

---

# 东方红配置精选混合型证券投资基金 2018 年年度报告

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 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。

本报告期自 2018 年 5 月 21 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 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	20
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>25</b>
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	62
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.....	62

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 .....	62
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 .....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12 投资组合报告附注 .....	63
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
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 .....	65
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>67</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
11.4 基金投资策略的改变 .....	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
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 .....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>72</b>
12.1 备查文件目录 .....	72
12.2 存放地点 .....	72
12.3 查阅方式 .....	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红配置精选混合型证券投资基金	
基金简称	东方红配置精选混合	
基金主代码	005974	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 21 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	5,820,987,015.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东方红配置精选混合 A	东方红配置精选混合 C
下属分级基金的交易代码:	005974	005975
下属分级基金的前端交易代码	005974	005975
报告期末下属分级基金的份额总额	5,599,763,849.47 份	221,223,165.82 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略，在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略力争实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+中债综合指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海东方证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李云亮
	联系电话	021-63325888
	电子邮箱	service@dfham.com
客户服务电话	4009200808	95555

传真	021-63326981	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	潘鑫军	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，证券时报
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

## 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（特殊普通合伙）	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
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	2018 年 5 月 21 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日	
	东方红配置精选混合 A	东方红配置精选混合 C
本期已实现收益	78,609,499.92	2,497,187.06
本期利润	-150,816,648.20	-6,966,227.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0252	-0.0281
本期加权平均净值利润率	-2.55%	-2.84%
本期基金份额净值增长率	-2.55%	-2.86%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	
期末可供分配利润	-142,888,544.02	-6,335,638.71
期末可供分配基金份额利润	-0.0255	-0.0286
期末基金资产净值	5,456,875,305.45	214,887,527.11
期末基金份额净值	0.9745	0.9714
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	
基金份额累计净值增长率	-2.55%	-2.86%

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”指报告期最后一日，即 12 月 31 日；“本期”指 2018 年 5 月 21 日（基金合同生效日） - 2018 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

东方红配置精选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.22%	0.40%	-0.94%	0.32%	-1.28%	0.08%
过去六个月	-1.13%	0.37%	-0.81%	0.29%	-0.32%	0.08%
自基金合同生效起至今	-2.55%	0.36%	-2.43%	0.28%	-0.12%	0.08%

东方红配置精选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.35%	0.40%	-0.94%	0.32%	-1.41%	0.08%
过去六个月	-1.38%	0.37%	-0.81%	0.29%	-0.57%	0.08%
自基金合同生效起至今	-2.86%	0.36%	-2.43%	0.28%	-0.43%	0.08%

注：1、自基金合同生效日起至至今指 2018 年 5 月 21 日-2018 年 12 月 31 日。

2、根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数收益率 \*20%+中债综合指数收益率\*80%

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率 ( $benchmark_t$ ) 按下列公式计算：

$$benchmark_t = 20\% * [t \text{ 日沪深 300 指数} / (t-1 \text{ 日沪深 300 指数}) - 1] + 80\% * [t \text{ 日中债综合指数} / (t-1 \text{ 日中债综合指数}) - 1];$$

其中，t=1, 2, 3, ... T, T 表示时间截至日；

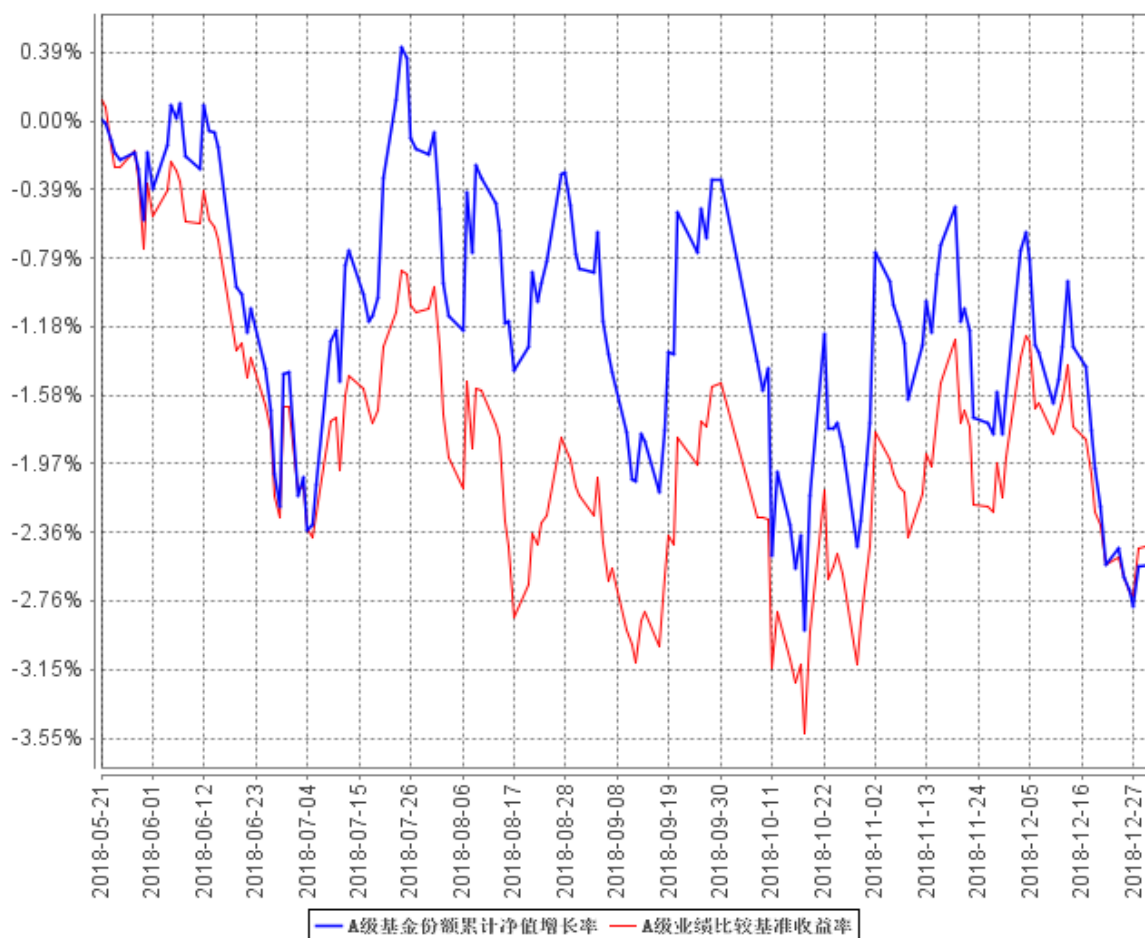
t 日至 T 日的期间收益率 ( $benchmark_T^t$ ) 按下列公式计算：

