

---

# 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式 证券投资基金 2017 年年度报告

2017 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：2018 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 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。

本报告期自 2017 年 4 月 14 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| 3.3 其他指标.....                                | 10        |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 10        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 13        |
| 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.....             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 15        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 16        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 17        |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 17        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 18        |
| 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..... | 18        |
| 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.....      | 18        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>19</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 19        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 19        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>22</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 22        |
| 7.2 利润表.....                                 | 23        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 24        |
| 7.4 报表附注.....                                | 25        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>52</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 52        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 52        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 53        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 54        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 56        |
| 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.....      | 56        |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 57        |
| 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 ..... | 57        |
| 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 .....    | 57        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 57        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 57        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 57        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>59</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 59        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 59        |
| 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 .....     | 59        |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 59        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>60</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>61</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 61        |
| 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 .....      | 61        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 61        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 61        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 61        |
| 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 .....         | 61        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 62        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 63        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>66</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 66        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 66        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 66        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |  |
|------------|--|
| 基金名称       | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金                       |
| 基金简称       | 东方红智逸沪港深定开混合                                   |
| 基金主代码      | 004278   |
| 前端交易代码     | 004278   |
| 基金运作方式     | 契约型、开放式、发起式，本基金以定期开放方式运作，即以运作周期和到期开放期相结合的方式运作。 |
| 基金合同生效日    | 2017 年 4 月 14 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 | 1,482,644,340.03 份                             |
| 基金合同存续期    | 不定期  |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在追求基金资产长期安全的基础上，为基金份额持有人获取稳定的投资收益，追求超越业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资策略   | 本基金以 36 个月为一个运作周期，以长期投资的理念进行大类资产的配置和个券选择，运用封闭期无流动性需求的优势，同时，充分考虑每个运作周期中期间开放期的安排，在股票的配置上，以时间换空间，采用低风险投资策略，为本基金获得更高的低风险收益；在债券配置上，合理配置久期匹配债券的结构，做好流动性管理，以期获得更高的投资收益。                         |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%。  |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|
|----|-------|-------|

|         |                               |                          |                        |
|---------|-------------------------------|--------------------------|------------------------|
| 名称      | 上海东方证券资产管理有<br>限公司            | 招商银行股份有限公司               |                        |
| 信息披露负责人 | 姓名                            | 唐涵颖                      | 张燕                     |
|         | 联系电话                          | 021-63325888             | 0755-83199084          |
|         | 电子邮箱                          | service@dfham.com        | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话  | 4009200808                    | 95555                    |                        |
| 传真      | 021-63326981                  | 0755-83195201            |                        |
| 注册地址    | 上海市黄浦区中山南路 318<br>号 31 层      | 深圳市深南大道 7088 号招商银<br>行大厦 |                        |
| 办公地址    | 上海市黄浦区中山南路 318<br>号 2 号楼 31 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银<br>行大厦 |                        |
| 邮政编码    | 200010                        | 518040                   |                        |
| 法定代表人   | 潘鑫军（授权代表）                     | 李建红                      |                        |

## 2.4 信息披露方式

|                         |  |
|-------------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称          | 中国证券报，上海证券报  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网<br>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<br>318 号 2 号楼 31 层<br>招商银行股份有限公司 深圳市深南大道 7088 号招<br>商银行大厦 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                       | 办公地址                                   |
|--------|--------------------------|--|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊<br>普通合伙) | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企<br>业广场二座普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司           | 中国北京市西城区太平桥大街 17 号                     |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日 |
|---------------|---|
| 本期已实现收益       | 91,708,183.87                             |
| 本期利润          | 225,551,290.34                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1521                                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 14.13%                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 15.21%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末                                   |
| 期末可供分配利润      | 91,708,183.87                             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0619                                    |
| 期末基金资产净值      | 1,708,195,630.37                          |
| 期末基金份额净值      | 1.1521                                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2017 年末                                   |
| 基金份额累计净值增长率   | 15.21%                                    |

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、本基金基金合同于 2017 年 4 月 14 日生效；

5、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日；“本期”指 2017 年 4 月 14 日-2017 年 12 月 31 日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 4.68%    | 0.49%       | 1.05%      | 0.22%         | 3.63%  | 0.27% |
| 过去六个月      | 9.11%    | 0.37%       | 2.58%      | 0.19%         | 6.53%  | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 15.21%   | 0.34%       | 3.53%      | 0.19%         | 11.68% | 0.15% |

注：1、自基金合同生效日起至今指 2017 年 4 月 14 日-2017 年 12 月 31 日。

2、根据基金合同有关规定，本基金合同生效后三年内（含三年）为封闭期，本基金在封闭期内的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后），其中，三年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构三年期人民币存款基准利率。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，封闭期内 t 日收益率（ $\text{benchmark}_t^T$ ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 100\% * [t \text{ 日三年期银行定期存款利率（税后）} / 365]$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ，T 表示时间截至日；

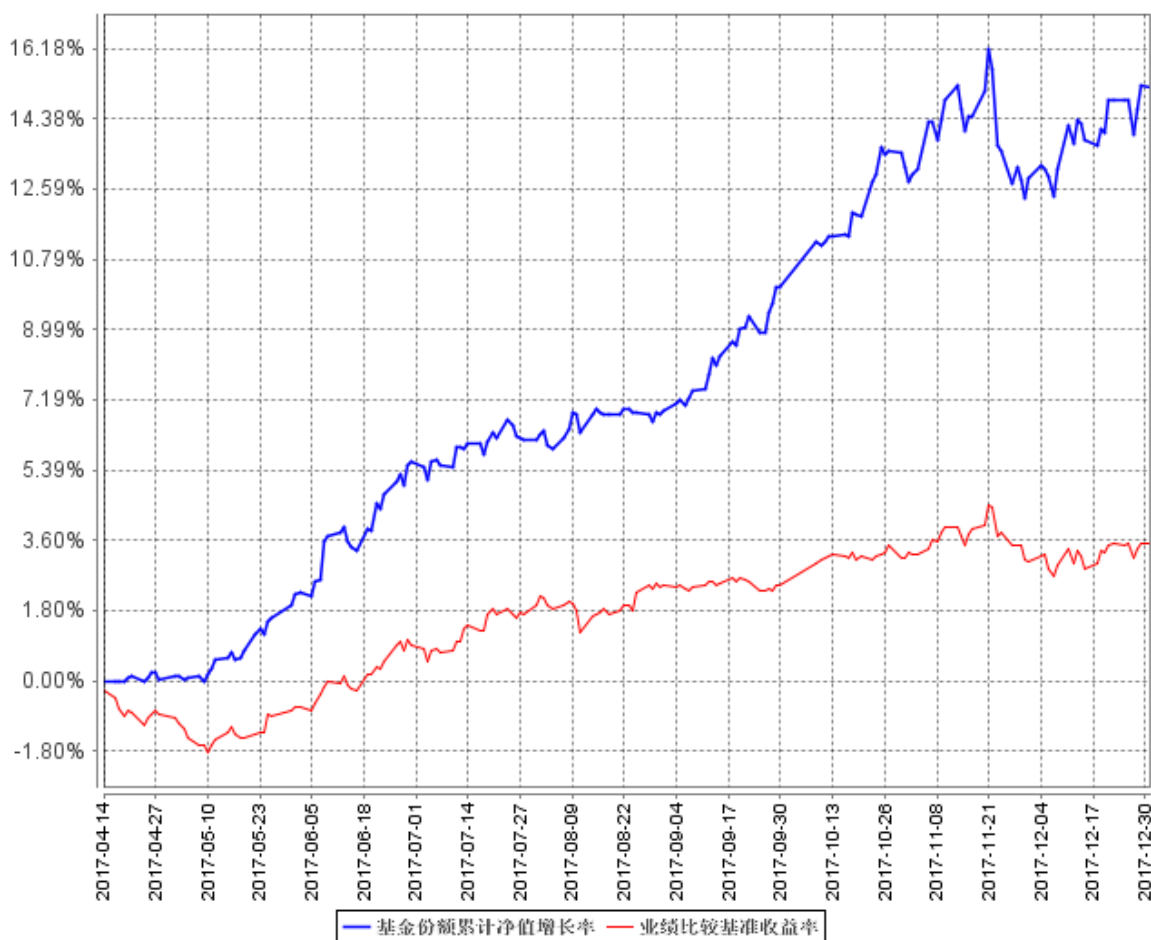
t 日至 T 日的期间收益率（ $\text{benchmark}_t^T$ ）按下列公式计算：

