

基金管理人:东方基金管理有限责任公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一八年七月十九日

5.1 重要提示

基金管理人的董事会或监事会在报告期间不存虚假记载、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责任。

基金托管人报告期间不存虚假记载、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责任。

## 东方财富量化成长灵活配置混合型证券投资基金

### 2018年第二季度报告

4.6 报告期末基金份额持有人数或基金资产净值情况

报告期末,本基金不存在连续二十个工作日基金资产净值低于五百万元的情形。

5.6 投资组合报告

5.6.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 311,667,991.00 53.20

其中:股票 311,667,991.00 53.20

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 38,671,500.00 6.60

其中:债券 38,671,500.00 6.60

货币市场基金 - -

4 现金类投资 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 其他资产 170,000,000.00 29.02

其中:应收类资产 - -

7 银行存款和结算备付金合计 53,369,758.95 9.11

8 其他资产 12,166,285.07 2.08

9 合计 695,975,536.02 100.00

6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

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 019800 国开1701 300,000 30,114,000.00 5.20

2 110038 游行债券 70,000 8,567,500.00 1.45

3 - - - - -

4 - - - - -

5 - - - - -

6 - - - - -

7 019701(可转换债) 8,567,500.00 1.45

8 现金类投资 - - - - -

9 其他 - - - - -

10 合计 38,671,500.00 6.60

6.6 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贵金属投资明细

序号 代码 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 A 农、林、牧、渔业 3,745,602.00 0.65

2 B 制造业 5,767,665.00 0.99

3 C 制造业 181,787,965.00 31.39

4 D 电力、热力、燃气及水生产和供应 2,915,301.00 0.50

5 E 建筑业 4,445,936.00 0.77

6 F 铁路、船舶、航空航天和其他运输业 5,174,940.00 0.89

7 G 交通运输、仓储和邮政业 14,027,022.48 2.42

8 H 在业批发和零售业 - - - - -

9 I 信息传输、软件和信息技术服务业 25,423,089.40 4.39

10 J 金融业 38,341,517.00 6.62

11 K 现代服务业 7,687,666.00 1.33

12 L 相关行业服务和辅助服务业 6,642,122.40 1.19

13 M 科学研究、技术和服务业 136,634.00 0.02

14 N 水利、环境和公共设施管理业 1,306,122.00 0.24

15 O 国际贸易、代理和经纪业 - - - - -

16 P 教育 - - - - -

17 Q 卫生、文化和娱乐业 11,328,018.00 1.96

18 R 文化、体育和娱乐业 2,895,104.00 0.48

19 S 综合 51,460.00 0.01

20 合计 311,667,991.00 53.20

6.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 A 农、林、牧、渔业 3,745,602.00 0.65

2 B 制造业 5,767,665.00 0.99

3 C 制造业 181,787,965.00 31.39

4 D 电力、热力、燃气及水生产和供应 2,915,301.00 0.50

5 E 建筑业 4,445,936.00 0.77

6 F 铁路、船舶、航空航天和其他运输业 5,174,940.00 0.89

7 G 交通运输、仓储和邮政业 14,027,022.48 2.42

8 H 在业批发和零售业 - - - - -

9 I 信息传输、软件和信息技术服务业 25,423,089.40 4.39

10 J 金融业 38,341,517.00 6.62

11 K 现代服务业 7,687,666.00 1.33

12 L 相关行业服务和辅助服务业 6,642,122.40 1.19

13 M 科学研究、技术和服务业 136,634.00 0.02

14 N 水利、环境和公共设施管理业 1,306,122.00 0.24

15 O 国际贸易、代理和经纪业 - - - - -

16 P 教育 - - - - -

17 Q 卫生、文化和娱乐业 11,328,018.00 1.96

18 R 文化、体育和娱乐业 2,895,104.00 0.48

19 S 综合 51,460.00 0.01

20 合计 311,667,991.00 53.20

6.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 代码 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000913 东方财富 288,269,004.02 53.90

2 002732 伟星新材 20,060,000.00 3.74

3 002073 东软集团 18,000,000.00 3.21

4 002070 东电环境 17,000,000.00 3.02

5 002071 东华软件 16,000,000.00 2.90

6 002072 东华软件 16,000,000.00 2.90

7 002073 东软集团 16,000,000.00 2.90

8 002074 东软集团 16,000,000.00 2.90

9 002075 东软集团 16,000,000.00 2.90

10 002076 东软集团 16,000,000.00 2.90

11 002077 东软集团 16,000,000.00 2.90

12 002078 东软集团 16,000,000.00 2.90

13 002079 东软集团 16,000,000.00 2.90

14 002080 东软集团 16,000,000.00 2.90

15 002081 东软集团 16,000,000.00 2.90

16 002082 东软集团 16,000,000.00 2.90

17 002083 东软集团 16,000,000.00 2.90

18 002084 东软集团 16,000,000.00 2.90

19 002085 东软集团 16,000,000.00 2.90

20 002086 东软集团 16,000,000.00 2.90

21 002087 东软集团 16,000,000.00 2.90

22 002088 东软集团 16,000,000.00 2.90

23 002089 东软集团 16,000,000.00 2.90

24 002090 东软集团 16,000,000.00 2.90

25 002091 东软集团 16,000,000.00 2.90

26 002092 东软集团 16,000,000.00 2.90

27 002093 东软集团 16,000,000.00 2.90

28 002094 东软集团 16,000,000.00 2.90

29 002095 东软集团 16,000,000.00 2.90

30 002096 东软集团 16,000,000.00 2.90

31 002097 东软集团 16,000,000.00 2.90

32 002098 东软集团 16,000,000.00 2.90

33 002099 东软集团 16,000,000.00 2.90

34 002100 东软集团 16,000,000.00 2.90

35 002101 东软集团 16,000,000.00 2.90

36 002102 东软集团 16,000,000.00 2.90

37 002103 东软集团 16,000,000.00 2.90

38 002104 东软集团 16,000,000.00 2.90

39 002105 东软集团 16,000,000.00 2.90

40 002106 东软集团 16,000,000.00 2.90

41 002107 东软集团 16,000,000.00 2.90

42 002108 东软集团 16,000,000.00 2.90

43 002109 东软集团 16,000,000.00 2.90

44 002110 东软集团 16,000,000.00 2.90

45 002111 东软集团 16,000,000.00 2.90

46 002112 东软集团 16