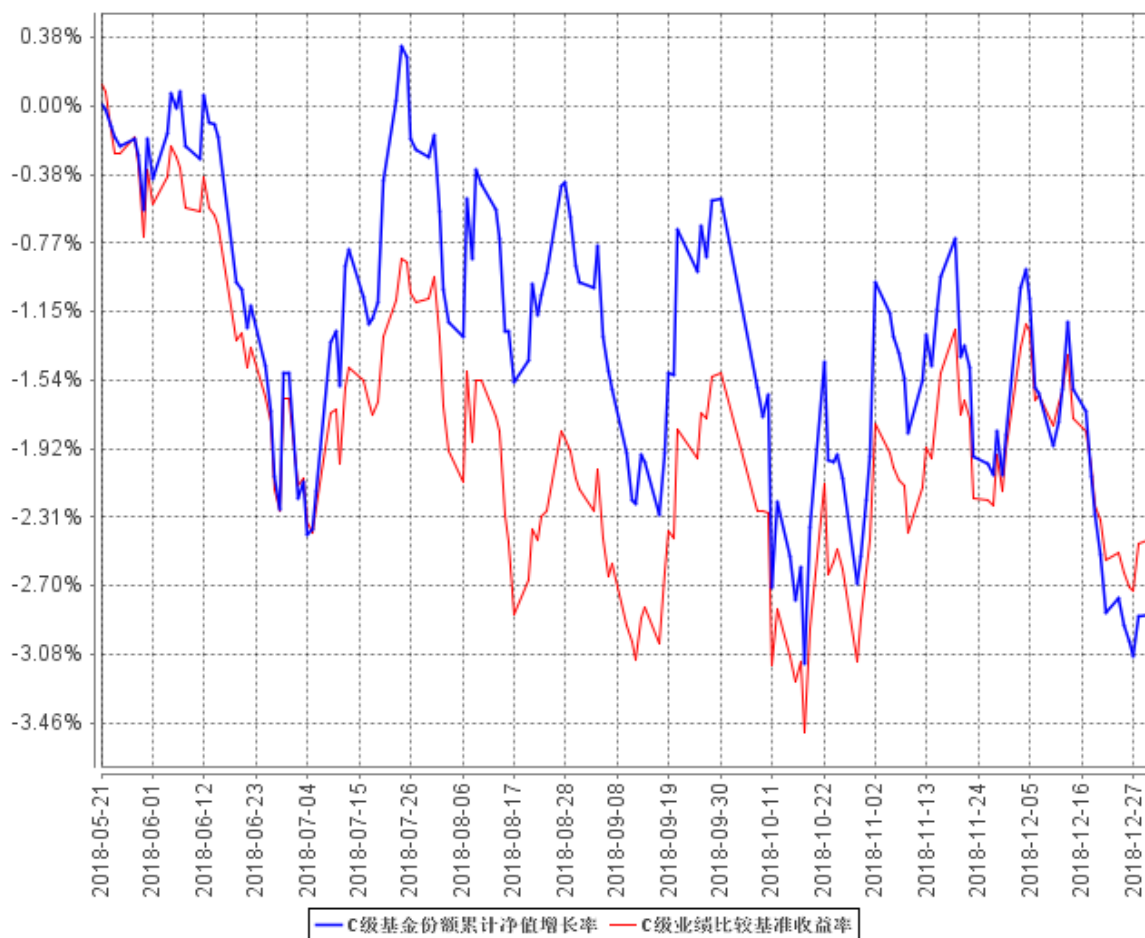
$$benchmark_T^t = [\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)$  表示 t 日至 T 日的  $(1 + benchmark_t)$  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



