
东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式
证券投资基金
(原东方红纯债债券型发起式证券投资基
金转型)
2018 年年度报告
(摘要)

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 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 2019 年 3 月 22 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。

东方红纯债债券型发起式证券投资基金于 2018 年 06 月 07 日变更注册为东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金。基金托管人及基金注册登记机构不变，基金代码亦保持不变。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等按照《东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述修改变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及《基金合同》的约定履行了相关手续。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。其中，2018 年 6 月 8 日起，“东方红纯债债券型发起式证券投资基金”转型为“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 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金合同及托管协议即日生效。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

| | |
|------------|--------------------|
| 基金简称 | 东方红 6 个月定开纯债 |
| 基金主代码 | 001906 |
| 前端交易代码 | 001906 |
| 基金运作方式 | 契约型、定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 6 月 8 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 | 1,955,840,158.01 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

注：东方红纯债债券型发起式证券投资基金于 2018 年 06 月 07 日变更注册为东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金。

2.1 基金基本情况（转型前）

| | |
|------------|------------------|
| 基金简称 | 东方红纯债债券 |
| 基金主代码 | 001906 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 10 月 26 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 | 60,123,593.77 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

注：东方红纯债债券型发起式证券投资基金于 2018 年 06 月 07 日变更注册为东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金。

2.2 基金产品说明（转型后）

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金为纯债基金，主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，追求长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采用自上而下的方法，在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上，对市场基本利率、债券类产品收益率、货币类产品收益率等大类产品收益率水平变化进行评估，并结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，针对不同行业、不同投资品种选择投资策略，以此做出最佳的资产配置及风险控制。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率*80%+同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率*20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

注：东方红纯债债券型发起式证券投资基金于 2018 年 06 月 07 日变更注册为东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金为纯债基金，主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，追求长期稳定的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采用自上而下的方法，在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上，对市场基本利率、债券类产品收益率、货币类产品收益率等大类产品收益率水平变化进行评估，并结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，针对不同行业、不同投资品种选择投资策略，以此做出最佳的资产配置及风险控制。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

注：东方红纯债债券型发起式证券投资基金于 2018 年 06 月 07 日变更注册为东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|-------------------|------------------------|
| 名称 | | 上海东方证券资产管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李云亮 | 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 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.dfham.com |
| 基金年度报告备置地点 | 上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|----------------------|---|
| 本期已实现收益 | 33,980,547.95 |
| 本期利润 | 56,330,170.93 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0514 |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.08% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年 12 月 31 日 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0166 |
| 期末基金资产净值 | 2,106,872,476.66 |
| 期末基金份额净值 | 1.0772 |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

4、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日；“本期”指 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日) - 2018 年 12 月 31 日。

转型前

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 7 日 | 2017 年 | 2016 年 |
|----------------------|-----------------------------------|---------------|----------------|
| 本期已实现收益 | 906,728.91 | -5,441,609.66 | 27,283,129.38 |
| 本期利润 | 1,533,523.43 | 3,916,299.60 | 14,512,814.33 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0255 | 0.0458 | 0.0150 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.57% | 2.23% | 1.48% |
| 3.1.1 期末数据和指标 | 2018 年 6 月 7 日 | 2017 年末 | 2016 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0038 | -0.0189 | -0.0122 |
| 期末基金资产净值 | 62,258,908.85 | 60,745,565.42 | 996,703,319.49 |
| 期末基金份额净值 | 1.036 | 1.010 | 0.988 |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

4、表中的“期末”指 2018 年 6 月 7 日；“本期”指 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 7 日。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 2.30% | 0.04% | 1.73% | 0.04% | 0.57% | 0.00% |
| 过去六个月 | 4.48% | 0.06% | 2.34% | 0.05% | 2.14% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.08% | 0.06% | 2.80% | 0.05% | 2.28% | 0.01% |

注：1、自基金合同生效日起至至今指 2018 年 6 月 8 日-2018 年 12 月 31 日。

2、根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率*80%+同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率*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：

$$\text{benchmark}_t = 80\% * [\text{t 日中债综合指数} / (\text{t-1 日中债综合指数} - 1)] + 20\% * (\text{t 日同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率} / 365)$$

