2	721,982,083.82
其中：股票投资		636,166,035.56
基金投资		-
债券投资		85,816,048.26
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	131,000,000.00
应收证券清算款		13,125,328.50
应收利息	6.4.7.5	5,825,662.90
应收股利		-
应收申购款		118,839.99
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,103,830,166.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日
负 债:		
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		12,588,632.00
应付赎回款		850,323.26
应付管理人报酬		1,347,325.88
应付托管费		224,554.30
应付销售服务费		201,010.75
应付交易费用	6.4.7.7	118,203.40
应交税费		33.11
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	110,826.97
负债合计		15,440,909.67
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	1,167,223,835.83
未分配利润	6.4.7.10	-78,834,578.82
所有者权益合计		1,088,389,257.01
负债和所有者权益总计		1,103,830,166.68

注：1、报告截止日2018年6月30日，东方阿尔法精选混合A基金份额净值0.9333元，基金份额总额628,607,139.54份；东方阿尔法精选混合C基金份额净值0.9315元，基金份额总额538,616,696.29份。

2、本基金合同生效日为2018年2月8日，2018年上半年度实际报告期间为2018年2月8日至2018年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
一、收入		-67,687,842.52
1. 利息收入		9,853,912.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,870,422.73
债券利息收入		542,480.24
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,441,009.15
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,015,955.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,759,441.81
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-27,106.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	6,283,620.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-86,682,815.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	125,105.71
减：二、费用		9,663,424.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,658,561.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,109,760.28

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	977,462.85
4. 交易费用	6.4.7.20	807,593.02
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3.55
7. 其他费用	6.4.7.21	110,042.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-77,351,266.75
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-77,351,266.75

注：本基金合同生效日为2018年2月8日，2018年上半年度实际报告期间为2018年2月8日至2018年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06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）	1,164,035,083.25	-	1,164,035,083.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-77,351,266.75	-77,351,266.75
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）	3,188,752.58	-1,483,312.07	1,705,440.51
其中：1. 基金申购款	116,475,718.58	-4,325,657.17	112,150,061.41
2. 基金赎回款	-113,286,966.00	2,842,345.10	-110,444,620.90

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）	1,167,223,835.83	-78,834,578.82	1,088,389,257.01

注：本基金合同生效日为2018年2月8日，2018年上半年度实际报告期间为2018年2月8日至2018年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

刘明

曹渊

张珂

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

东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第2013号《关于准予东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由东方阿尔法基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式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，存续期限不定，首次募集时间为2018年1月23日至2018年2月5日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,163,778,381.98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（2018）第0110号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2018年2月8日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,164,035,083.25份，其中认购资金利息折合256,701.27份基金份额。本基金的基金管理人为东方阿尔法基金管理有限公司，基金金融运营服务机构为招商证券股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2018年2月8日（基金合同生效日）至2018年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

本基金目前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。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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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或者发行价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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各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。

(3) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一基金份额类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 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，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[2017]13号《中国证监会关于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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于2017年12月25日前，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。自2017年12月25日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金如持有的银行间同业市场固定收益品种将按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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[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) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	5,740,867.55

定期存款	219,900,000.00
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计	225,640,867.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2018年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		724,155,914.95	636,166,035.56	-87,989,879.39
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	84,508,984.49	85,816,048.26	1,307,063.77
	银行间市场	-	-	-
	合计	84,508,984.49	85,816,048.26	1,307,063.77
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		808,664,899.44	721,982,083.82	-86,682,815.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	131,000,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	131,000,000.00	-
----	----------------	---

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金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 2018年06月30日
应收活期存款利息	3,595.78
应收定期存款利息	4,250,177.82
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,684.00
应收债券利息	1,610,903.56
应收买入返售证券利息	-41,776.16
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	77.90
合计	5,825,662.90

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	118,203.40
银行间市场应付交易费用	-
合计	118,203.40

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,499.18
预提费用	109,327.79
合计	110,826.97

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 东方阿尔法精选混合A

金额单位：人民币元

项目 (东方阿尔法精选混合A)	本期2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	651,144,745.16	651,144,745.16
本期申购	29,942,503.84	29,942,503.84
本期赎回（以“-”号填列）	-52,480,109.46	-52,480,109.46
本期末	628,607,139.54	628,607,139.54