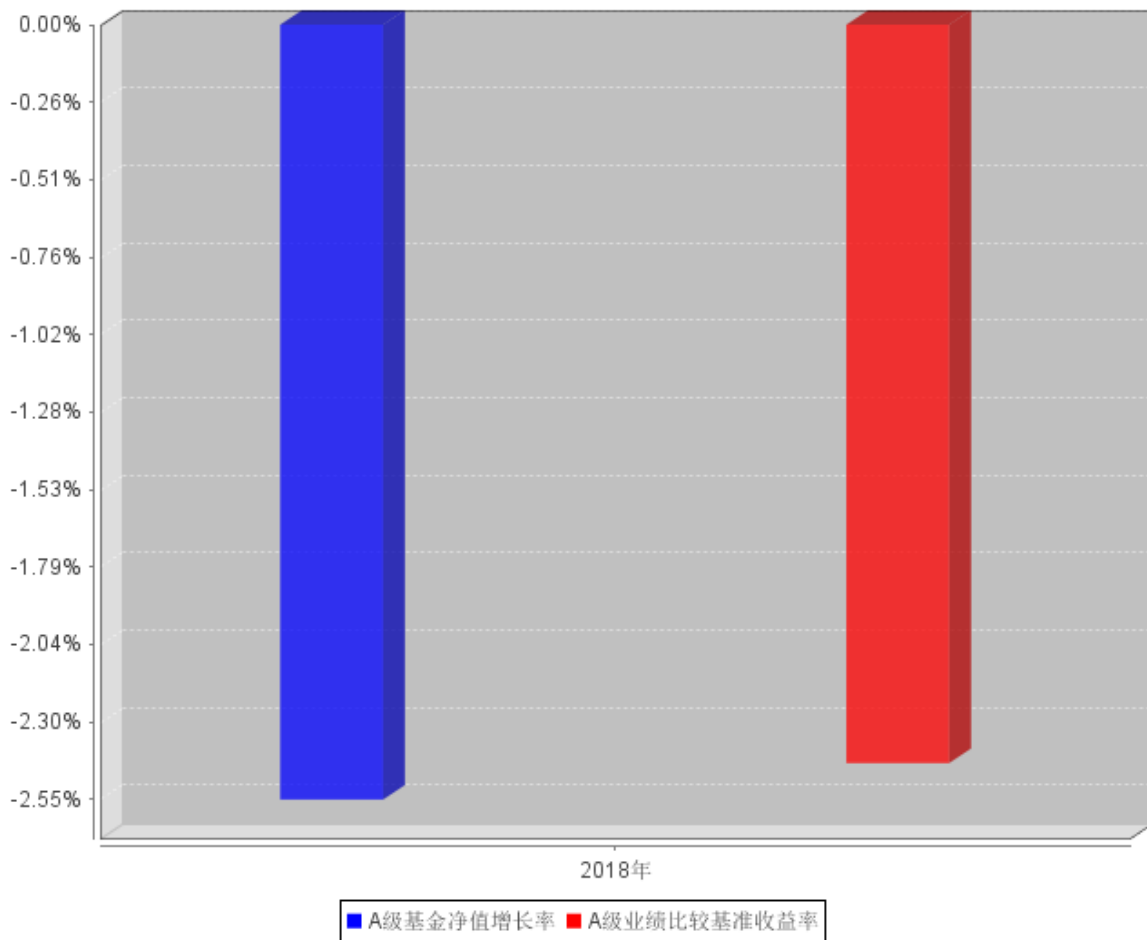


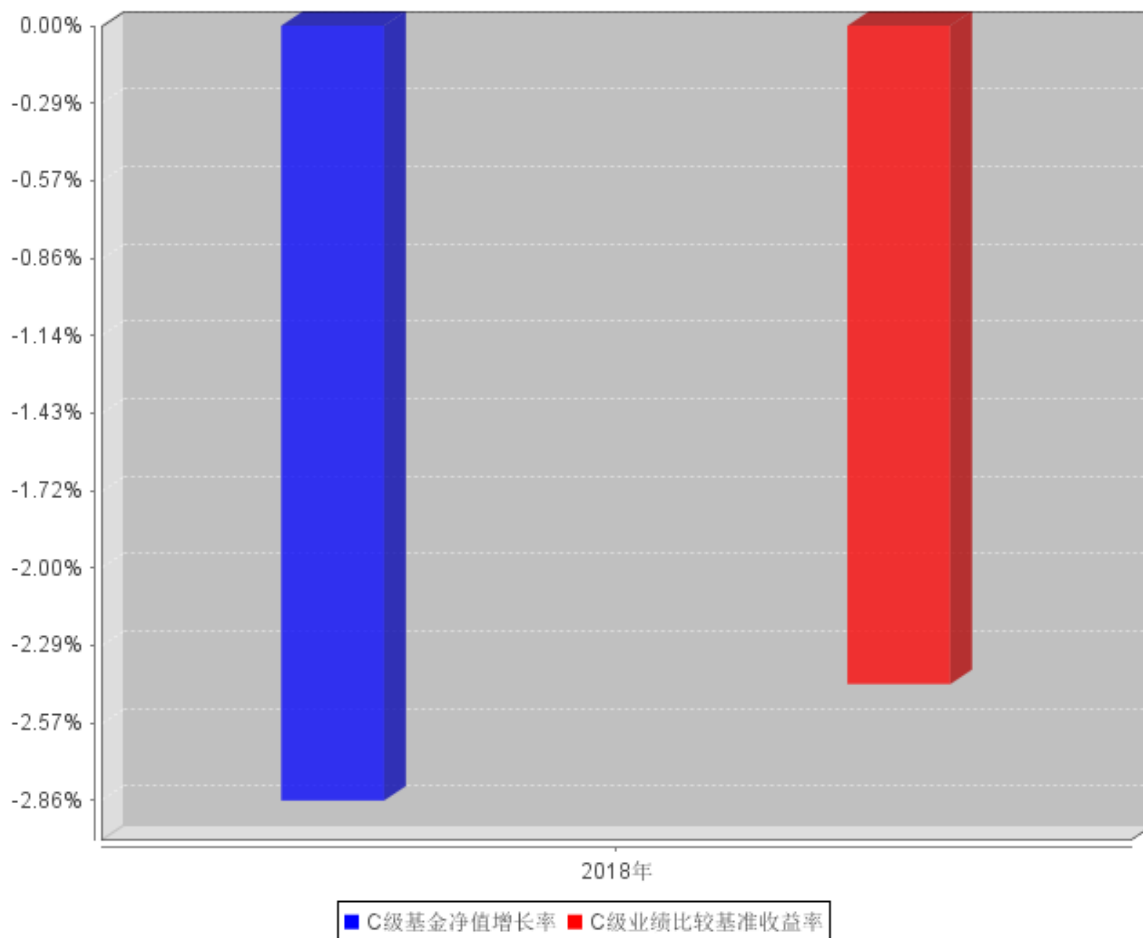
注：1、截止日期为 2018 年 12 月 31 日。

2、本基金合同于 2018 年 5 月 21 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

3、本基金建仓期 6 个月，即从 2018 年 5 月 21 日起至 2018 年 11 月 20 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 2018 年 5 月 21 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。