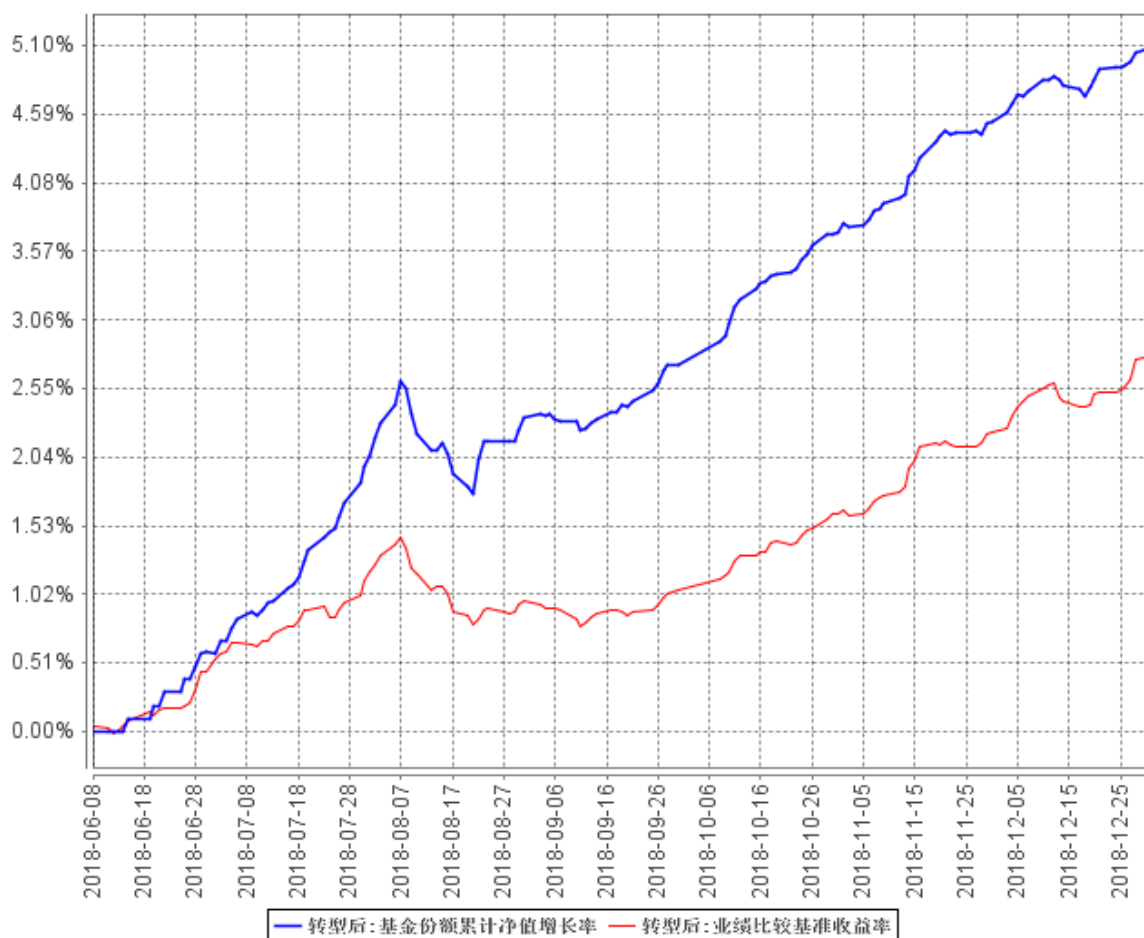
其中，t=1, 2, 3, ... T, T 表示时间截至日；

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

$$\text{benchmark}_{Tt} = \prod_{t=T}^t \text{benchmark}_t$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=T}^t \text{benchmark}_t$ 表示 t 日至 T 日的 benchmark_t 数学连乘。

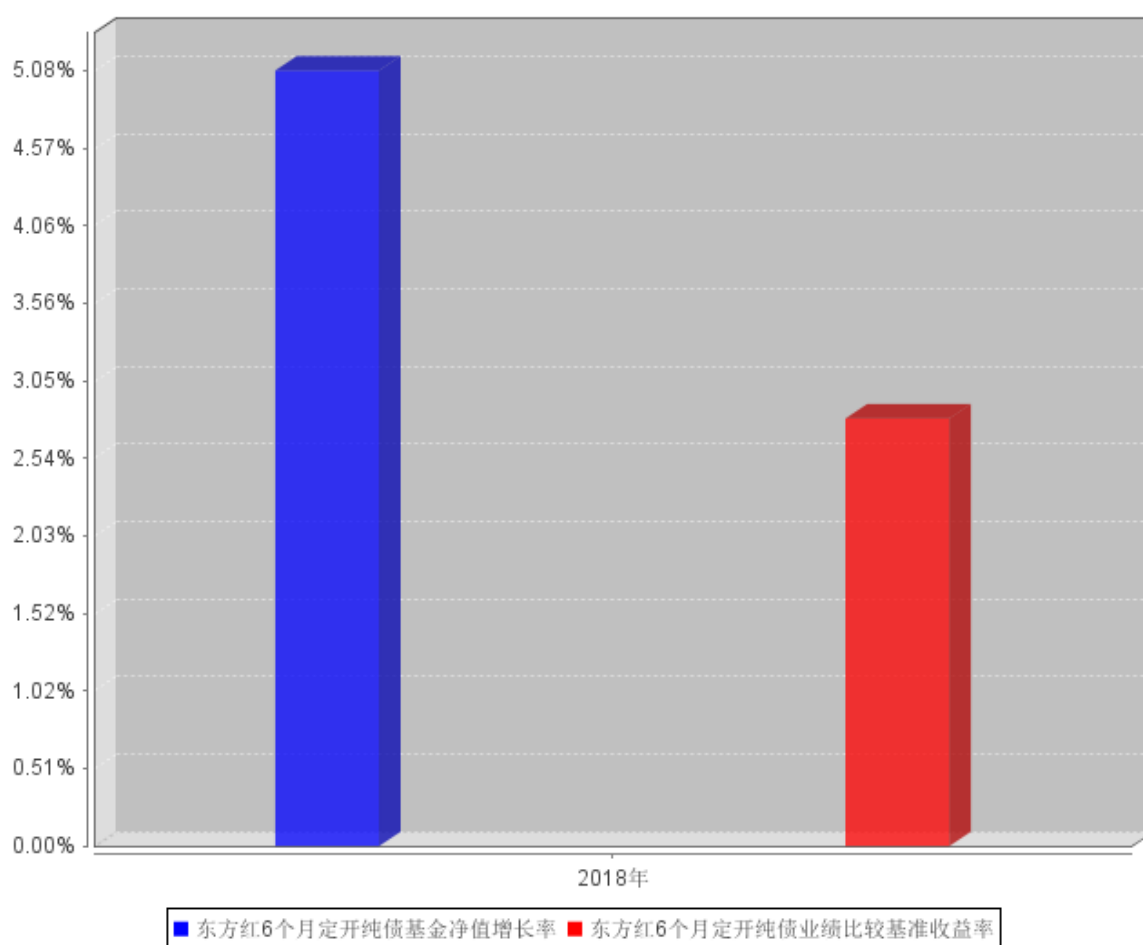
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2018 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2018 年 6 月 8 日转型为“东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金”，新基金合同生效日至今不满一年。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.57% | 0.08% | 0.64% | 0.01% | 0.93% | 0.07% |
| 过去六个月 | 2.68% | 0.07% | 1.27% | 0.01% | 1.41% | 0.06% |
| 过去一年 | 3.39% | 0.06% | 2.59% | 0.01% | 0.80% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.94% | 0.07% | 7.07% | 0.01% | -0.13% | 0.06% |