6.4.7.9.2 东方阿尔法精选混合C

金额单位：人民币元

项目 (东方阿尔法精选混合C)	本期2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	512,890,338.09	512,890,338.09
本期申购	86,533,214.74	86,533,214.74
本期赎回（以“-”号填列）	-60,806,856.54	-60,806,856.54
本期末	538,616,696.29	538,616,696.29

注： 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 东方阿尔法精选混合A

单位：人民币元

项目 (东方阿尔法精选混合 A)	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	5,755,804.05	-48,368,211.60	-42,612,407.55
本期基金份额交易产 生的变动数	-90,551.34	771,926.25	681,374.91
其中：基金申购款	139,024.78	-1,065,913.79	-926,889.01
基金赎回款	-229,576.12	1,837,840.04	1,608,263.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,665,252.71	-47,596,285.35	-41,931,032.64

6.4.7.10.2 东方阿尔法精选混合C

单位：人民币元

项目 (东方阿尔法精选混合 C)	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	3,575,744.82	-38,314,604.02	-34,738,859.20
本期基金份额交易产 生的变动数	238,894.25	-2,403,581.23	-2,164,686.98
其中：基金申购款	321,816.58	-3,720,584.74	-3,398,768.16
基金赎回款	-82,922.33	1,317,003.51	1,234,081.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,814,639.07	-40,718,185.25	-36,903,546.18

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06

	月30日
活期存款利息收入	262,648.22
定期存款利息收入	7,574,229.49
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	32,793.73
其他	751.29
合计	7,870,422.73

注：“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
卖出股票成交总额	31,811,973.71
减：卖出股票成本总额	29,052,531.90
买卖股票差价收入	2,759,441.81

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-27,106.80
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-27,106.80

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	66,095,870.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	63,999,106.80
减：应收利息总额	2,123,870.40
买卖债券差价收入	-27,106.80

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,283,620.26
基金投资产生的股利收益	-

合计	6,283,620.26
----	--------------

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-86,682,815.62
——股票投资	-87,989,879.39
——债券投资	1,307,063.77
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-86,682,815.62

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
基金赎回费收入	125,105.71
合计	125,105.71

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A类份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
交易所市场交易费用	807,593.02
银行间市场交易费用	-
合计	807,593.02

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-
汇划手续费	715.00
信息披露费	65,596.96
审计费用	43,730.83
合计	110,042.79

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作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
东方阿尔法基金管理有限公司（“东方阿尔法基金”）	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

珠海共同成长股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
刘明	基金管理人股东
肖冰	基金管理人股东
雷振锋	基金管理人股东
曾健	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

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 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,658,561.74
其中：支付销售机构的客户维护费	284,425.35

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%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

本基金的基金合同于2018年2月8日生效，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
	2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,109,760.28

注：基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。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为前一日基金资产净值

本基金的基金合同于2018年2月8日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.3 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02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C	合计
招商银行股份有限公司	-	25,949.60	25,949.60
东方阿尔法基金管理有限公司	-	669,638.02	669,638.02
合计	-	695,587.62	695,587.62

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.5%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基

金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

本基金的基金合同于2018年2月8日生效，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

本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

东方阿尔法精选混合A

份额单位：份

项目	本期 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018年02月08日）持有的基金份额	30,017,551.16
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	30,017,551.16
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	30,017,551.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.78%

注：1、以上表中“报告期末持有的基金份额占基金总份额比例”的计算中，对下属不同类别基金比例的分母采用各自级别的份额。

2、本报告期内基金管理人运用固有资金未投资“东方阿尔法精选混合C”。

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

份额单位：份

东方阿尔法精选混合A

关联方名称	本期末

	2018年06月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
珠海共同成长股权投资基金合伙企业（有限合伙）	10,140,929.56	1.61%
刘明	6,670,566.58	1.06%
肖冰	1,000,225.22	0.16%
雷振锋	999,000.00	0.16%
曾健	950,552.83	0.15%

注：1、以上表中“持有的基金份额占基金总份额的比例”的计算中，对下属不同类别基金比例的分母采用各自级别的份额。

2、报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资“东方阿尔法精选混合C”。

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 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	5,740,867.55	262,648.22