2、本图所示时间区间为 2018 年 5 月 21 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。

3、合同生效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 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2018 年 5 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 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 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

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		
孔令超	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、东方红目标优选三年定期开放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、东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理。	2018年5月21日	-	7年	硕士，曾任平安证券有限责任公司总部综合研究所策略研究员、国信证券股份有限公司经济研究所策略研究员，现任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红目标优选定开混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红创新优选定开混合、东方红配置精选混合、东方红稳健精选混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

徐觅	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、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、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基金经理。	2018 年 5 月 21 日	-	12 年	本科，曾任长信基金管理有限责任公司基金事务部基金会计、交易管理部债券交易员，广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员，富国基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司私募固定收益投资部投资经理。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基金经理兼任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红益鑫纯债债券、东方红货币、东方红目标优选定开混合、东方红配置精选混合、东方红核心优选定开混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
----	--	-----------------	---	------	--

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

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

权益方面，2018 年市场表现不佳。国内方面，前期货币政策的收紧开始逐渐往信用收紧传递，市场对经济的预期出现了向下的修正；海外方面贸易战的发酵也给市场带来了更多的不确定性。

债券方面，2018 年国内经济增速放缓趋势仍在延续，叠加中美贸易战的不利影响，促使宏观政策做出适度调整：从上半年的“去杠杆”向下半年的“稳杠杆”政策转变。央行稳健的货币政策也更加注重松紧适度，年内三次宣布调低存款准备金率，流动性保持合理充裕。债券呈现分化走势，利率债和中高等级信用债整体表现良好，但高杠杆、中低等级的债券发行人再融资存在一定压力，信用风险事件不断爆发。本报告期内，我们逐步拉长了利率债的久期，增配高等级信用债，并提高了组合的杠杆水平，取得了较为良好的回报。

转债市场在 2018 年经历了较大的变化。历史上转债市场一直属于小众市场，品种相对较少，且估值水平整体偏高。而经过 2018 年新转债的不断发行，存量的转债市场规模大幅扩容，大幅增加的转债数量给投资者带来了更多的挑选余地。而供给的增加以及股票市场的低迷表现，也使得转债市场的估值水平不断压缩，目前估值水平已经处于较低的位置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东方红配置精选混合 A 基金份额净值为 0.9745 元，份额累计净值为 0.9745 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.55%；截至本报告期末东方红配置精选混合 C 基金份额净值为 0.9714 元，份额累计净值为 0.9714 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.86%；同期业绩比较基准收益率为-2.43%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，权益方面，虽然经济尚未看到明显企稳迹象，地产等因素也存在一定的不确定性，但一些积极因素也在出现，主要体现在全球的货币环境都开始有所改善，市场的主要边际变化也逐渐由紧信用向宽货币转化。而股市经过 2018 年的持续调整后，对于负面因素已经有所反应，

当前股市整体估值已经处在历史较低水平，一些优质公司的估值更是具备投资吸引力，在这种环境下，权益资产的配置价值较 2018 年有所提升。因此，我们将坚持价值投资理念，逐渐加大估值合理、基本面稳健的优质龙头公司的配置比例。

债券整体仍处于较为有利的环境，利率债和高等级信用债具有配置价值。流动性宽松和市场利率走低将对债市的中长期走势提供良好支撑，配置高等级信用债和杠杆套息的策略预计将可能为组合带来显著贡献。除此以外，我们会坚持个体研究和实地调研，自下而上的寻找被市场错误定价的优质企业并与其共同成长，努力为持有人获取长期、稳健的回报。

转债市场的低估值、标的扩容以及权益市场预期收益率的提升使得转债市场具备较高的配置价值。在操作中，我们将结合对转债公司基本面的研究，以及对股票及转债自身估值、条款的考量，精选性价比高的转债进行配置。

#### 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，2018 年开展了如下主要工作：

公司日常监察稽核工作主要由合规与风险管理部承担，2018 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 2018 年相关审查、检查工作。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、系统建制方面，推进恒生交易系统风控模块的测试及衡泰风控系统的一期验收和二期立项实施，并进一步完善风险管理相关制度流程。

2、投资组合风控方面，合规与风险管理部配合公司业务进展，对交易对手方额度控制等各项功能进行测试并稳步推进上线。

（三）进一步落实债券交易监管要求

截至 2018 年末，公司已进一步加强各类债券交易的统一管理，强化合规风控作用，规范债券交易业务管理和人员管理，并由合规与风险管理部牵头，协同相关部门开展落实监管要求情况自查，并形成自查整改报告提交监管部门。

（四）进一步加强了公司制度流程建设。

2018 年以来，公司根据业务发展需要制定或修订了 30 项制度规程。同时，对交易对手管理

的准入管理方案及审批流程、额度管控方案、A 股和 H 股涉及 5%举牌与信息披露限额的控制口径、关联交易管理、即时通讯工具管控措施等进行了梳理和完善。

(五) 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。

2018 年以来在母公司的组织下, 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。

#### 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种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。

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

2、本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资, 投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类基金份额净值自动转为同一类别的基金份额进行再投资; 若投资人不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金收益分配基准日的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。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

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

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。

本年度报告中未发生利润分配。

### 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

### 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(2019)第 21684 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	东方红配置精选混合型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>我们审计了东方红配置精选混合型证券投资基金(以下简称“东方红配置精选混合基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年 5 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 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,公允反映了东方红配置精选混合基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 5 月 21 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。</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,我们独立于东方红配置精选混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>东方红配置精选混合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配置精选混合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配置精选混合基金、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配置精选混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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配置精选混合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配置精选混合基金不能持续经营。</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	陈熹   叶尔甸
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	2019 年 3 月 26 日



## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方红配置精选混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	21,926,978.23
结算备付金		14,227,992.60
存出保证金		325,993.23
交易性金融资产	7.4.7.2	6,491,328,948.19
其中：股票投资		953,094,374.42
基金投资		-
债券投资		5,538,234,573.77
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		5,041,935.33
应收利息	7.4.7.5	66,488,244.39
应收股利		33,996.29
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		6,599,374,088.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 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		921,500,000.00
应付证券清算款		17.87
应付赎回款		-
应付管理人报酬		2,939,413.47
应付托管费		734,853.39
应付销售服务费		93,415.84
应付交易费用	7.4.7.7	772,796.54
应交税费		161,278.13

应付利息		1,158,147.46
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	251,333.00
负债合计		927,611,255.70
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	5,820,987,015.29
未分配利润	7.4.7.10	-149,224,182.73
所有者权益合计		5,671,762,832.56
负债和所有者权益总计		6,599,374,088.26

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 5,820,987,015.29 份，其中 A 类基金份额净值 0.9745 元，基金份额 5,599,763,849.47 份；C 类基金份额净值 0.9714 元，基金份额 221,223,165.82 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 5 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：东方红配置精选混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 5 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 5 月 21 日(基金合同生效 日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-122,754,234.21
1.利息收入		85,125,120.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,428,420.67
债券利息收入		73,750,728.92
资产支持证券利息收入		623,911.25
买入返售金融资产收入		6,322,059.57
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		30,190,949.97
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-10,556,375.40
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	17,993,086.43
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	22,754,238.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”	7.4.7.17	-238,889,562.33

号填列)		
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	819,257.74
<b>减: 二、费用</b>		35,028,641.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	22,649,600.33
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,662,400.15
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	751,730.70
4. 交易费用	7.4.7.19	1,512,582.10
5. 利息支出		4,057,285.46
其中: 卖出回购金融资产支出		4,057,285.46
6. 税金及附加		98,411.10
7. 其他费用	7.4.7.20	296,631.30
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-157,782,875.35
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-157,782,875.35

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 东方红配置精选混合型证券投资基金

本报告期: 2018年5月21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5月21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)	6,397,549,362.87	-	6,397,549,362.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-157,782,875.35	-157,782,875.35
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)	-576,562,347.58	8,558,692.62	-568,003,654.96
其中: 1. 基金申购款	11,873,154.19	-174,336.64	11,698,817.55
2. 基金赎回款	-588,435,501.77	8,733,029.26	-579,702,472.51
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)	5,820,987,015.29	-149,224,182.73	5,671,762,832.56

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

东方红配置精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2398号《关于准予东方红配置精选混合型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《东方红配置精选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币6,397,259,327.77元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0350号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红配置精选混合型证券投资基金基金合同》于2018年5月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,397,549,362.87份基金份额,其中认购资金利息折合290,035.10份基金份额。其中东方红配置精选混合A的基金份额总额为6,138,801,721.26份,包含认购资金利息折合278,393.43份,东方红配置精选混合C的基金份额总额为258,747,641.61份,包含认购资金利息折合11,641.67份。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《东方红配置精选混合型证券投资基金基金合同》和《东方红配置精选混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。A类基金份额在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费,而不计提销售服务费。C类基金份额在投资人认购、申购基金时不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置基金代码,并且分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红配置精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市

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。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%-30%; 本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率\*80%+沪深 300 指数收益率\*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》、《东方红配置精选混合型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 5 月 21 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 5 月 21 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。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 5 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

#### 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

本基金持有的股票投资、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

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、托管费和销售服务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

本基金同一类别的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) 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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(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。

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

### 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 2018 年 12 月 31 日
活期存款	21,926,978.23
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	21,926,978.23

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,170,537,918.17	953,094,374.42	-217,443,543.75	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	4,464,051,144.35	4,426,935,573.77	-37,115,570.58
	银行间市场	1,095,629,448.00	1,111,299,000.00	15,669,552.00
	合计	5,559,680,592.35	5,538,234,573.77	-21,446,018.58
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	6,730,218,510.52	6,491,328,948.19	-238,889,562.33	

#### 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从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 2018年12月31日
应收活期存款利息	5,016.39
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	7,042.86
应收债券利息	66,476,023.25
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.52
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	161.37
合计	66,488,244.39

#### 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 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	766,846.54
银行间市场应付交易费用	5,950.00
合计	772,796.54

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	251,333.00
合计	251,333.00

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

东方红配置精选混合 A		
项目	本期 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	6,138,801,721.26	6,138,801,721.26
本期申购	10,926,066.46	10,926,066.46
本期赎回(以“-”号填列)	-549,963,938.25	-549,963,938.25
本期末	5,599,763,849.47	5,599,763,849.47

金额单位：人民币元

东方红配置精选混合 C		
项目	本期 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	258,747,641.61	258,747,641.61
本期申购	947,087.73	947,087.73
本期赎回(以“-”号填列)	-38,471,563.52	-38,471,563.52
本期末	221,223,165.82	221,223,165.82

注：1、申购含红利再投份额，赎回含转换出份额。

2、本基金自2018年5月15日至2018年5月25日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币6,397,259,327.77元，折合为6,397,259,327.77份基金份额(其中A类基金份额6,138,523,327.83份，C类基金份额258,735,999.94份)。根据《东方红配置精选混合型证券投资基金招募说明书》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290,035.10元在本基金成立后，折合为290,035.10份基金份额(其中A类基金份额278,393.43份，C类基金份额11,641.67份)，划入基金份额持有人账户。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