注：1、自基金合同生效日起至至今指 2015 年 10 月 26 日-2018 年 6 月 7 日。

2、根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。

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）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 100\% * [(t \text{ 日同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率} + 1.2\%) / 365]$$

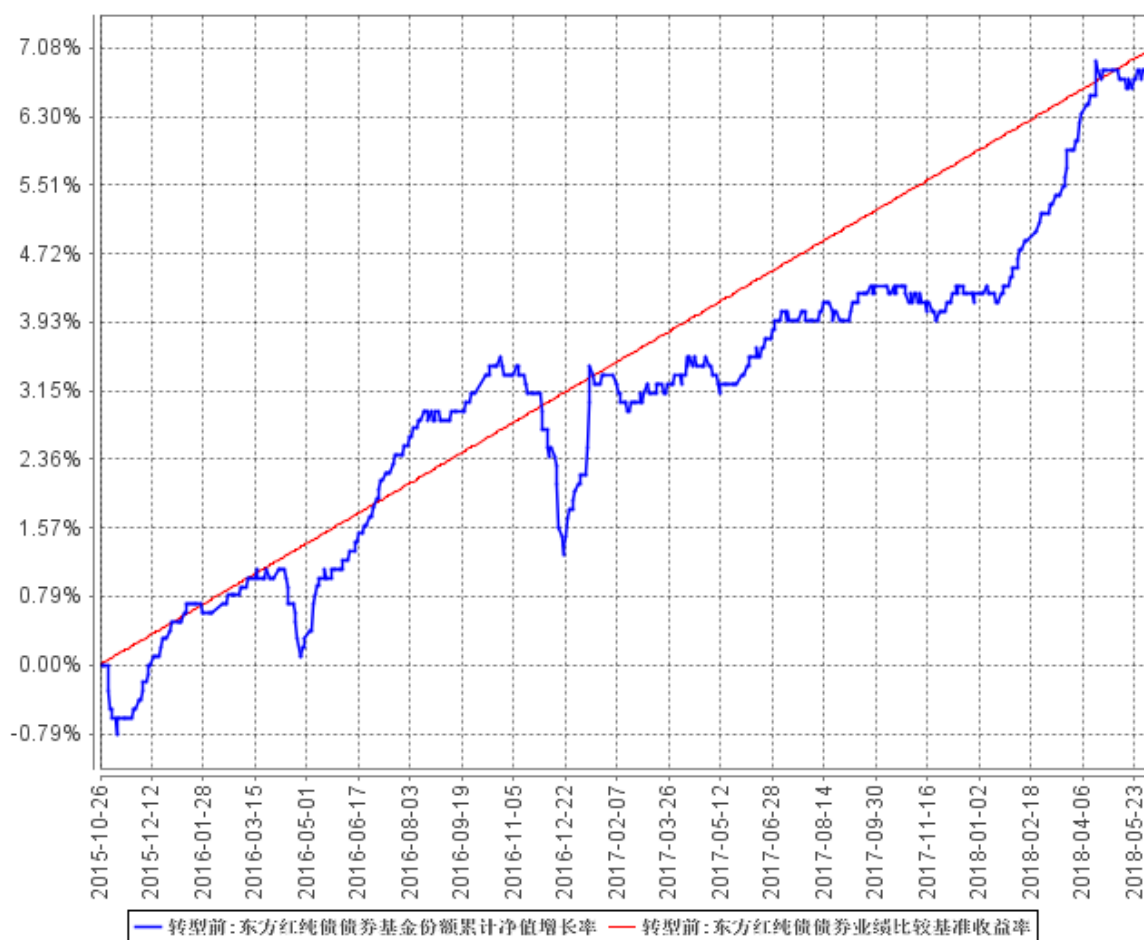
其中，t=1, 2, 3, ... T, T 表示时间截至日；

t 日至 T 日的期间收益率（benchmark）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_{Tt} = \prod_{t=T}^t \text{benchmark}_t$$

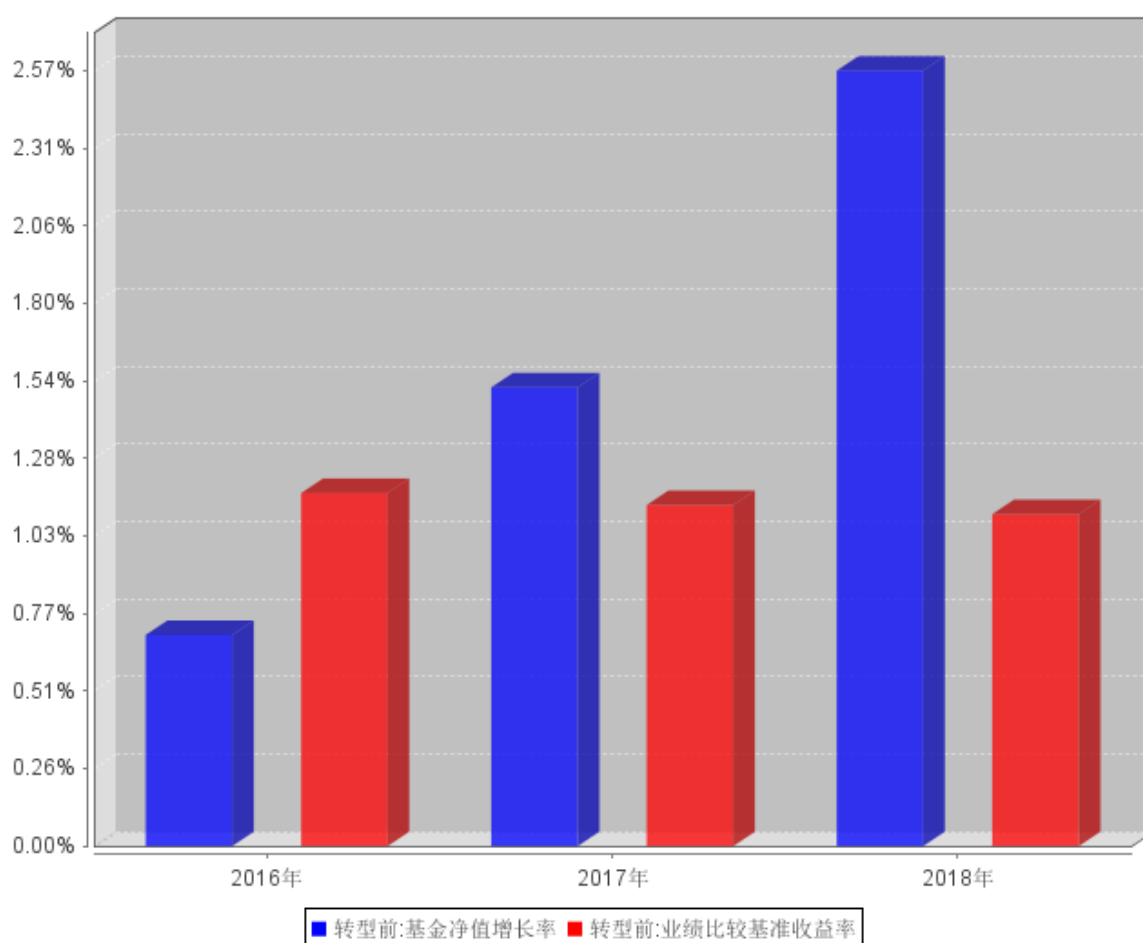
其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=T}^t \text{benchmark}_t$ 表示 t 日至 T 日的 benchmark 数学连乘。