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

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示 t 日至 T 日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。



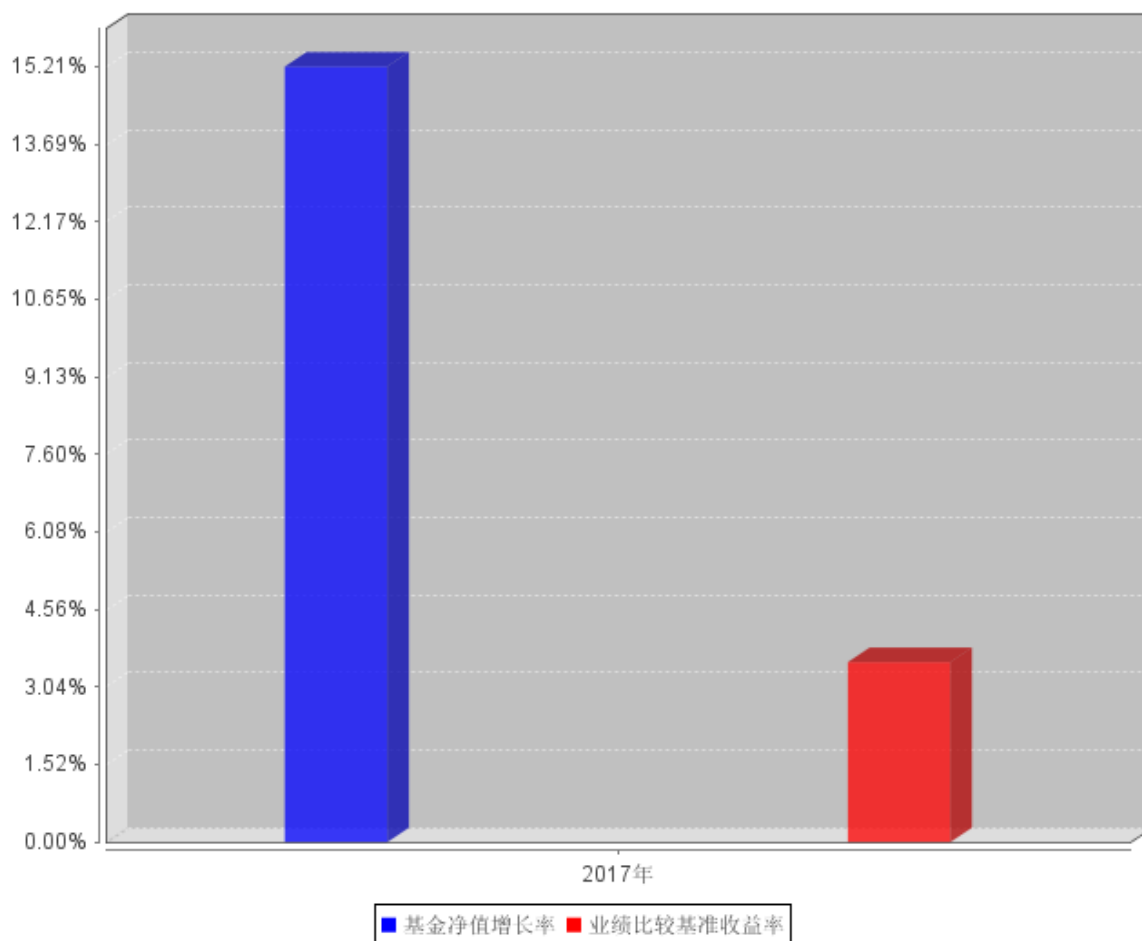
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：（1）截止日期为 2017 年 12 月 31 日。

（2）本基金建仓期 6 个月，即从 2017 年 4 月 14 日起至 2017 年 10 月 13 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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



注：1、本基金合同生效日期为 2017 年 4 月 14 日。

2、本图所示时间区间为 2017 年 4 月 14 日至 2017 年 12 月 31 日。

3、合同生效日当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

#### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2017 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、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、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、东方红货币市场基金三十只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                   |
|----|----------------------|-----------------|------|--------|----------------------|
|    |                      | 任职日期            | 离任日期 |        |                      |
| 周云 | 上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资 | 2017 年 4 月 14 日 | -    | 10 年   | 博士，曾任东方证券股份有限公司资产管理业 |

|     |   |            |   |     |  |
|-----|---|------------|---|-----|--|
|     | 部副总经理兼任东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、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。  |            |   |     | 务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资主办人，权益研究部高级研究员、投资主办人。现任上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资部副总经理兼任东方红新动力混合、东方红京东大数据混合、东方红睿满沪港深混合、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。                 |
| 刚登峰 | 东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、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。   | 2017年4月28日 | - | 9年  | 硕士，曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资经理助理、资深研究员、投资主办人；现任东方红优势精选混合、东方红睿轩沪港深混合、东方红优享红利混合、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。                            |
| 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 | 2017年4月28日 | - | 11年 | 硕士，曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理，德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理，上海东方证券资产管理有限公司固定收益部副总监；现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理兼任东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红纯债债券、东方红收益增强债券、 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  | 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、东方红货币市场基金基金经理。 |  |  |  | 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、东方红货币基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定，公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统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