东方红配置精选混合 A			
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	78,609,499.92	-229,426,148.12	-150,816,648.20
本期基金份额交易产生的变动数	-5,642,166.04	13,570,270.22	7,928,104.18
其中：基金申购款	109,763.73	-266,012.64	-156,248.91
基金赎回款	-5,751,929.77	13,836,282.86	8,084,353.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,967,333.88	-215,855,877.90	-142,888,544.02

单位：人民币元

东方红配置精选混合 C			
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	2,497,187.06	-9,463,414.21	-6,966,227.15
本期基金份额交易产生的变动数	-318,888.87	949,477.31	630,588.44
其中：基金申购款	7,473.74	-25,561.47	-18,087.73
基金赎回款	-326,362.61	975,038.78	648,676.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,178,298.19	-8,513,936.90	-6,335,638.71

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	1,360,373.44
定期存款利息收入	2,812,097.21
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	251,546.73
其他	4,403.29
合计	4,428,420.67

#### 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 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日

卖出股票成交总额	146,344,216.77
减：卖出股票成本总额	156,900,592.17
买卖股票差价收入	-10,556,375.40

### 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 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018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	17,993,086.43
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	17,993,086.43

#### 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 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,829,834,601.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,741,359,622.93
减：应收利息总额	70,481,891.78
买卖债券差价收入	17,993,086.43

#### 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投资收益—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投资收益—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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 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贵金属投资收益—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投资收益—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投资收益—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衍生工具收益—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
	2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	22,754,238.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	22,754,238.94

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	-238,889,562.33
——股票投资	-217,443,543.75
——债券投资	-21,446,018.58
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-238,889,562.33

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	819,257.74
合计	819,257.74

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的50%归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	1,484,707.10
银行间市场交易费用	27,875.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,512,582.10

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
审计费用	133,000.00
信息披露费	118,333.00
其他	300.00
银行费用	34,498.30

帐户维护费	10,500.00
合计	296,631.30

### 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
上海东证期货有限公司(“东证期货”)	受东方证券控制的公司

注：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 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年 12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券	981,138,893.39	66.65%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年5月21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	4,499,252,465.75	88.70%

### 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 2018年5月21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	36,711,100,000.00	99.59%

### 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 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券	724,426.23	67.48%	724,426.23	94.47%

1、上述佣金按市场佣金率计算，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 2018年5月21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	22,649,600.33
其中：支付销售机构的客户	11,192,556.06

维护费	
-----	--

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 5 月 21 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	5,662,400.15

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 5 月 21 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销售服务费		
	东方红配置精选混合 A	东方红配置精选混合 C	合计
东证资管	-	5,591.86	5,591.86
招商银行	-	724,484.27	724,484.27
东方证券	-	21,654.57	21,654.57
合计	-	751,730.70	751,730.70

注：本基金 C 类份额的销售服务费率按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。C 类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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发生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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 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

于本基金本报告期内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 2018年5月21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	21,926,978.23	1,360,373.44

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

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2018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 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

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 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018年12月20日	2019年1月18日	新债未上市	100.00	100.00	5,890	589,000.00	589,000.00	-
120002	18中原EB	2018年12月25日	2019年1月11日	新债未上市	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 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 921,500,000.00 元, 截至 2019 年 1 月 15 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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	180,576,000.00
合计	180,576,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级中包含期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票以及未有第三方机构评级的其他债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日
AAA	2,946,541,116.02
AAA 以下	1,229,294,457.75
未评级	1,181,823,000.00
合计	5,357,658,573.77

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为期限在一年以上的政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每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2018年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有921,500,000.00元将在到期且计息(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》及且于基金开放期内按照《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,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。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 2018 年 12 月 31 日,本基金投资于流动性受限资产的市值合计未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。于 2018 年 12 月 31 日,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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建立了逆回购交易质押品管理制度: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。

#### 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和卖出回购金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	21,926,978.23	-	-	-	-	-	21,926,978.23
结算备付金	14,227,992.60	-	-	-	-	-	14,227,992.60
存出保证金	325,993.23	-	-	-	-	-	325,993.23
交易性金融	18,912,545.50	64,982,000.00	557,351,285.20	3,950,438,703.15	946,550,039.92	953,094,374.42	6,491,328,948.19

资产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,041,935.33	5,041,935.33
应收利息	-	-	-	-	-	66,488,244.39	66,488,244.39
应收股利	-	-	-	-	-	33,996.29	33,996.29
资产总计	55,393,509.56	64,982,000.00	557,351,285.20	3,950,438,703.15	946,550,039.92	1,024,658,550.43	6,599,374,088.26
负债							
卖出回购金融资产款	921,500,000.00	-	-	-	-	-	-921,500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	17.87	17.87
应付管理人报	-	-	-	-	-	2,939,413.47	2,939,413.47

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	734,853.39	734,853.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	93,415.84	93,415.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	772,796.54	772,796.54
应付利息	-	-	-	-	-	1,158,147.46	1,158,147.46
应交税费	-	-	-	-	-	161,278.13	161,278.13
其他负债	-	-	-	-	-	251,333.00	251,333.00
负债总计	921,500,000.00	-	-	-	-	6,111,255.70	927,611,255.70
利率敏感度缺口	-866,106,490.44	64,982,000.00	557,351,285.20	3,950,438,703.15	946,550,039.92	1,018,547,294.73	5,671,762,832.56

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影响金额（单位：人民币元） 本期末（2018年12月31日）
	1. 市场利率上升 25 个基点	-48,572,318.36
	2. 市场利率下降 25 个基点	49,233,287.54

**7.4.13.4.2 外汇风险**

外汇风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

**7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日			合计
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	81,895,000.00	-	81,895,000.00
资产合计	-	81,895,000.00	-	81,895,000.00
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	-	81,895,000.00	-	81,895,000.00

**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影响金额(单位：人民币元)

		本期末 2018 年 12 月 31 日
	1. 港币相对人民币升值 5%	4,094,750.00
	2. 港币相对人民币贬值 5%	-4,094,750.00