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 7 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2015 年 10 月 26 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型后

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额 分红数 | 现金形式发放 总额 | 再投资形式发 放总额 | 年度利润分配合 计 | 备注 |
|------|-----------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2018 | 0.1140 | 11,688,976.98 | - | 11,688,976.98 | |
| 合计 | 0.1140 | 11,688,976.98 | - | 11,688,976.98 | |

转型前

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额 分红数 | 现金形式发放 总额 | 再投资形式发 放总额 | 年度利润分配合 计 | 备注 |
|------|-----------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2017 | - | - | - | - | |
| 2016 | 0.3200 | 32,288,319.61 | 1,232.69 | 32,289,552.30 | |

| | | | | | |
|----|--------|---------------|----------|---------------|--|
| 合计 | 0.3200 | 32,288,319.61 | 1,232.69 | 32,289,552.30 | |
|----|--------|---------------|----------|---------------|--|

§ 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（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、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、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金三十五只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

| 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 | 2015 年 10 月 26 日 | - | 12 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、东方红战略精选混合、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混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 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基金经理。 | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

| 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 | 2015年10月26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 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | <p>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 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、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深</p> | | | | <p>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、东方红战略精选混合、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混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 定期开放 混合型发 起式证券 投资基金 基金经 理。 | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

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

原则的交易行为。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年市场主线由年初的金融监管切换到信用环境收缩、经济基本面持续下滑、中美贸易摩擦持续；货币政策则全面转向宽松，年内多次降准。全年来看，债券市场强劲上涨，无风险利率大幅下行；但在“紧信用”政策影响下，企业再融资难度加大、违约事件不断，信用债表现分化、信用利差大幅走扩。全年 10 年国债收益率下行达 70BP，回落至 3.2%附近，10 年国开收益率下行超 120BP，回落至 3.6%附近。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，努力获取稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 7 日（2018.1.1-2018.6.7），东方红纯债债券型发起式证券投资基金份额净值为 1.036 元，份额累计净值为 1.068 元，份额净值增长率为 2.68%，同期业绩比较基准增长率为 1.27%。截至 2018 年 12 月 31 日（2018.6.8-2018.12.31），东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金份额净值为 1.0772 元，份额累计净值为 1.1206 元，份额净值增长率为 5.08%，同期业绩比较基准增长率为 0.05%。

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 2019 年基本面及货币政策环境对债券市场仍然有利，较为宽松资金面以及较低的回购利率使得债券票息收益更为确定，杠杆票息策略将可能继续提供丰厚的回报。利率债下行趋势不变，但在“稳增长”政策不断的情况下，市场就政策面和经济基本面的博弈持续，从而导致利率债下行空间缩窄、波动加大。信用债方面，虽然信用环境改善、市场风险偏好有所提升、信用利差有所压缩，但宽信用短期的传导效果仍有待观察，且 2019 年基本面下行风险或将取代杠杆风

险，成为信用债市场更需要关注的核心因素。因此操作上仍需维持个券精细化操作。

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》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。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员由投资、研究、运营、合规、风控等相关业务分管领导组成，运营业务分管领导为估值委员会主任委员，运营部是估值委员会的日常办事机构，运营部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。对于基金特殊估值调整事项，由估值委员会下设的估值业务工作小组提出调整方案并提交估值委员会审议，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、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金管理人于 2018 年 12 月 04 日发布《东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金分红公告》，每 10 份基金份额派发红利 0.114 元；本基金共计派发现金红利 11,688,976.98 元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告（转型后）

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师陈熹、叶尔甸签字出具了普华永道中天审字(2019)第 21602 号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§ 6 审计报告（转型前）

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师陈熹、叶尔甸签字出具了普华永道中天审字(2019)第 21601 号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---------------------------------|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 687,692.03 |
| 结算备付金 | 20,510,662.91 |
| 存出保证金 | 17,073.06 |
| 交易性金融资产 | 2,374,100,210.82 |
| 其中：股票投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 债券投资 | 2,351,679,566.00 |
| 资产支持证券投资 | 22,420,644.82 |
| 贵金属投资 | - |
| 衍生金融资产 | - |
| 买入返售金融资产 | 258,761,268.15 |
| 应收证券清算款 | - |
| 应收利息 | 37,148,233.60 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | - |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 2,691,225,140.57 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018 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 | 582,778,743.83 |
| 应付证券清算款 | - |
| 应付赎回款 | - |
| 应付管理人报酬 | 445,766.65 |
| 应付托管费 | 148,588.86 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应付交易费用 | 41,017.37 |
| 应交税费 | 14,398.12 |

| | |
|---------------|------------------|
| 应付利息 | 734,149.08 |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 190,000.00 |
| 负债合计 | 584,352,663.91 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 1,955,840,158.01 |
| 未分配利润 | 151,032,318.65 |
| 所有者权益合计 | 2,106,872,476.66 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,691,225,140.57 |