2017 年权益市场分化较大，全年上证综指上涨 6.56%，深证成指上涨 8.48%，沪深 300 上涨 21.78%，创业板指下跌 10.67%。2017 年权益市场的结构性行情的特点突出，不同公司之间股价表现差异较大，一些竞争优势明显、估值合理的优质龙头公司全年实现了较大幅度的上涨；而相反一些公司质地一般、之前估值偏高的一些公司则出现了持续的回调。本产品在个股选择上以业绩稳健增长且和估值合理的优质龙头企业为主，包括消费品行业龙头、竞争优势突出的制造业龙头以及一些受益供给侧收缩的周期性行业龙头等。同时根据宏观环境变化对仓位和配置方向进行适度调整，以起到降低组合波动、提升夏普比例的组合优化作用。同时也积极参与股票一级市场，获取无风险收益。

2017 年经济表现出了较强的韧性，供给侧改革带来大宗商品价格上涨，工业企业利润明显改善；金融去杠杆的主基调贯穿全年，货币政策实际上中性偏紧，公开市场操作利率两次上调，资金利率居高不下；此外海外市场经济复苏，货币政策也逐步趋紧。在此背景下，债券市场的走势整体超出了市场预期：10 年国债收益率最高至 4%，全年上行 100BP；10 年国开收益率最高至 5%，全年上行 130BP；3 年 AAA 信用债最高至 5.25%，全年上行 135BP；5 年 AAA 信用债最高至 5.4%，全年上行 140BP。全年中债总财富指数下跌 1.08%。本产品 in 债券配置上适时调仓，控制久期和杠杆，寻求稳健配置为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.1521 元，份额累计净值为 1.1521 元；报告期内，基金份额净值增长率为 15.21%，同期业绩比较基准收益率为 3.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 整体宏观经济呈现平稳回落的格局。房地产和基建投资逐渐下行，而制造业投资受益于企业盈利回升有所回暖，整体上固定资产投资增速全年逐渐回落。但在欧洲等海外经济体复苏的带动下，2017 年的出口表现超出了年初预期，对 GDP 带来了较多的正面贡献。展望 2018 年，经济环境预计仍将延续 17 年的趋势。通胀方面，2017 年由于食品价格的疲弱表现，CPI 全年水平较低，预计 2018 年会有所回升，而 PPI 在高基数影响下将逐渐回落。

权益方面，在盈利增速回落、货币政策维持中性的宏观环境下，预计 2018 年 A 股市场整体仍然呈震荡走势，投资上以把握结构性行情为主。2018 年仍将延续 2017 年偏好价值成长的风格，但在优质公司的估值水平经历了 2017 年的系统性提升后，2018 年市场将更加重视公司的业绩成长。我们在保持价值投资理念下，2018 年将着重关注以下几个方面的投资机会：一是继续配置一些估值仍在合理区间、基本面稳健的消费类价值股，业绩的稳定增长能给投资者带来稳健的长期回报；二是金融股估值仍处于较低区间，龙头公司具有一定的底仓配置价值；三是关注受益于供给侧改革的周期股龙头，在需求走弱、供给收缩的背景下，龙头公司受益于成本端优势和行业集中度提升，盈利能力有望明显改善；四是逐步开始关注业绩维持高增速、估值已逐渐回落至合理区间的一些优质新兴产业龙头公司。

债券方面，市场经历了 2017 年的大调整，市场对于基本面数据、海外因素以及监管因素等都反应了一定的预期，从配置角度而言，具备较好的性价比。展望 2018 年债市，上半年市场或处于高位震荡的态势，市场关注点仍然在于经济的韧性，从而引发对中周期的担心；下半年伴随基本面及通胀数据回落、监管政策的落地，市场或打开下行空间。操作上，我们认为当前债券配置价值提升，获得票息的概率明显上升，2018 年票息收益将是债券市场的绝对收益来源，同时资本损失也将有所下降。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人日常监察稽核工作主要由合规与风险管理部承担，2017 年开展了如下主要工作：

（一）切实履行日常监察稽核各项职责，保障公司经营管理活动的持续合规。

1、顺利完成了公司 2017 年相关审查、检查工作任务。2、及时完成公司各类合规与风险管理报告工作。3、积极对监管政策提出建议及意见。4、完善员工执业行为管理工作。5、完成反洗钱

各项工作。6、开展合规与风险管理培训与考试。

(二) 以公司全面风险管理体系架构为基础, 不断推进和完善风险管理工作。

1、在系统建制方面, 合规与风险管理部已完成对衡泰风控系统和恒生交易系统的各项风控测试。合规与风险管理部还修订和完善公司全面风险管理相关制度, 确定公司年度风险管理限额。2、在投资组合风控方面, 合规与风险管理部进一步细化了投资组合风险控制工作。

(三) 协调落实合规管理办法。

公司积极落实《证券公司和基金管理公司合规管理办法》及行业协会指引的有关要求, 更新公司章程, 制定或修订合规管理制度及配套细则, 强化合规管理机制, 将合规管理覆盖所有业务部门和全体工作人员, 并贯穿决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(四) 投资者适当性管理。

合规与风险管理部审查了业务部门制定的投资者适当性管理制度以及需修订的与投资者适当性管理相关的其他内部制度和操作流程, 合规与风险管理部还开展了专项稽核并提出整改建议, 进一步夯实了投资者适当性管理工作。

(五) 进一步加强了公司制度流程建设。

合规与风险管理部根据业务发展需要修订或启动修订了包括公司《全面风险管理基本制度》、《合规管理基本制度》等制度。同时, 合规与风险管理部与业务部门协同梳理了投资经理投资权限审批流程(股票、债券)等业务操作流程, 有效提升流程处理效率。

(六) 根据母子公司内部控制自查与更新工作方案, 完善内部控制建设。

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

(七) 持续支持公司创新业务发展。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会于 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》和《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止)等相关规定和基金合同的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值, 本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净



值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。基金管理人对外投资品种的估值程序及技术保持一致性原则，为确保估值程序和技术持续使用性，基金管理人建立了定期复核和审阅机制。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业资格，同时，公司设估值决策小组负责研究、指导和审议基金估值业务，成员包括：公司总经理、合规总监（督察长）、交易总监、运营总监、基金会计主管等。基金经理不参与基金日常估值业务，对于属于东证资管估值政策范围内的特殊估值变更可参与讨论，但最终决策由估值决策小组讨论决策并联名审批，保证基金估值的公平合理，保持估值政策和程序的一贯性。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%；
- 3、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；
- 4、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；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2018)第 20577 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题          | 审计报告   |
|-----------------|--|
| 审计报告收件人         | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见            | <p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称“东方红智逸沪港深定开基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了东方红智逸沪港深定开基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方红智逸沪港深定开基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>   |
| 强调事项            | 无  |
| 其他事项            | 无  |
| 其他信息            | 无  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>东方红智逸沪港深定开基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重</p>  |