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。本基金的基金合同于2018年2月8日生效，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内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2018年06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
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和银行存款等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，

结合基金资产所运用金融工具特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的三级风险防控体系。一级风险防范指基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等。二级风险防范指在公司投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。公司经理层设投资决策委员会，对涉及基金投资的重大问题进行决策，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部在督察长的领导下，独立于公司各业务部门，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

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、拒绝支付到期本息等情况，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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行；本基金的银行定期存款存放在民生银行，与该银行存款相关的信用风险较低。本基金持有的一年内到期国债以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。本基金在交易所进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金目前暂未开展银行间同业市场业务，无此类信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部债券信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于2018年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为2.79%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年06月30日
--------	--------------------

A-1	-
A-1以下	-
未评级	55,412,322.40
合计	55,412,322.40

注：1、未评级部分为国债、政策性金融债和央票。

2、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

3、债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年06月30日
AAA	-
AAA以下	30,403,725.86
未评级	-
合计	30,403,725.86

注：1、未评级部分为国债、政策性金融债和央票。

2、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

3、债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，监察稽核部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监察稽核部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

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。

本基金的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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年 06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	5,740,867.55	219,900,000.00	-	-	-	-	225,640,867.55
结算备付金	5,964,380.21	-	-	-	-	-	5,964,380.21
存出保证金	173,003.71	-	-	-	-	-	173,003.71
交易性金融资产	-	50,005,000.00	5,407,322.40	-	30,403,725.86	636,166,035.56	721,982,083.82
买入返售金融资产	131,000,000.00	-	-	-	-	-	131,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	13,125,328.50	13,125,328.50

应收利息	-	-	-	-	-	5,825,662.90	5,825,662.90
应收申购款	-	-	-	-	-	118,839.99	118,839.99
资产总计	142,878,251.47	269,905,000.00	5,407,322.40	-	30,403,725.86	655,235,866.95	1,103,830,166.68
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	12,588,632.00	12,588,632.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	850,323.26	850,323.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,347,325.88	1,347,325.88
应付托管费	-	-	-	-	-	224,554.30	224,554.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	201,010.75	201,010.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	118,203.40	118,203.40
应交税费	-	-	-	-	-	33.11	33.11
其他负债	-	-	-	-	-	110,826.97	110,826.97
负债总计	-	-	-	-	-	15,440,909.67	15,440,909.67
利率敏感度缺口	142,878,251.47	269,905,000.00	5,407,322.40	-	30,403,725.86	639,794,957.28	1,088,389,257.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2018年06月30日
	1. 市场利率下降25个基点	-395,444.42

2. 市场利率上升25个基点	401, 564. 06
----------------	--------------

6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%-95%；其中对港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）的投资比例不超过股票资产的50%。本基金在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

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 2018年06月30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	636, 166, 035. 56	58. 45
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	85, 816, 048. 26	7. 88
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	721,982,083.82	66.33

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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 2018年06月30日
	沪深300指数上升5%	35,406,543.25
	沪深300指数下降5%	-35,406,543.25

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

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1,103,830,166.68元，属于第二层次的余额为0元，属于第三层次的余额为0元。

(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，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，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	636,166,035.56	57.63
	其中：股票	636,166,035.56	57.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	85,816,048.26	7.77
	其中：债券	85,816,048.26	7.77
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	131,000,000.00	11.87
	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	231,605,247.76	20.98
8	其他各项资产	19,242,835.10	1.74
9	合计	1,103,830,166.68	100.00

7.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	32,217,000.97	2.96
C	制造业	212,486,584.76	19.52
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	89,728,485.51	8.24
G	交通运输、仓储和邮政业	1,320,000.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,022,304.24	2.85
J	金融业	131,673,143.06	12.10
K	房地产业	99,771,118.74	9.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.01
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	37,715,220.79	3.47
S	综合	-	-
	合计	636,166,035.56	58.45

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,229,938	72,049,768.04	6.62
2	002745	木林森	3,308,372	58,855,937.88	5.41
3	002202	金风科技	4,141,958	52,354,349.12	4.81
4	002640	跨境通	3,458,300	51,943,666.00	4.77