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0772 元，基金份额总额 1,955,840,158.01 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|
| 一、收入 | 66,632,799.88 |
| 1. 利息收入 | 37,528,706.44 |
| 其中：存款利息收入 | 297,611.89 |
| 债券利息收入 | 32,530,559.47 |
| 资产支持证券利息收入 | 492,628.16 |
| 买入返售金融资产收入 | 4,207,906.92 |
| 其他利息收入 | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 6,754,470.46 |
| 其中：股票投资收益 | - |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | 6,754,470.46 |
| 资产支持证券投资收益 | - |
| 贵金属投资收益 | - |
| 衍生工具收益 | - |
| 股利收益 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 22,349,622.98 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | - |

| | |
|----------------------------|---------------|
| 减：二、费用 | 10,302,628.95 |
| 1. 管理人报酬 | 1,976,309.30 |
| 2. 托管费 | 658,769.75 |
| 3. 销售服务费 | - |
| 4. 交易费用 | 12,517.84 |
| 5. 利息支出 | 7,441,656.45 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 7,441,656.45 |
| 6. 税金及附加 | 10,477.14 |
| 7. 其他费用 | 202,898.47 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 56,330,170.93 |
| 减：所得税费用 | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 56,330,170.93 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | | |
|--|---|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 60,123,593.77 | 2,135,315.08 | 62,258,908.85 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 56,330,170.93 | 56,330,170.93 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | 1,895,716,564.24 | 104,255,809.62 | 1,999,972,373.86 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,895,741,299.90 | 104,256,700.10 | 1,999,998,000.00 |
| 2. 基金赎回款(以“-”号填列) | -24,735.66 | -890.48 | -25,626.14 |
| 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) | - | -11,688,976.98 | -11,688,976.98 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,955,840,158.01 | 151,032,318.65 | 2,106,872,476.66 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|-----------|-----------|
| <u>潘鑫军</u> | <u>任莉</u> | <u>詹朋</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原东方红纯债债券型发起式证券投资基金(以下简称“东方红纯债基金”)转型而来。东方红纯债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[2015]2168 号《关于准予东方红纯债债券型发起式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《东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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人民币 210,217,687.88 元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)信会师报字[2015]第 115423 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 10 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 210,227,150.73 份,其中认购资金利息折合 9,462.85 份基金份额。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。

根据东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决通过的《关于东方红纯债债券型发起式证券投资基金转型及修订基金合同相关事项的议案》,修订和更新后的《东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》及其他法律文件自 2018 年 6 月 8 日起生效。

本基金以定期开放的方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自每一个开放期结束之日次日起(包括该日)6 个月的期间内,本基金采取封闭运作模式。自基金合同生效日起(包括该日)或每个封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日),本基金即进入开放期,开放期的期限为 3 至 10 个工作日,具体期间由基金管理人提前公告说明,但在开放期内,基金管理人有权延长开放期时间并公告,但开放期最长不可超过 10 个工作日。开放期内,本基金采取开放运作模式,投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,450.04 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券

投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、债券逆回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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)。本基金不参与股票、权证等益类资产的投资。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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产的投比例范围为：投资债券的比例不低于基金资产的 80%；但为开放期流动性需要，保护基金份额持有人利益，在每次开放期前十个交易日、开放期及开放期结束后十个交易日的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为中债综合指数收益率*80%+同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率*20%。

7.4.2 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 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 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 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持

证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债

券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)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、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，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。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[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，包括买卖债券的差价收入，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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 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。

7.4.8 关联方关系

| 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”） | 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 |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”） | 基金管理人的股东 |

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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | |
|-------|---|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 |
| 东方证券 | 524,346,203.54 | 91.65% |

7.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | |
|-------|---|--------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 |
| 东方证券 | 14,767,900,000.00 | 79.68% |

7.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期未发生应支付关联方的佣金。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|---|
| | 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,976,309.30 |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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，本基金本报告期内无应支付给销售机构的客户维护费。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|---|
| | 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 658,769.75 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | |
|-----------------------|---|--|
| | 2018 年 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | |
| 基金合同生效日持有的基金份额 | 10,000,450.04 | |
| 期初持有的基金份额 | 10,000,450.04 | |
| 期间申购/买入总份额 | - | |
| 期间因拆分变动份额 | - | |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | |
| 期末持有的基金份额 | 10,000,450.04 | |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 0.5113% | |

7.4.9.4.2 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

于本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.9.5 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 6 月 8 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 687,692.03 | 189,471.79 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.10 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.10.2 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等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金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 330,778,743.83 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|----------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 1820069 | 18 南京银行 04 | 2019 年 1 月 4 日 | 100.82 | 948,000 | 95,577,360.00 |
| 1820039 | 18 南京银行 02 | 2019 年 1 月 4 日 | 102.19 | 198,000 | 20,233,620.00 |
| 1820049 | 18 贵阳银行绿色金融 01 | 2019 年 1 月 4 日 | 101.36 | 520,000 | 52,707,200.00 |
| 101564009 | 15 湘高速 MTN001 | 2019 年 1 月 3 日 | 102.68 | 230,000 | 23,616,400.00 |
| 170404 | 17 农发 04 | 2019 年 1 月 2 日 | 100.81 | 500,000 | 50,405,000.00 |
| 180304 | 18 进出 04 | 2019 年 1 月 2 日 | 102.48 | 500,000 | 51,240,000.00 |
| 111899419 | 18 晋商银行 CD105 | 2019 年 1 月 3 日 | 95.88 | 500,000 | 47,940,000.00 |
| 合计 | | | | 3,396,000 | 341,719,580.00 |