|                        |  |
|------------------------|--|
|                        | <p>大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估东方红智逸沪港深定开基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算东方红智逸沪港深定开基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督东方红智逸沪港深定开基金的财务报告过程。</p>   |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对东方红智逸沪港深定开基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论</p> |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方红智逸沪港深定开基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  |
| 注册会计师的姓名  | 薛竞   陈熹   |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼  |
| 审计报告日期    | 2018 年 3 月 28 日   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 32,277,134.64                   |
| 结算备付金           |            | 37,263,779.49                   |
| 存出保证金           |            | 829,081.17                      |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 2,033,365,015.40                |
| 其中：股票投资         |            | 651,978,977.20                  |
| 基金投资            |            | -                               |
| 债券投资            |            | 1,381,386,038.20                |
| 资产支持证券投资        |            | -                               |
| 贵金属投资           |            | -                               |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               |
| 应收证券清算款         |            | 105,584,640.47                  |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 22,107,546.30                   |
| 应收股利            |            | -                               |
| 应收申购款           |            | -                               |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               |
| 资产总计            |            | 2,231,427,197.47                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                 |
| 短期借款            |            | -                               |
| 交易性金融负债         |            | -                               |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               |
| 卖出回购金融资产款       |            | 410,000,000.00                  |
| 应付证券清算款         |            | 109,747,860.49                  |
| 应付赎回款           |            | -                               |
| 应付管理人报酬         |            | 2,150,811.17                    |
| 应付托管费           |            | 286,774.81                      |
| 应付销售服务费         |            | -                               |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 602,492.24                      |
| 应交税费            |            | -                               |

|               |          |                  |
|---------------|----------|------------------|
| 应付利息          |          | 213,628.39       |
| 应付利润          |          | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 230,000.00       |
| 负债合计          |          | 523,231,567.10   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 1,482,644,340.03 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 225,551,290.34   |
| 所有者权益合计       |          | 1,708,195,630.37 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 2,231,427,197.47 |

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1521 元，基金份额总额 1,482,644,340.03 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|
| <b>一、收入</b>            |            | 254,612,822.33                                      |
| 1. 利息收入                |            | 45,982,765.85                                       |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 2,835,394.81  |
| 债券利息收入                 |            | 42,158,534.13                                       |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   |
| 买入返售金融资产收入             |            | 988,836.91  |
| 其他利息收入                 |            | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 74,786,950.01                                       |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | 69,396,255.77                                       |
| 基金投资收益                 |            | -   |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -1,938,944.08                                       |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.13.5 | -   |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -   |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -   |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 7,329,638.32  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | 133,843,106.47                                      |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | -   |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 29,061,531.99                                       |

|                            |            |                       |
|----------------------------|------------|-----------------------|
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 17,109,116.48         |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 2,281,215.47          |
| 3. 销售服务费                   |            | -                     |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 1,424,792.54          |
| 5. 利息支出                    |            | 7,990,157.39          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 7,990,157.39          |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 256,250.11            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>225,551,290.34</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>225,551,290.34</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)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）                        | 1,482,644,340.03                                 | -              | 1,482,644,340.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 225,551,290.34 | 225,551,290.34   |
| 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）      | -  | -              | -                |
| 其中：1. 基金申购款                            | -  | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                               | -  | -              | -                |
| 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）                        | 1,482,644,340.03                                 | 225,551,290.34 | 1,708,195,630.37 |

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：

潘鑫军

任莉

詹朋



基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东方红智逸沪港深定期开放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[2016]3116号《关于核准东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》负责公开募集。本基金为契约型基金。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1,482,513,396.24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(2017)第435号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于2017年4月14日生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,482,644,340.03份基金份额,其中认购资金利息折合130,943.79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10,004,586.95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《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合同》的相关规定,本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日,结束之日为基金合同生效日所对应的第三年年度对应日前的倒数第一个工作日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日,结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第三年年度对应日前的倒数第一个工作日,依次类推。本基金自封闭期结束之后的第一个工作日起(即每个封闭期起始之日的第三年年度对应日的第一个工作日,包括该日)进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上不少于5个工作日且最长不超过20个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经中国证监会允许基金投

资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 50%,但在每个期间开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、到期开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间,基金投资不受前述比例限制;本基金投资于股票的比例不高于基金资产的 50%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-50%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-50%)。在开放期,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,在封闭期,本基金不受前述 5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率 $\times$ 70%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%+恒生指数收益率 $\times$ 10%。

本财务报表由本基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司于 2018 年 3 月 28 日批准报出。

#### 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》、《东方红智逸沪港深定期开放混合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 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 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。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 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股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为股指期货投资/权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其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

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为股指期货投资/权证投资)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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率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。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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）于2017年10月23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字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年10月23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。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种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。

#### **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**

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)》,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,本基金自 2017 年 10 月 23 日起改为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。该估值技术变更使本基金 2017 年 12 月 31 日的基金资产净值及 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止会计期间净损益减少,相关影响非重大。

##### **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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 32,277,134.64           |
| 定期存款           | -                       |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                       |
| 其他存款           | -                       |
| 合计：            | 32,277,134.64           |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 |                |                |
|----|-------------------------|----------------|----------------|
|    | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票 | 506,215,128.48          | 651,978,977.20 | 145,763,848.72 |



|               |                  |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                | -                | -                |
| 债券            | 交易所市场            | 1,093,700,827.91 | 1,086,484,038.20 |
|               | 银行间市场            | 299,605,952.54   | 294,902,000.00   |
|               | 合计               | 1,393,306,780.45 | 1,381,386,038.20 |
| 资产支持证券        | -                | -                | -                |
| 基金            | -                | -                | -                |
| 其他            | -                | -                | -                |
| 合计            | 1,899,521,908.93 | 2,033,365,015.40 | 133,843,106.47   |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 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。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2017年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 5,425.64           |
| 应收定期存款利息   | -                  |
| 应收其他存款利息   | -                  |
| 应收结算备付金利息  | 17,531.57          |
| 应收债券利息     | 22,084,339.56      |
| 应收买入返售证券利息 | -                  |
| 应收申购款利息    | -                  |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  |
| 其他         | 249.53             |
| 合计         | 22,107,546.30      |

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 597,955.59              |
| 银行间市场应付交易费用 | 4,536.65                |
| 合计          | 602,492.24              |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       |
| 应付赎回费       | -                       |
| 预提费用        | 230,000.00              |
| 合计          | 230,000.00              |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |                  |
|---------|--|------------------|
|         | 基金份额(份)  | 账面金额             |
| 基金合同生效日 | 1,482,644,340.03                                 | 1,482,644,340.03 |
| 本期申购    | -  | -                |
| 本期末     | 1,482,644,340.03                                 | 1,482,644,340.03 |