5	601877	正泰电器	1,956,588	43,671,044.16	4.01
6	002146	荣盛发展	4,725,968	41,257,700.64	3.79
7	002867	周大生	1,199,899	37,784,819.51	3.47
8	000001	平安银行	4,154,868	37,767,750.12	3.47
9	601899	紫金矿业	8,924,377	32,217,000.97	2.96
10	300418	昆仑万维	1,556,523	29,387,154.24	2.70
11	600114	东睦股份	2,654,583	25,935,275.91	2.38
12	000002	万科A	1,038,746	25,553,151.60	2.35
13	300144	宋城演艺	942,580	22,150,630.00	2.04
14	002142	宁波银行	1,322,500	21,543,525.00	1.98
15	001979	招商蛇口	1,023,622	19,499,999.10	1.79
16	002343	慈文传媒	829,227	15,564,590.79	1.43
17	000069	华侨城A	1,844,380	13,334,867.40	1.23
18	002737	葵花药业	482,260	10,431,283.80	0.96
19	002563	森马服饰	625,400	8,943,220.00	0.82
20	300709	精研科技	109,400	4,587,142.00	0.42
21	603686	龙马环卫	100,000	2,444,000.00	0.22
22	300718	长盛轴承	118,800	2,283,336.00	0.21
23	002279	久其软件	165,000	1,635,150.00	0.15
24	600233	圆通速递	100,000	1,320,000.00	0.12
25	002228	合兴包装	259,936	1,239,894.72	0.11
26	300750	宁德时代	10,261	738,381.56	0.07
27	300030	阳普医疗	51,000	370,260.00	0.03
28	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.02
29	002293	罗莱生活	8,500	127,755.00	0.01
30	002285	世联行	20,000	125,400.00	0.01
31	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
32	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.01
33	300745	欣锐科技	1,304	107,032.32	0.01
34	603486	科沃斯	1,639	105,338.53	0.01
35	603587	地素时尚	2,442	100,879.02	0.01

36	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
37	300746	汉嘉设计	2,318	79,391.50	0.01
38	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
39	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
40	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
41	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	601318	中国平安	91,529,622.41	8.41
2	002202	金风科技	63,432,682.56	5.83
3	002745	木林森	61,590,753.04	5.66
4	002640	跨境通	58,341,323.26	5.36
5	000001	平安银行	51,210,953.70	4.71
6	002146	荣盛发展	50,929,679.26	4.68
7	601877	正泰电器	46,056,166.66	4.23
8	601899	紫金矿业	40,645,783.43	3.73
9	002867	周大生	36,243,269.78	3.33
10	000002	万科A	33,812,781.90	3.11
11	300418	昆仑万维	30,473,287.78	2.80
12	600114	东睦股份	27,329,028.89	2.51
13	002142	宁波银行	26,352,721.90	2.42
14	001979	招商蛇口	22,530,344.52	2.07
15	002343	慈文传媒	19,074,245.60	1.75
16	300144	宋城演艺	18,252,451.80	1.68
17	002434	万里扬	16,760,641.00	1.54
18	000069	华侨城A	15,644,269.04	1.44
19	603399	吉翔股份	10,472,271.00	0.96

20	002737	葵花药业	8,312,539.98	0.76
----	--------	------	--------------	------

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	002434	万里扬	15,224,926.77	1.40
2	603399	吉翔股份	13,374,949.00	1.23
3	300192	科斯伍德	2,179,039.00	0.20
4	603259	药明康德	570,114.89	0.05
5	300454	深信服	204,991.20	0.02
6	603013	亚普股份	108,554.87	0.01
7	603348	文灿股份	97,513.39	0.01
8	603045	福达合金	49,441.59	-
9	601877	正泰电器	2,443.00	-

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（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	753,208,446.85
卖出股票收入（成交）总额	31,811,973.71

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	55,412,322.40	5.09
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	30,403,725.86	2.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	85,816,048.26	7.88

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	019571	17国债17	500,000	50,005,000.00	4.59
2	123006	东财转债	252,804	30,403,725.86	2.79
3	019585	18国债03	54,030	5,407,322.40	0.50

注，截止至报告期末，本基金仅持有上述债券。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体，本期没有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