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本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 252,000,000.00 元，截至 2019 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

7.4.11 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 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二层次的余额为 2,351,679,566.00 元，属于第三层次的余额为 22,420,644.82 元，无属于第一层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 70,852,237.00，无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

(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 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：东方红纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 7 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018 年 6 月 7 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------------------|--|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 4,954,186.28 | 225,609.57 |
| 结算备付金 | 2,133,401.66 | 998,856.74 |
| 存出保证金 | 2,859.81 | 4,961.41 |
| 交易性金融资产 | 76,657,641.50 | 70,852,237.00 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 76,657,641.50 | 70,852,237.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 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 | - | - |
| 应收利息 | 1,602,327.88 | 1,883,375.79 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 85,350,417.13 | 73,965,040.51 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018 年 6 月 7 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 | 18,300,000.00 | 13,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | 4,702,125.49 | 25,121.58 |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 3,580.26 | 15,475.42 |
| 应付托管费 | 1,193.42 | 5,158.47 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | - | - |
| 应交税费 | 15,349.81 | - |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 应付利息 | - | -6,280.38 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 69,259.30 | 180,000.00 |
| 负债合计 | 23,091,508.28 | 13,219,475.09 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 60,123,593.77 | 60,143,593.77 |
| 未分配利润 | 2,135,315.08 | 601,971.65 |
| 所有者权益合计 | 62,258,908.85 | 60,745,565.42 |
| 负债和所有者权益总计 | 85,350,417.13 | 73,965,040.51 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 7 日，基金份额净值 1.036 元，基金份额总额 60,123,593.77 份。

7.2 利润表

会计主体：东方红纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 7 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 7 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|--|
| 一、收入 | 2,096,397.49 | 4,840,943.66 |
| 1. 利息收入 | 1,728,051.05 | 4,052,617.44 |
| 其中：存款利息收入 | 19,042.68 | 181,554.31 |
| 债券利息收入 | 1,708,720.50 | 3,575,454.72 |
| 资产支持证券利息收入 | - | 279,523.28 |
| 买入返售金融资产收入 | 287.87 | 16,085.13 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | -258,448.08 | -8,569,583.10 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -258,448.08 | -8,832,168.77 |
| 资产支持证券投资收益 | - | 262,585.67 |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 626,794.52 | 9,357,909.26 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | - | 0.06 |
| 减：二、费用 | 562,874.06 | 924,644.06 |

| | | |
|----------------------------|---------------------|---------------------|
| 1. 管理人报酬 | 79,911.37 | 264,746.29 |
| 2. 托管费 | 26,637.16 | 88,248.78 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 280.55 | 6,049.86 |
| 5. 利息支出 | 352,530.09 | 344,598.29 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 352,530.09 | 344,598.29 |
| 6. 税金及附加 | 3,928.26 | - |
| 7. 其他费用 | 99,586.63 | 221,000.84 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 1,533,523.43 | 3,916,299.60 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 1,533,523.43 | 3,916,299.60 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 7 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 7 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） | 60,143,593.77 | 601,971.65 | 60,745,565.42 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,533,523.43 | 1,533,523.43 |
| 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） | -20,000.00 | -180.00 | -20,180.00 |
| 2. 基金赎回款 | -20,000.00 | -180.00 | -20,180.00 |
| 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） | 60,123,593.77 | 2,135,315.08 | 62,258,908.85 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,009,029,692.76 | -12,326,373.27 | 996,703,319.49 |

| | | | |
|--|-----------------|--------------|-----------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 3,916,299.60 | 3,916,299.60 |
| 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） | -948,886,098.99 | 9,012,045.32 | -939,874,053.67 |
| 其中：1. 基金申购款 | 49,999,000.00 | - | 49,999,000.00 |
| 2. 基金赎回款 | -998,885,098.99 | 9,012,045.32 | -989,873,053.67 |
| 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） | 60,143,593.77 | 601,971.65 | 60,745,565.42 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|-----------|-----------|
| <u>潘鑫军</u> | <u>任莉</u> | <u>詹朋</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方红纯债债券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[2015]2168号《关于准予东方红纯债债券型发起式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《东方红纯债债券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人民币210,217,687.88元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)信会师报字[2015]第115423号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于2015年10月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,227,150.73份,其中认购资金利息折合9,462.85份基金份额。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。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,450.04份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、地方

政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、分离交易可转债的纯债部分、债券逆回购、银行存款等固定收益类资产、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)。本基金不参与股票、权证等权益类资产的投资,可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。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,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金各类资产的投比例范围为:投资债券的比例不低于基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率+1.2%。

7.4.2 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》、《东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 6 月 7 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 7 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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和会计估计与最近一期年度会计报表相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[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 6 月 8 日（基金合同生效日）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 6 月 8 日（基金合同生效日）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，包括买卖债券的差价收入，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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 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。

7.4.8 关联方关系

| 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”） | 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 |

| | |
|--------------------|----------|
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”） | 基金管理人的股东 |
|--------------------|----------|

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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.9.1.2 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7日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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 | 41,801,990.51 | 89.74% | 452,726,425.41 | 97.80% |

7.4.9.1.3 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7日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | |
|-------|---------------------------|----------------------------|----------------------------------|----------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的 比例 |
| 东方证券 | 2,136,300,000.00 | 99.96% | 1,759,100,000.00 | 100.00% |

7.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生应支付关联方的佣金。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 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7日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31 日 |
|--------------------|-------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付 的管理费 | 79,911.37 | 264,746.29 |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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，本基金本报告期及上年度可比期间无应支付给销售机构的客户维护费。