注：1. 本基金自 2017 年 4 月 10 日至 2017 年 4 月 28 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 1,482,513,396.24 元。根据《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份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 130,943.79 元在本基金成立后，折算为 130,943.79 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《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合同》的相关规定，本基金的第一个封闭期为 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2020 年 4 月 14 日，封闭期内不办理申购与赎回业务。本基金自 2020 年 4 月 15 日起进入第一个开放期，开放期间可以办理申购与赎回业务。开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日        | -             | -              | -              |
| 本期利润           | 91,708,183.87 | 133,843,106.47 | 225,551,290.34 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | -              | -              |
| 其中：基金申购款       | -             | -              | -              |
| 基金赎回款          | -             | -              | -              |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | 91,708,183.87 | 133,843,106.47 | 225,551,290.34 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 657,382.63                      |
| 定期存款利息收入  | 1,933,888.89                    |
| 其他存款利息收入  | -                               |
| 结算备付金利息收入 | 241,013.89                      |
| 其他        | 3,109.40                        |
| 合计        | 2,835,394.81                    |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
| 卖出股票成交总额   | 351,791,201.49                  |
| 减：卖出股票成本总额 | 282,394,945.72                  |
| 买卖股票差价收入   | 69,396,255.77                   |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期                              |
|----|---------------------------------|
|    | 2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31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 | -1,938,944.08 |
| 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                            | -1,938,944.08 |

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                              |
|-------------------------|---------------------------------|
|                         | 2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 686,724,479.51                  |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 668,003,851.51                  |
| 减：应收利息总额                | 20,659,572.08                   |
| 买卖债券差价收入                | -1,938,944.08                   |

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未进行贵金属投资。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

### 7.4.7.15 衍生工具收益

#### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                              |
|-------------|---------------------------------|
|             | 2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 7,329,638.32                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                               |
| 合计          | 7,329,638.32                    |

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产 | 133,843,106.47                  |
| ——股票投资     | 145,763,848.72                  |
| ——债券投资     | -11,920,742.25                  |
| ——资产支持证券投资 | -                               |
| ——贵金属投资    | -                               |
| ——其他       | -                               |
| 2. 衍生工具    | -                               |
| ——权证投资     | -                               |
| 3. 其他      | -                               |
| 合计         | 133,843,106.47                  |

### 7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,420,442.54                    |

|           |              |
|-----------|--------------|
| 银行间市场交易费用 | 4,350.00     |
| 合计        | 1,424,792.54 |

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期   |            |
|-------|--|------------|
|       | 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |            |
| 审计费用  |  | 100,000.00 |
| 信息披露费 |  | 130,000.00 |
| 银行费用  |  | 12,350.11  |
| 帐户维护费 |  | 13,900.00  |
| 合计    |  | 256,250.11 |

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                  | 与本基金的关系         |
|------------------------|-----------------|
| 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、基金销售机构    |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期   |                  |
|-------|--|------------------|
|       | 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |                  |
|       | 成交金额                                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 东方证券  | 789,145,931.56                             | 69.42%           |

### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |                  |
|-------|---------------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 东方证券  | 1,189,515,182.81                      | 85.20%           |

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |                    |
|-------|---------------------------------------|--------------------|
|       | 回购成交金额                                | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 |
| 东方证券  | 37,194,900,000.00                     | 96.46%             |

### 7.4.10.1.4 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。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |                |            |                  |
|-------|---------------------------------------|----------------|------------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                              | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 东方证券  | 582,517.84                            | 70.17%         | 582,517.84 | 97.42%           |

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 8,579,742.38                          |

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

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和销售机构对账确认的金额为准。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期   |
|----------------|--|
|                | 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,281,215.47                               |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期   |
|---------------------------------|--|
|                                 | 2017 年 4 月 14 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日 |
| 基金合同生效日（2017 年 4 月 14 日）持有的基金份额 | 10,004,586.95                              |
| 期初持有的基金份额                       | -  |
| 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                       | 10,004,586.95                              |
| 期末持有的基金份额                       | 0.6748%                                    |



|          |  |
|----------|--|
| 占基金总份额比例 |  |
|----------|--|

**7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

于本基金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。

**7.4.10.5 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<br>2017年4月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |            |
|------------|---------------------------------------|------------|
|            | 期末余额                                  | 当期利息收入     |
| 招商银行股份有限公司 | 32,277,134.64                         | 657,382.63 |

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。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.10.7 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。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内无利润分配。

**7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |          |      |        |              |               |               |    |
|----------------------|------|------------|------------|----------|------|--------|--------------|---------------|---------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型   | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
| 002027               | 分众传媒 | 2017年8月22日 | 2018年2月23日 | 大宗交易流通受限 | 8.60 | 13.51  | 2,000,000    | 17,200,000.00 | 27,020,000.00 | -  |
| 002027               | 分众传媒 | 2017年8月31日 | 2018年3月1日  | 大宗交易流通受限 | 8.61 | 13.51  | 2,000,000    | 17,220,000.00 | 27,020,000.00 | -  |
| 002027               | 分众传媒 | 2017年9月29日 | 2018年3月30日 | 大宗交易流通受限 | 9.10 | 13.42  | 1,000,000    | 9,100,000.00  | 13,420,000.00 | -  |

|        |      |             |            |          |       |       |           |              |              |   |
|--------|------|-------------|------------|----------|-------|-------|-----------|--------------|--------------|---|
|        |      |             | 日          |          |       |       |           |              |              |   |
| 002078 | 太阳纸业 | 2017年9月29日  | 2018年3月30日 | 大宗交易流通受限 | 8.72  | 8.92  | 1,000,000 | 8,720,000.00 | 8,920,000.00 | - |
| 300664 | 鹏鹞环保 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日  | 新股未上市    | 8.88  | 8.88  | 3,640     | 32,323.20    | 32,323.20    | - |
| 603161 | 科华控股 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日  | 新股未上市    | 16.75 | 16.75 | 1,239     | 20,753.25    | 20,753.25    | - |
| 002923 | 润都股份 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日  | 新股未上市    | 17.01 | 17.01 | 954       | 16,227.54    | 16,227.54    | - |
| 603080 | 新疆火炬 | 2017年12月25日 | 2018年1月3日  | 新股未上市    | 13.60 | 13.60 | 1,187     | 16,143.20    | 16,143.20    | - |

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 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<br>(单位：张) | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|-------------|------------|--------|--------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 128029 | 太阳转债 | 2017年12月22日 | 2018年1月16日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 13,149       | 1,314,900.00 | 1,314,900.00 | -  |

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期        | 停牌原因     | 期末估值单价 | 复牌日期      | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|-------------|----------|--------|-----------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 300730 | 科创信息 | 2017年12月25日 | 股票交易异常波动 | 41.55  | 2018年1月2日 | 45.71  | 821   | 6,863.56  | 34,112.55 | -  |
| 002919 | 名臣健康 | 2017年12月28日 | 股票交易异常波动 | 35.26  | 2018年1月2日 | 38.79  | 821   | 10,311.76 | 28,948.46 | -  |

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 410,000,000.00 元，于 2018 年 1 月 3 日先后到期。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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案等。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期内无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 600,639,694.60          |
| AAA 以下 | 684,496,343.60          |
| 未评级    | 96,250,000.00           |
| 合计     | 1,381,386,038.20        |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级部分包括期限在一年以上的国债和政策性金融债。