本基金投资的前十名股票没有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	173,003.71
2	应收证券清算款	13,125,328.50
3	应收股利	-
4	应收利息	5,825,662.90
5	应收申购款	118,839.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,242,835.10

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	123006	东财转债	30,403,725.86	2.79

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

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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
东方阿尔法精选混合A	4,810	130,687.55	212,037,357.86	33.73%	416,569,781.68	66.27%
东方阿尔法精选混合C	2,092	257,464.96	407,392,973.62	75.64%	131,223,722.67	24.36%
合计	6,902	169,113.86	619,430,331.48	53.07%	547,793,504.35	46.93%

注：本基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属不同类别的基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计

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	东方阿尔法精选	9,763,924.07	1.55%

有本基金	混合A		
	东方阿尔法精选混合C	640,790.70	0.12%
	合计	10,404,714.77	0.89%

注:基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属不同类别基金,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	东方阿尔法精选混 合A	>100
	东方阿尔法精选混 合C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	东方阿尔法精选混 合A	>100
	东方阿尔法精选混 合C	-
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份 额总 数	持有份 额占基 金总份 额比 例	发起份 额总 数	发起份 额占基 金总份 额比 例	发起份 额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,005,850.58	0.86%	10,005,850.58	0.86%	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,005,850.58	0.86%	10,005,850.58	0.86%	自合同生效之日起不少于三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C
基金合同生效日(2018年02月08日)基金份额总额	651,144,745.16	512,890,338.09
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	29,942,503.84	86,533,214.74
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	52,480,109.46	60,806,856.54
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	628,607,139.54	538,616,696.29

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

经东方阿尔法基金管理有限公司第一届董事会第八次会议审议通过《关于同意曾健女士辞去公司副总经理职务并聘请曾健女士为公司拟任督察长的议案》和《关于同意肖冰先生不再代为履行督察长职务的议案》，原副总经理曾健女士于 2018 年 5 月 30 日起转任基金管理人督察长职务，董事长肖冰先生不再代为履行督察长职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

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、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
招商证券	4	2,433,576.00	0.31%	2,266.42	0.32%	-
安信证券	4	66,100,964.48	8.43%	61,561.15	8.73%	-
申万宏源证券	4	45,044,721.71	5.74%	32,034.17	4.54%	-
华泰证券	4	30,556,844.94	3.90%	22,343.44	3.17%	-
中信证券	4	639,945,633.42	81.62%	586,727.18	83.23%	-

注：交易单元的选择标准和程序 根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A: 选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；

- 2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;
- 3、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;
- 4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比,并根据评比的结果选择席位:

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实,投资建议是否准确;
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券	-	-	146,000,000.00	2.23%	-	-	-	-
安信证券	34,988,028.77	23.06%	1,319,000,000.00	20.16%	-	-	-	-
申万宏源证券	48,782,150.54	32.16%	2,857,000,000.00	43.66%	-	-	-	-
华泰证券	2,136,509.50	1.41%	134,000,000.00	2.05%	-	-	-	-
中信证券	65,793,666.64	43.37%	2,087,000,000.00	31.90%	-	-	-	-

注:该表格中的债券成交金额是按全价计算的金额。

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	东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-02-09

	金合同生效公告		
2	东方阿尔法基金管理有限公司关于客户服务热线变更的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-03-01
3	东方阿尔法基金管理有限公司关于董事长继续代为履行督察长职务的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-03-08
4	东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-05-04
5	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加上海中正达广基金销售有限公司为代销机构的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-05-11
6	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-05-18
7	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构并参与其费率优惠的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-05-29
8	东方阿尔法基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-05-31
9	东方阿尔法基金管理有限公司关于调整旗下基金单笔最低定投金额限制的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-06-06
10	东方阿尔法基金管理有限公司旗下基金2018年半年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及份额累计净值公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2018-06-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年2月8日至2018年6月30日	439,605,282.00	68,999,803.23	-	508,605,085.23	43.57%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同。
- 2、东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议。
- 3、东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年半年度报告原文

12.2 存放地点

地点为管理人地址：广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦西区23楼BC单元

12.3 查阅方式

网址：www.dfa66.com

东方阿尔法基金管理有限公司
二〇一八年八月二十八日