7.4.9.2.2 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 7 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 26,637.16 | 88,248.78 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.9.3 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。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 7 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 基金合同生效日持有的基金份额 | 10,000,450.04 | 10,000,450.04 |
| 期初持有的基金份额 | 10,000,450.04 | 10,000,450.04 |

| | | |
|-----------------------|---------------|---------------|
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 10,000,450.04 | 10,000,450.04 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 16.6331% | 16.6276% |

7.4.9.4.2 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。

7.4.9.5 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7日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | |
|-------|---------------------------|----------|----------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 4,954,186.28 | 5,391.91 | 225,609.57 | 163,557.08 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.10 期末（2018年6月7日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 7 日，本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 18,300,000.00 元，于 2018 年 6 月 8 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

7.4.11 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 7 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二层次的余额为 76,657,641.50 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 70,852,237.00，无属于第一层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的债券，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 7 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告（转型后）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,374,100,210.82 | 88.22 |
| | 其中：债券 | 2,351,679,566.00 | 87.38 |
| | 资产支持证券 | 22,420,644.82 | 0.83 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 258,761,268.15 | 9.61 |
| | 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 | 21,198,354.94 | 0.79 |
| 8 | 其他各项资产 | 37,165,306.66 | 1.38 |
| 9 | 合计 | 2,691,225,140.57 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金不参与股票投资。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金不参与股票投资。

8.2.3 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

本基金不参与股票投资。

8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

8.3.1 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

本基金不参与股票投资。

8.3.2 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

本基金不参与股票投资。

8.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金不参与股票投资。

8.4 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 | 1,866,606,200.00 | 88.60 |
| | 其中：政策性金融债 | 173,695,000.00 | 8.24 |
| 4 | 企业债券 | 17,402,366.00 | 0.83 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 102,310,000.00 | 4.86 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 365,361,000.00 | 17.34 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,351,679,566.00 | 111.62 |

8.5 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 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|---------|----------------|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 1820072 | 18 贵州银行绿色金融 01 | 1,800,000 | 179,568,000.00 | 8.52 |
| 2 | 1820069 | 18 南京银行 04 | 1,600,000 | 161,312,000.00 | 7.66 |
| 3 | 1820086 | 18 厦门国际银行 | 1,300,000 | 129,974,000.00 | 6.17 |
| 4 | 1822008 | 18 建信租赁债 01 | 1,000,000 | 102,810,000.00 | 4.88 |
| 4 | 1822018 | 18 兴业租赁债 01 | 1,000,000 | 102,810,000.00 | 4.88 |
| 5 | 1820022 | 18 甘肃银行三农债 01 | 1,000,000 | 102,300,000.00 | 4.86 |

8.6 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 | 149598 | 华鑫融 | 224,000 | 22,420,644.82 | 1.06 |

| | | | | |
|--|--|----|--|--|
| | | 1A | | |
|--|--|----|--|--|

8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.8 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

本基金不参与权证投资。

8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.9.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.9.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1

本基金持有的 18 厦门银行 02（代码：1820018）发行主体厦门银行股份有限公司，其福州分行因存在贷前调查未尽职等问题，中国银监会福建监管局于 2018 年 6 月 5 日对福州分行作出处罚决定（闽银监罚决字（2018）13 号），处以 50 万元罚款。

本基金持有的 18 贵阳银行绿色金融 01（代码：1820049）发行主体贵阳银行股份有限公司及其南明支行、双龙航空港支行，因自有资金通过投资资管计划和私募股权基金等通道向企业进行股权投资等问题，中国银监会贵州监管局于 2018 年 11 月 20 日作出处罚决定，被处罚款合计 150 万元。

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。

8.10.2

本基金不参与股票投资。

8.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 17,073.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 37,148,233.60 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 37,165,306.66 |

8.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

8.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不参与股票投资。

8.10.6 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 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 76,657,641.50 | 89.82 |
| | 其中：债券 | 76,657,641.50 | 89.82 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 7,087,587.94 | 8.30 |
| 8 | 其他资产 | 1,605,187.69 | 1.88 |
| 9 | 合计 | 85,350,417.13 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金不参与股票投资。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金不参与股票投资。

8.3 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

本基金不参与股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金不参与股票投资。

8.4.2 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

本基金不参与股票投资。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金不参与股票投资。

8.5 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 | 27,043,700.00 | 43.44 |
| | 其中：政策性金融债 | 23,113,700.00 | 37.13 |
| 4 | 企业债券 | 49,613,941.50 | 79.69 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 76,657,641.50 | 123.13 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 170206 | 17 国开 06 | 200,000 | 19,712,000.00 | 31.66 |
| 2 | 136544 | 16 联通 03 | 48,000 | 4,723,200.00 | 7.59 |
| 3 | 136501 | 16 天风 01 | 40,000 | 3,930,000.00 | 6.31 |
| 4 | 018005 | 国开 1701 | 34,000 | 3,401,700.00 | 5.46 |
| 5 | 111050 | 09 华菱债 | 30,000 | 3,007,200.00 | 4.83 |

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金不参与权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

本基金不参与股票投资。

8.11.3 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 | 2,859.81 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,602,327.88 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,605,187.69 |

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不参与股票投资。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|----------------|------------------|--------|-----------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 3 | 651,946,719.34 | 1,955,740,749.94 | 99.99% | 99,408.07 | 0.00% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00 | 0.0000% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,450.04 | 0.51 | 10,000,450.04 | 0.51 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,450.04 | 0.51 | 10,000,450.04 | 0.51 | 3年 |

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|---------------|---------------|--------|------------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 4 | 15,030,898.44 | 59,999,450.04 | 99.79% | 124,143.73 | 0.21% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.00 | 0.0000% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2018年6月8日)基金份额总额 | 60,123,593.77 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 1,895,741,299.90 |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 24,735.66 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,955,840,158.01 |

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

| | |
|---------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2015 年 10 月 26 日)基金份额总额 | 210,227,150.73 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 60,143,593.77 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 20,000.00 |
| 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 | 60,123,593.77 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 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《关于东方红纯债债券型发起式证券投资基金转型及修订基金合同相关事项的议案》。大会表决投票时间自 2018 年 4 月 4 日起，至 2018 年 5 月 2 日 17:00 时止。