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 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 2018 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	953,094,374.42	16.80
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	953,094,374.42	16.80

#### 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） 本期末（2018 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	61,493,506.29
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-61,493,506.29

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，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 (单位: 人民币元)	本期末 ( 2018 年 12 月 31 日 )
	1 天	22, 296, 732. 02
	1 周	49, 857, 008. 48

#### 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 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一层次的余额为 2, 513, 273, 508. 99 元，属于第二层次的余额为 3, 978, 055, 439. 20 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

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。

(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

### 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	953,094,374.42	14.44
	其中：股票	953,094,374.42	14.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,538,234,573.77	83.92
	其中：债券	5,538,234,573.77	83.92
	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	36,154,970.83	0.55
8	其他各项资产	71,890,169.24	1.09
9	合计	6,599,374,088.26	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 81,895,000.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 1.44%。

### 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	-	-
B	采矿业	15,125,000.00	0.27
C	制造业	459,010,453.65	8.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,760,000.00	0.26
E	建筑业	22,800,000.00	0.40
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	30,559,350.60	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,195,000.00	0.62

J	金融业	287,461,570.17	5.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,288,000.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	871,199,374.42	15.36

### 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	-	-
B 消费者非必需品	30,015,000.00	0.53
C 消费者常用品	-	-
D 能源	30,080,000.00	0.53
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	21,800,000.00	0.38
K 房地产	-	-
合计	81,895,000.00	1.44

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	601939	建设银行	14,279,000	90,957,230.00	1.60
2	601818	光大银行	20,000,000	74,000,000.00	1.30
3	601601	中国太保	2,421,235	68,835,711.05	1.21
4	601211	国泰君安	3,499,901	53,618,483.32	0.95
5	600887	伊利股份	1,865,300	42,678,064.00	0.75
6	002415	海康威视	1,599,894	41,213,269.44	0.73
7	600196	复星医药	1,725,100	40,143,077.00	0.71

8	002078	太阳纸业	6,697,002	38,172,911.40	0.67
9	600011	华能国际	2,000,000	14,760,000.00	0.26
9	00902	华能国际股份	5,000,000	21,800,000.00	0.38
10	600031	三一重工	3,999,985	33,359,874.90	0.59
11	600104	上汽集团	1,227,100	32,726,757.00	0.58
12	601111	中国国航	3,999,915	30,559,350.60	0.54
13	01088	中国神华	2,000,000	30,080,000.00	0.53
14	00175	吉利汽车	2,300,000	27,807,000.00	0.49
15	002271	东方雨虹	2,016,933	26,119,282.35	0.46
16	000333	美的集团	698,800	25,757,768.00	0.45
17	601668	中国建筑	4,000,000	22,800,000.00	0.40
18	300408	三环集团	1,300,000	21,996,000.00	0.39
19	002008	大族激光	699,942	21,250,239.12	0.37
20	002065	东华软件	3,000,000	20,850,000.00	0.37
21	002311	海大集团	801,434	18,569,225.78	0.33
22	600741	华域汽车	1,000,000	18,400,000.00	0.32
23	600600	青岛啤酒	500,000	17,430,000.00	0.31
24	600019	宝钢股份	2,552,400	16,590,600.00	0.29
25	600547	山东黄金	500,000	15,125,000.00	0.27
26	002470	金正大	2,233,600	14,116,352.00	0.25
27	300124	汇川技术	600,000	12,084,000.00	0.21
28	600176	中国巨石	1,126,648	10,894,686.16	0.19
29	300036	超图软件	500,000	9,165,000.00	0.16
30	603228	景旺电子	160,300	8,013,397.00	0.14
31	600066	宇通客车	628,600	7,448,910.00	0.13
32	002475	立讯精密	500,000	7,030,000.00	0.12
33	002027	分众传媒	1,200,000	6,288,000.00	0.11
34	300166	东方国信	500,000	5,180,000.00	0.09
35	600143	金发科技	1,000,000	4,950,000.00	0.09
36	01999	敏华控股	800,000	2,208,000.00	0.04
37	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.00
38	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 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
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	601939	建设银行	131,220,765.73	2.31
2	601818	光大银行	120,395,000.00	2.12
3	601601	中国太保	81,326,148.44	1.43
4	002078	太阳纸业	71,483,420.46	1.26
5	601211	国泰君安	60,233,787.77	1.06
6	002008	大族激光	59,428,203.54	1.05
7	600196	复星医药	59,237,249.63	1.04
8	002271	东方雨虹	57,687,966.64	1.02
9	002415	海康威视	54,466,153.14	0.96
10	600887	伊利股份	48,118,935.18	0.85
11	000333	美的集团	46,457,764.70	0.82
12	600031	三一重工	42,733,745.48	0.75
13	600104	上汽集团	39,435,795.00	0.70
14	00175	吉利汽车	39,373,849.43	0.69
15	601111	中国国航	38,443,013.00	0.68
16	600019	宝钢股份	35,585,167.80	0.63
17	01088	中国神华	34,752,560.71	0.61
18	300408	三环集团	31,519,484.12	0.56
19	002065	东华软件	26,302,287.37	0.46
20	600741	华域汽车	24,859,169.71	0.44

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	601818	光大银行	37,909,410.00	0.67
2	002008	大族激光	26,579,911.00	0.47
3	601939	建设银行	24,565,810.00	0.43
4	002271	东方雨虹	17,948,226.59	0.32
5	600019	宝钢股份	17,223,288.00	0.30
6	000333	美的集团	9,470,194.00	0.17
7	600031	三一重工	9,000,000.00	0.16
8	300760	迈瑞医疗	474,118.00	0.01