### 7.4.13.3 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于开放日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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于每个开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2017 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 410,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月

以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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%。于开放期内，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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金可以投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2017<br>年<br>12<br>月<br>31<br>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                                   | 32,277,134.64 | -              | -                | -             | -              | -                | 32,277,134.64 |
| 结算备付金                                  | 37,263,779.49 | -              | -                | -             | -              | -                | 37,263,779.49 |
| 存出保证金                                  | 829,081.17    | -              | -                | -             | -              | -                | 829,081.17    |
| 交易性金融资产                                | -1,000,300.00 | 156,726,765.50 | 1,127,407,831.90 | 96,251,140.80 | 651,978,977.20 | 2,033,365,015.40 |               |

|                           |                 |              |                |                  |               |                |                  |
|---------------------------|-----------------|--------------|----------------|------------------|---------------|----------------|------------------|
| 应收<br>证券<br>清算<br>款       | -               | -            | -              | -                | -             | 105,584,640.47 | 105,584,640.47   |
| 应收<br>利息                  | -               | -            | -              | -                | -             | 22,107,546.30  | 22,107,546.30    |
| 其他<br>资产                  | -               | -            | -              | -                | -             | -              | -                |
| 资产<br>总计                  | 70,369,995.30   | 1,000,300.00 | 156,726,765.50 | 1,127,407,831.90 | 96,251,140.80 | 779,671,163.97 | 2,231,427,197.47 |
| 负债                        |                 |              |                |                  |               |                |                  |
| 卖出<br>回购<br>金融<br>资产<br>款 | 410,000,000.00  | -            | -              | -                | -             | -              | 410,000,000.00   |
| 应付<br>证券<br>清算<br>款       | -               | -            | -              | -                | -             | 109,747,860.49 | 109,747,860.49   |
| 应付<br>管理<br>人报<br>酬       | -               | -            | -              | -                | -             | 2,150,811.17   | 2,150,811.17     |
| 应付<br>托管<br>费             | -               | -            | -              | -                | -             | 286,774.81     | 286,774.81       |
| 应付<br>交易<br>费用            | -               | -            | -              | -                | -             | 602,492.24     | 602,492.24       |
| 应付<br>利息                  | -               | -            | -              | -                | -             | 213,628.39     | 213,628.39       |
| 其他<br>负债                  | -               | -            | -              | -                | -             | 230,000.00     | 230,000.00       |
| 负债<br>总计                  | 410,000,000.00  | -            | -              | -                | -             | 113,231,567.10 | 523,231,567.10   |
| 利率<br>敏感<br>度缺<br>口       | -339,630,004.70 | 1,000,300.00 | 156,726,765.50 | 1,127,407,831.90 | 96,251,140.80 | 666,439,596.87 | 1,708,195,630.37 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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<br>影响金额（单位：人民币元） |
|                  |                    | 本期末（2017年12月31日）                |
|                  | 1. 市场利率上升 25 个基点   | -8,655,901.21                   |
| 1. 市场利率下降 25 个基点 | 8,655,901.21       |                                 |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末         |                |               |                |
|---------------|-------------|----------------|---------------|----------------|
|               | 2017年12月31日 |                |               |                |
|               | 美元<br>折合人民币 | 港币<br>折合人民币    | 其他币种<br>折合人民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产      |             |                |               |                |
| 交易性金融资产       | -           | 126,974,030.00 | -             | 126,974,030.00 |
| 资产合计          | -           | 126,974,030.00 | -             | 126,974,030.00 |
| 以外币计价的负债      |             |                |               |                |
| 负债合计          | -           | -              | -             | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -           | 126,974,030.00 | -             | 126,974,030.00 |

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                |                                 |
|----|----------------|---------------------------------|
| 假设 | 除汇率外其他市场变量保持不变 |                                 |
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |
|    |                | 本期末（2017年12月31日）                |



|  |              |               |
|--|--------------|---------------|
|  | 港币相对人民币升值 5% | 6,348,701.50  |
|  | 港币相对人民币贬值 5% | -6,348,701.50 |

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 651,978,977.20          | 38.17         |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                       | -             |
| 交易性金融资产-债券投资  | -                       | -             |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                       | -             |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                       | -             |
| 其他            | -                       | -             |
| 合计            | 651,978,977.20          | 38.17         |

##### 7.4.13.4.3.2 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）<br>本期末（2017 年 12 月 31 日） |
|    | 1.沪深 300 指数上升 5%        | 39,454,818.46  |
|    | 2.沪深 300 指数下降 5%        | -39,454,818.46                                       |

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准对应的股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

|    |                        |                        |
|----|------------------------|------------------------|
| 假设 | 1. 置信区间 百分之九十五         |                        |
|    | 2. 观察期 统计日之前的 250 个交易日 |                        |
| 分析 | 风险价值<br>(单位: 人民币元)     | 本期末 (2017 年 12 月 31 日) |
|    | 1 天                    | 11,384,654.83          |
|    | 1 周                    | 25,456,862.10          |

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 575,451,609.80 元，属于第二层次的余额为 1,457,913,405.60 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

价值相差很小。

## (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 651,978,977.20   | 29.22         |
|    | 其中：股票             | 651,978,977.20   | 29.22         |
| 2  | 固定收益投资            | 1,381,386,038.20 | 61.91         |
|    | 其中：债券             | 1,381,386,038.20 | 61.91         |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -                | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 69,540,914.13    | 3.12          |
| 7  | 其他各项资产            | 128,521,267.94   | 5.76          |
| 8  | 合计                | 2,231,427,197.47 | 100.00        |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 126,974,030.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 7.43%。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 29,959,016.85  | 1.75          |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 327,428,828.40 | 19.17         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20      | 0.00          |
| E  | 建筑业              | 21,660,948.00  | 1.27          |
| F  | 批发和零售业           | -              | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 34,112.55      | 0.00          |
| J  | 金融业              | 16,764,180.00  | 0.98          |
| K  | 房地产业             | 61,649,395.00  | 3.61          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 67,460,000.00  | 3.95          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 32,323.20      | 0.00  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 525,004,947.20 | 30.73 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别      | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|-----------|----------------|--------------|
| A 基础材料    | 7,810,140.00   | 0.46         |
| B 消费者非必需品 | 46,700,370.00  | 2.73         |
| C 消费者常用品  | 8,676,000.00   | 0.51         |
| D 能源      | -              | -            |
| E 金融      | -              | -            |
| F 医疗保健    | 2,347,520.00   | 0.14         |
| G 工业      | 61,440,000.00  | 3.60         |
| H 信息技术    | -              | -            |
| I 电信服务    | -              | -            |
| J 公用事业    | -              | -            |
| K 房地产     | -              | -            |
| 合计        | 126,974,030.00 | 7.43         |