本次基金份额持有人大会通过了《关于东方红纯债债券型发起式证券投资基金转型及修订基金合同相关事项的议案》，2018 年 5 月 4 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 3 月 8 日发布公告，陈光明同志辞去公司董事长职务，由潘鑫军同志担任公司董事长；于 2018 年 5 月 11 日发布公告，同意林鹏同志担任公司副总经理；于 2018 年 11 月 14 日发布公告，同意汤琳同志担任公司副总经理。

本基金管理人于 2018 年 7 月 21 日发布公告，唐涵颖同志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，于 2018 年 12 月 12 日发布公告，同意李云亮同志担任公司督察长，公司总经理任莉不再代行督察长职务。

本基金本报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是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 2017 年度起为本基金提供审计服务至今。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 9 万元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 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。本基金本报告期未发生应支付关联方的佣金。

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为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。（2）选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

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

4、本基金本报告期内租用交易单元的变更情况：新增招商证券 1 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | 524,346,203.54 | 91.65% | 14,767,900,000.00 | 79.68% | - | - |
| 宏信证券 | - | - | 315,400,000.00 | 1.70% | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---------------|-------|------------------|--------|---|---|
| 国盛证券 | 47,779,293.91 | 8.35% | 2,979,800,000.00 | 16.08% | - | - |
| 招商证券 | - | - | 471,800,000.00 | 2.55% | - | - |

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 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。本基金本报告期未发生应支付关联方的佣金。

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为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。（2）选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

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

4、本基金本报告期内租用交易单元的变更情况：新增国盛证券 1 个交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | 41,801,990.51 | 89.74% | 2,136,300,000.00 | 99.96% | - | - |
| 宏信证券 | 4,780,405.27 | 10.26% | 800,000.00 | 0.04% | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |

11.9 其他重大事件（转型后）

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|----------------------------|-----------------|
| 1 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 6 月 8 日 |
| 2 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金首个开放期开放申购、赎回业务的公告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 6 月 8 日 |
| 3 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 6 月 8 日 |
| 4 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 6 月 8 日 |
| 5 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 6 月 20 日 |
| 6 | 上海东方证券资产管理有限公司旗下基金 2018 年 6 月 30 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 | 2018 年 7 月 2 日 |
| 7 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2018 年第 2 季度报告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 7 月 19 日 |
| 8 | 上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站 | 2018 年 7 月 21 日 |

| | | | |
|----|---|----------------------------|------------------|
| 9 | 上海东方证券资产管理有限公司关于在网上直销开通汇款交易业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 8 月 16 日 |
| 10 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告 | 公司网站 | 2018 年 8 月 27 日 |
| 11 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2018 年半年度报告(摘要) | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 8 月 27 日 |
| 12 | 上海东方证券资产管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 8 月 29 日 |
| 13 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 9 月 25 日 |
| 14 | 上海东方证券资产管理有限公司关于调整旗下全部证券投资基金在直销柜台首次认/申购、追加认/申购最低金额的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 10 月 18 日 |
| 15 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2018 年第 3 季度报告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 10 月 24 日 |
| 16 | 上海东方证券资产管理有限公司关于新增基金高级管理人员的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 11 月 24 日 |
| 17 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金分红公告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 12 月 4 日 |

| | | | |
|----|--|----------------------------|------------------|
| 18 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2018 年第 1 号） | 公司网站 | 2018 年 12 月 6 日 |
| 19 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2018 年第 1 号） | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 12 月 6 日 |
| 20 | 东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 12 月 8 日 |
| 21 | 上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 12 月 12 日 |
| 22 | 关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 12 月 21 日 |

11.9 其他重大事件（转型前）

| 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 2017 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 | 2018 年 1 月 2 日 |
| 2 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金 2017 年第 4 季度报告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 1 月 19 日 |
| 3 | 上海东方证券资产管理有限公司关于董事长变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 3 月 8 日 |
| 4 | 关于上海东方证券资产管理有限公司旗下部分基金修改基金合同和托管协议的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 3 月 23 日 |
| 5 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金合同 | 公司网站 | 2018 年 3 月 23 日 |
| 6 | 东方红纯债债券型发起式证券 | 公司网站 | 2018 年 3 月 23 日 |

| | 投资基金托管协议 | | |
|----|--|----------------------------|-----------------|
| 7 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金 2017 年年度报告 | 公司网站 | 2018 年 3 月 29 日 |
| 8 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金 2017 年年度报告 (摘要) | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 3 月 29 日 |
| 9 | 关于召开东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会 (通讯方式) 的公告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 4 月 3 日 |
| 10 | 关于召开东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会 (通讯方式) 的第一次提示性公告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 4 月 4 日 |
| 11 | 关于召开东方红纯债债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会 (通讯方式) 的第二次提示性公告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 4 月 9 日 |
| 12 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金 2018 年第 1 季度报告 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 4 月 23 日 |
| 13 | 上海东方证券资产管理有限公司关于东方红纯债债券型发起式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 | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 5 月 8 日 |
| 14 | 上海东方证券资产管理有限公司关于新增基金高级管理人员的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2018 年 5 月 11 日 |
| 15 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书 (更新) (2018 年第 1 号) | 公司网站 | 2018 年 6 月 6 日 |
| 16 | 东方红纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书 (更新) (摘要) (2018 年第 1 号) | 中国证券报和公司网站 | 2018 年 6 月 6 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 | 20180101-20181231 | 49,999,000.00 | 1,895,741,299.90 | - | 1,945,740,299.90 | 99.48% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金由于存在单一投资者份额集中度较高的情况，可能存在巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力；基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金份额集中度的影响，同时将完善流动性风险控制机制，加强对基金持有人利益的保护。</p> | | | | | | | |

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

上海东方证券资产管理有限公司

2019 年 3 月 27 日