

东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

持优质标的穿越市场的牛熊。我们不会刻意追求泛基金化和成长。这次调整后,很多具有真正成长性标的落入了投资价值区间,使得选择标的的范库变更多,我们也将在这方面进一步发力。

本产品仍将保持自下而上、长期视角的思路,坚持“幸运的行业、能干的管理层、合理的估值和市场预期”的投资理念,不随短期市场风格,希望通过在合理的价格选择优秀的公司力争给持有人带来长期的回报。

截至本报告期末本基金份额净值为3.222元;本报告期基金份额净值增长率为-4.93%,业绩比较基准收益率为-6.50%。

4.6 报告期内本基金有人数或基金资产净值预警说明
报告期内,本基金出现连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,131,244,320.49	90.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产投资	-	-
8	负债	-	-
9	资产减值准备	-	-
10	其他	-	-
11	合计	8,131,244,320.49	90.29

注:本基金本报告期末未有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,273,122,743.62	70.31
D	电力、热力、燃气及生产供应业	71,164.08	0.01
E	建筑业	241,048,020.48	2.70
F	交通运输、仓储和邮政业	113,564,610.04	1.28
G	信息传输、软件和信息技术服务业	220,467,080.00	2.47
H	金融业	402,156,406.06	4.55
I	房地产业	387,643,022.13	4.35
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,228.14	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	24,247,013.32	0.27
S	其他	-	-
合计		8,131,244,320.49	91.14

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未有通过港股通交易机制投资的港股。

东方红价值精选混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

注:市政改的实质性变化,对权益市场开始有所支撑。我们依然坚持价值投资理念,注重自下而上精选个股。主要关注具备合理、基本面稳健的消费类个股,业绩高增长、估值合理的部分成长类个股,一揽子行业龙头股。有息资产中,我们依然坚持“幸运的行业、能干的管理层、合理的估值和市场预期”的投资理念,不随短期市场风格,希望通过在合理的价格选择优秀的公司力争给持有人带来长期的回报。

截至本报告期末本基金份额净值为1.0415元;本报告期基金份额净值增长率为-2.07%,业绩比较基准收益率为-1.22%。

4.6 报告期内本基金有人数或基金资产净值预警说明
报告期内,本基金出现连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	265,528,660.18	88.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,100,899,394.48	76.21
4	金融衍生品投资	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产投资	-	-
8	负债	-	-
9	资产减值准备	-	-
10	其他	-	-
11	合计	1,407,588,326.35	100.00

注:本基金本报告期末未有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	163,874,100.88	56.86
D	电力、热力、燃气及生产供应业	71,164.08	0.01
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	3,646,000.00	0.36
G	信息传输、软件和信息技术服务业	4,289,340.00	0.41
H	金融业	22,677,227.36	3.12
I	房地产业	1,122,529,260.00	3.15
J	其他	-	-
K	居民服务、修理和其他服务业	7,729,260.00	0.57
L	水利、环境和公共设施管理业	38,687,278.88	1.97
M	科学研究和技术服务业	61,228.14	0.01
N	文化、体育和娱乐业	81,228.14	0.01
O	教育	-	-
P	卫生和社会工作	-	-
Q	其他	-	-
合计		265,528,660.18	24.40

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000009	深发展A	3,226,000	42,636,796.00	4.07
2	000045	深天马A	2,500,000	22,497,000.00	2.15
3	300012	华测检测	3,521,100	30,211,114.00	1.93
4	300066	东方国信	1,000,000	10,638,000.00	1.41
5	300071	华宇软件	766,042	13,566,627.36	1.28
6	000038	深大通	200,000	10,638,000.00	1.02
7	600033	三一重工	550,000	9,610,000.00	0.92
8	002778	锐奇股份	1,000,000	9,706,400.00	0.97
9	300078	圣邦股份	960,000	9,700,800.00	0.97
10	000028	深天地	360,707	9,056,247.4	0.86

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	6,000,000.00	0.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,875,000.00	1.67
4	企业债券	50,000,000.00	0.47
5	公司债	710,623,700.00	6.60
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	50,817,000.00	0.52
8	可转债(可交换债)	143,684,888.79	1.37
9	其他	-	-
10	合计	1,100,899,394.48	100.11

5.5 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债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130770	13国债(7)	600,000	58,780,000.00	5.63
2	130029	13国开债	600,000	49,790,000.00	4.76
3	130430	14国债(4)	500,000	49,275,000.00	4.71
4	130022	13国债(2)	500,000	49,000,000.00	4.68
5	130025	13国债(5)	500,000	49,030,000.00	4.68

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

本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.9.2 本基金股指期货投资的投资目的,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,以争取相应股票组合的超额收益。

5.10.1 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,以争取相应债券组合的超额收益。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资评价

5.11 投资组合报告附注

本基金持有的国信证券(代码:000726)发行主体国信证券股份有限公司(以下简称“公司”),因公司债券业务及融资融券业务违反证券法律法规,于2018年6月12日收到中国证监会《行政处罚决定书》(2018140号),具体处罚决定为:(一)对于国信证券债券业务行为,责令

5.11.1 投资组合报告附注

5.11.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.4 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.7 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.24 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.28 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.32 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.34 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.36 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.37 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.38 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.40 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.41 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.42 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.43 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.44 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.45 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.46 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.47 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.48 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.49 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.50 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.51 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.52 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.53 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.54 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.55 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.56 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.57 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.58 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.59 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.60 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.61 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.62 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.63 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.64 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.65 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.66 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.67 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.68 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.69 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.70 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.71 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.72 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.73 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.74 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.75 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.76 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.77 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.78 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.79 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.80 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.81 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.82 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.83 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.84 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.85 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.86 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.87 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.88 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.89 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.90 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.91 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.92 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.93 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.94 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.95 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.96 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.97 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.98 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.99 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.100 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.101 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.102 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明