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

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 000333 | 美的集团 | 1,416,800  | 78,533,224.00 | 4.60         |
| 2  | 600703 | 三安光电 | 2,856,415  | 72,524,376.85 | 4.25         |
| 3  | 002027 | 分众传媒 | 5,000,000  | 67,460,000.00 | 3.95         |
| 4  | 02869  | 绿城服务 | 12,000,000 | 61,440,000.00 | 3.60         |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 1,432,483  | 46,111,627.77 | 2.70         |
| 6  | 600048 | 保利地产 | 3,226,100  | 45,649,315.00 | 2.67         |
| 7  | 00175  | 吉利汽车 | 1,481,000  | 33,544,650.00 | 1.96         |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 1,320,265  | 30,947,011.60 | 1.81         |
| 9  | 002041 | 登海种业 | 2,331,441  | 29,959,016.85 | 1.75         |
| 10 | 002078 | 太阳纸业 | 2,841,200  | 26,006,336.00 | 1.52         |
| 11 | 002081 | 金螳螂  | 1,413,900  | 21,660,948.00 | 1.27         |
| 12 | 601398 | 工商银行 | 2,703,900  | 16,764,180.00 | 0.98         |

|    |        |                |           |               |      |
|----|--------|----------------|-----------|---------------|------|
| 13 | 001979 | 招商蛇口           | 818,000   | 16,000,080.00 | 0.94 |
| 14 | 000895 | 双汇发展           | 573,678   | 15,202,467.00 | 0.89 |
| 15 | 300408 | 三环集团           | 696,900   | 14,049,504.00 | 0.82 |
| 16 | 02020  | 安踏体育           | 444,000   | 13,155,720.00 | 0.77 |
| 17 | 600066 | 宇通客车           | 515,366   | 12,404,859.62 | 0.73 |
| 18 | 002311 | 海大集团           | 459,800   | 10,759,320.00 | 0.63 |
| 19 | 01112  | H & H 国际<br>控股 | 200,000   | 8,676,000.00  | 0.51 |
| 20 | 002415 | 海康威视           | 218,100   | 8,505,900.00  | 0.50 |
| 21 | 02899  | 紫金矿业           | 3,162,000 | 7,810,140.00  | 0.46 |
| 22 | 300124 | 汇川技术           | 221,592   | 6,430,599.84  | 0.38 |
| 23 | 300196 | 长海股份           | 371,900   | 4,849,576.00  | 0.28 |
| 24 | 02196  | 复星医药           | 56,000    | 2,347,520.00  | 0.14 |
| 25 | 600104 | 上汽集团           | 20,860    | 668,354.40    | 0.04 |
| 26 | 002920 | 德赛西威           | 4,569     | 178,784.97    | 0.01 |
| 27 | 300735 | 光弘科技           | 3,764     | 54,163.96     | 0.00 |
| 28 | 002915 | 中欣氟材           | 1,085     | 38,181.15     | 0.00 |
| 29 | 603477 | 振静股份           | 1,955     | 37,027.70     | 0.00 |
| 30 | 300730 | 科创信息           | 821       | 34,112.55     | 0.00 |
| 31 | 300664 | 鹏鹞环保           | 3,640     | 32,323.20     | 0.00 |
| 32 | 002919 | 名臣健康           | 821       | 28,948.46     | 0.00 |
| 33 | 002922 | 伊戈尔            | 1,245     | 22,248.15     | 0.00 |
| 34 | 603161 | 科华控股           | 1,239     | 20,753.25     | 0.00 |
| 35 | 603283 | 赛腾股份           | 1,349     | 19,614.46     | 0.00 |
| 36 | 002923 | 润都股份           | 954       | 16,227.54     | 0.00 |
| 37 | 603080 | 新疆火炬           | 1,187     | 16,143.20     | 0.00 |
| 38 | 300684 | 中石科技           | 827       | 11,528.38     | 0.00 |
| 39 | 603655 | 郎博科技           | 881       | 8,193.30      | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期末基金资产净值<br>比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1  | 002027 | 分众传媒 | 60,773,322.20 | 3.56               |
| 2  | 600703 | 三安光电 | 57,707,485.92 | 3.38               |
| 3  | 000333 | 美的集团 | 52,973,940.87 | 3.10               |
| 4  | 02869  | 绿城服务 | 47,287,784.34 | 2.77               |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5  | 601398 | 工商银行 | 47,008,789.49 | 2.75 |
| 6  | 600887 | 伊利股份 | 44,495,134.70 | 2.60 |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 44,486,637.00 | 2.60 |
| 8  | 600048 | 保利地产 | 39,825,372.78 | 2.33 |
| 9  | 00175  | 吉利汽车 | 37,176,189.70 | 2.18 |
| 10 | 002041 | 登海种业 | 31,393,586.54 | 1.84 |
| 11 | 601939 | 建设银行 | 29,658,448.29 | 1.74 |
| 12 | 600104 | 上汽集团 | 28,920,499.76 | 1.69 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 26,036,732.53 | 1.52 |
| 14 | 002078 | 太阳纸业 | 24,564,146.00 | 1.44 |
| 15 | 600196 | 复星医药 | 22,756,905.09 | 1.33 |
| 16 | 002470 | 金正大  | 16,032,550.16 | 0.94 |
| 17 | 002081 | 金螳螂  | 15,983,494.49 | 0.94 |
| 18 | 001979 | 招商蛇口 | 15,977,502.61 | 0.94 |
| 19 | 000063 | 中兴通讯 | 15,936,723.80 | 0.93 |
| 20 | 600660 | 福耀玻璃 | 15,771,959.00 | 0.92 |

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称       | 本期累计卖出金额      | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------------|---------------|----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安       | 61,766,465.77 | 3.62           |
| 2  | 00175  | 吉利汽车       | 39,616,425.23 | 2.32           |
| 3  | 601398 | 工商银行       | 33,930,519.96 | 1.99           |
| 4  | 600104 | 上汽集团       | 33,495,469.38 | 1.96           |
| 5  | 601939 | 建设银行       | 31,202,766.40 | 1.83           |
| 6  | 600196 | 复星医药       | 26,071,855.54 | 1.53           |
| 7  | 600887 | 伊利股份       | 22,297,505.81 | 1.31           |
| 8  | 000063 | 中兴通讯       | 18,579,799.70 | 1.09           |
| 9  | 600660 | 福耀玻璃       | 18,572,349.96 | 1.09           |
| 10 | 002027 | 分众传媒       | 18,049,583.23 | 1.06           |
| 11 | 002470 | 金正大        | 17,476,497.13 | 1.02           |
| 12 | 01112  | H & H 国际控股 | 8,496,846.29  | 0.50           |
| 13 | 600066 | 宇通客车       | 5,116,506.34  | 0.30           |
| 14 | 000333 | 美的集团       | 3,841,465.00  | 0.22           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 15 | 300124 | 汇川技术 | 3,645,012.36 | 0.21 |
| 16 | 600025 | 华能水电 | 416,737.20   | 0.02 |
| 17 | 601108 | 财通证券 | 335,496.30   | 0.02 |
| 18 | 300699 | 光威复材 | 316,224.00   | 0.02 |
| 19 | 002916 | 深南电路 | 260,152.24   | 0.02 |
| 20 | 601326 | 秦港股份 | 235,862.00   | 0.01 |