9	601319	中国人保	347,854.38	0.01
10	002938	鹏鼎控股	332,684.60	0.01
11	002936	郑州银行	237,198.50	0.00
12	002939	长城证券	231,506.64	0.00
13	601869	长飞光纤	215,255.10	0.00
14	601577	长沙银行	204,482.20	0.00
15	601162	天风证券	188,576.44	0.00
16	601068	中铝国际	143,896.50	0.00
17	601606	长城军工	133,285.10	0.00
18	300724	捷佳伟创	133,244.10	0.00
19	603590	康辰药业	101,767.47	0.00
20	002933	新兴装备	92,126.00	0.00

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	1,327,438,510.34
卖出股票收入（成交）总额	146,344,216.77

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,653,052,316.00	29.15
	其中：政策性金融债	1,362,399,000.00	24.02
4	企业债券	1,305,772,114.70	23.02
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,579,410,143.07	45.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,538,234,573.77	97.65

## 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	180211	18 国开 11	4,500,000	455,985,000.00	8.04
2	132013	17 宝武 EB	3,086,110	306,512,445.20	5.40
3	018005	国开 1701	2,500,000	251,100,000.00	4.43
4	180204	18 国开 04	2,300,000	240,856,000.00	4.25
5	132009	17 中油 EB	1,870,910	188,569,018.90	3.32

## 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

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

### 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将根据风险管理的原则，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。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

## 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	325,993.23
2	应收证券清算款	5,041,935.33
3	应收股利	33,996.29
4	应收利息	66,488,244.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,890,169.24

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132013	17 宝武 EB	306,512,445.20	5.40

2	132009	17 中油 EB	188,569,018.90	3.32
3	113009	广汽转债	141,999,463.90	2.50
4	127005	长证转债	117,014,656.32	2.06
5	110043	无锡转债	109,675,954.30	1.93
6	110040	生益转债	89,488,713.60	1.58
7	110032	三一转债	86,202,021.00	1.52
8	113508	新风转债	85,967,072.20	1.52
9	110042	航电转债	78,161,552.80	1.38
10	110041	蒙电转债	77,362,334.40	1.36
11	113019	玲珑转债	72,959,370.00	1.29
12	132006	16 皖新 EB	58,453,579.80	1.03
13	128028	赣锋转债	58,191,068.75	1.03
14	113011	光大转债	56,764,800.00	1.00
15	123006	东财转债	50,283,520.84	0.89
16	132004	15 国盛 EB	48,309,519.40	0.85
17	128035	大族转债	47,125,833.00	0.83
18	113018	常熟转债	41,991,148.80	0.74
19	113015	隆基转债	31,403,140.30	0.55
20	128016	雨虹转债	24,650,010.00	0.43
21	132012	17 巨化 EB	23,292,279.00	0.41
22	128027	崇达转债	21,963,882.38	0.39
23	113008	电气转债	21,008,000.00	0.37
24	132011	17 浙报 EB	18,504,304.00	0.33
25	128032	双环转债	18,275,740.98	0.32
26	113509	新泉转债	15,407,743.50	0.27
27	110033	国贸转债	9,699,963.90	0.17
28	123003	蓝思转债	5,185,417.60	0.09
29	128017	金禾转债	4,551,240.00	0.08
30	113504	艾华转债	2,166,320.00	0.04
31	132008	17 山高 EB	984,000.00	0.02

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东方红配置精选混合 A	45,048	124,306.60	9,921.08	0.00%	5,599,753,928.39	100.00%
东方红配置精选混合 C	1,352	163,626.60	-	-	221,223,165.82	100.00%
合计	46,400	125,452.31	9,921.08	0.00%	5,820,977,094.21	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方红配置精选混合 A	309,543.67	0.0055%
	东方红配置精选混合 C	41,113.72	0.0186%
	合计	350,657.39	0.0060%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方红配置精选混合 A	0~10
	东方红配置精选混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红配置精选混合 A	0~10
	东方红配置精选混合 C	0
	合计	0~10

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红配置精选 混合 A	东方红配置精选 混合 C
基金合同生效日（2018 年 5 月 21 日）基金份额总额	6,138,801,721.26	258,747,641.61
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,926,066.46	947,087.73
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	549,963,938.25	38,471,563.52
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	5,599,763,849.47	221,223,165.82

## § 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。本基金本报告期应支付给该事务所审计报酬为 13.3 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

### 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	981,138,893.39	66.65%	724,426.23	67.48%	-
宏信证券	1	411,503,625.25	27.95%	292,703.20	27.26%	-
国盛证券	1	47,369,381.26	3.22%	33,693.53	3.14%	-
招商证券	1	32,016,112.29	2.18%	22,773.29	2.12%	-
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。

#### 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。

### 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	4,499,252,465.75	88.70%	36,711,100,000.00	99.59%	-	-
宏信证券	381,758,570.66	7.53%	100,000,000.00	0.27%	-	-
国盛证券	152,088,749.83	3.00%	50,000,000.00	0.14%	-	-
招商证券	39,090,182.79	0.77%	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

### 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	东方红配置精选混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 5 月 22 日
2	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
3	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
4	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
5	东方红配置精选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务及暂停大额申购业务的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 8 月 13 日
6	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
7	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
8	关于东方红配置精选混合型证券投资基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 9 月 18 日
9	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
10	关于东方红配置精选混合型证券投资基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 9 月 26 日
11	关于东方红配置精选混合型证券投资基金主要投资市场	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 10 月 16 日

	节假日暂停申购、赎回业务的公告		
12	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
13	东方红配置精选混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 10 月 24 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 11 月 14 日
15	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
16	关于东方红配置精选混合型证券投资基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 12 月 21 日
17	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
18	关于东方红配置精选混合型证券投资基金主要投资市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2018 年 12 月 26 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配置精选混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红配置精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红配置精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 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

2019 年 3 月 27 日