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 788,610,074.20 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 404,031,201.49 |

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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      | 48,475,000.00    | 2.84         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 370,617,500.00   | 21.70        |
|    | 其中：政策性金融债 | 47,775,000.00    | 2.80         |
| 4  | 企业债券      | 832,024,691.90   | 48.71        |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 128,301,000.00   | 7.51         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,967,846.30     | 0.12         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,381,386,038.20 | 80.87        |

### 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（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 136304 | 16 紫金 01   | 500,000 | 48,720,000.00 | 2.85         |
| 2  | 170010 | 17 付息国债 10 | 500,000 | 48,475,000.00 | 2.84         |
| 3  | 136527 | 16 两江 02   | 500,000 | 48,290,000.00 | 2.83         |
| 4  | 170215 | 17 国开 15   | 500,000 | 47,775,000.00 | 2.80         |
| 5  | 112469 | 16 涪陵 02   | 500,000 | 47,735,000.00 | 2.79         |



## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行股指期货投资。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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   | 829,081.17     |
| 2  | 应收证券清算款 | 105,584,640.47 |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 22,107,546.30  |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 128,521,267.94 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值   | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明     |
|----|--------|------|---------------|---------------|--------------|
| 1  | 002027 | 分众传媒 | 67,460,000.00 | 3.95          | 大宗交易取得并带有限售期 |
| 2  | 002078 | 太阳纸业 | 8,920,000.00  | 0.52          | 大宗交易取得并带有限售期 |

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 18,022       | 82,268.58     | 10,300,024.00 | 0.69%      | 1,472,344,316.03 | 99.31%     |

### 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 | 156,377.36 | 0.0105%  |

### 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<br>基金总份<br>额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份<br>额比例（%） | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|---------------|-------------------------|---------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,004,586.95 | 0.67                    | 10,004,586.95 | 0.67                    | 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          | 10,004,586.95 | 0.67                    | 10,004,586.95 | 0.67                    | 3年             |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2017年4月14日）基金份额总额          | 1,482,644,340.03 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | -                |
| 减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | -                |
| 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                       | 1,482,644,340.03 |

注：本基金合同生效日为2017年4月14日。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告披露日前，本基金管理人于 2018 年 3 月 8 日发布公告，同意陈光明同志自 2018 年 3 月 7 日起辞去公司董事长职务，由潘鑫军同志担任公司董事长职务。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。本基金本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计报酬为 10 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

2016 年 8 月，上海证监局对公司 2014 年以来的业务开展情况实施了现场检查，针对检查中发现的问题，上海局于本报告期内对本基金管理人采取了责令改正的行政监管措施，根据监管要求已在 2017 年 5 月 22 日向上海局提交了有关落实整改工作的书面报告。

报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东方证券 | 2      | 789,145,931.56 | 69.42%       | 582,517.84 | 70.17%     | -  |
| 东吴证券 | 1      | 207,028,194.54 | 18.21%       | 147,626.70 | 17.78%     | -  |
| 民生证券 | 1      | 87,126,043.83  | 7.66%        | 61,973.04  | 7.47%      | -  |
| 中信证券 | 1      | 40,692,221.67  | 3.58%        | 28,944.51  | 3.49%      | -  |
| 西部证券 | 1      | 12,755,367.76  | 1.12%        | 9,072.82   | 1.09%      | -  |
| 广发证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序：（1）选择标准：券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。（2）选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本基金合同于 2017 年 4 月 14 日生效，上表所列示券商交易单元均为本报告期内新增。

4、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。

### 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 | 1,189,515,182.81 | 85.20%       | 37,194,900,000.00 | 96.46%         | -    | -            |

|      |                |        |                  |       |   |   |
|------|----------------|--------|------------------|-------|---|---|
| 东吴证券 | 43,844,378.55  | 3.14%  | 1,189,400,000.00 | 3.08% | - | - |
| 民生证券 | 146,290,450.16 | 10.48% | -                | -     | - | - |
| 中信证券 | 16,460,436.60  | 1.18%  | 66,000,000.00    | 0.17% | - | - |
| 西部证券 | 10,749.77      | 0.00%  | 110,000,000.00   | 0.29% | - | - |
| 广发证券 | -              | -      | -                | -     | - | - |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                     | 法定披露日期     |
|----|--|----------------------------|------------|
| 1  | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告                           | 中国证券报、上海证券报和公司网站           | 2017年4月15日 |
| 2  | 上海东方证券资产管理有限公司关于增聘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的公告          | 中国证券报、上海证券报和公司网站           | 2017年4月28日 |
| 3  | 上海东方证券资产管理有限公司关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站      | 2017年7月1日  |
| 4  | 上海东方证券资产管理有限公司旗下基金2017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、证券时报和公司网站      | 2017年7月1日  |
| 5  | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下参与港股通交易的公募基金修改基金合同的公告                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站 | 2017年7月20日 |
| 6  | 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合同                               | 公司网站                       | 2017年7月20日 |
| 7  | 东方红智逸沪港深定期开放混合   | 公司网站                       | 2017年7月20日 |

|    |  |                            |                  |
|----|--|----------------------------|------------------|
|    | 型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）                   |                            |                  |
| 8  | 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合同摘要                     | 公司网站                       | 2017 年 7 月 20 日  |
| 9  | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2017 年第 1 号） | 公司网站                       | 2017 年 7 月 20 日  |
| 10 | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 2 季度报告            | 中国证券报、上海证券报和公司网站           | 2017 年 7 月 21 日  |
| 11 | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告               | 公司网站                       | 2017 年 8 月 28 日  |
| 12 | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年半年度报告（摘要）           | 中国证券报、上海证券报和公司网站           | 2017 年 8 月 28 日  |
| 13 | 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下基金调整流通受限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 | 2017 年 10 月 23 日 |
| 14 | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 3 季度报告            | 中国证券报、上海证券报和公司网站           | 2017 年 10 月 26 日 |
| 15 | 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、证券时报和公司网站      | 2017 年 11 月 3 日  |
| 16 | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明                       | 公司网站                       | 2017 年 11 月 22 日 |



|    |  |                       |                  |
|----|--|-----------------------|------------------|
|    | 书（更新）（2017 年第 2 号）                                 |                       |                  |
| 17 | 东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2017 年第 2 号） | 中国证券报、上海证券报和公司网站      | 2017 年 11 月 22 日 |
| 18 | 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、证券时报和公司网站 | 2017 年 11 月 24 日 |
| 19 | 上海东方证券资产管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告        | 中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站 | 2017 年 12 月 27 日 |
| 20 | 关于上海东方证券资产管理有限公司旗下产品实施增值税政策的公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站 | 2017 年 12 月 29 日 |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《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合同》；
- 3、《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
[www.dfham.com](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2018 年 3 月 29 日