

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

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告书部分财务资料未经审计。

本报告书自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

基金名称 东方岳灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 002045

交易代码 002045

前端申购代码 002045

前端赎回代码 002045

基金合同生效日 2010-03-01

报告期基金净值总额 201,633,748.049

投资目标 本基金在严格控制风险的基础上，灵活调整资产配置，力争实现超越业绩比较基准的收益。

投资策略 本基金通过对外类资产的灵活配置，在严格控制风险的基础上，通过资产配置，力争实现超越业绩比较基准的收益。

业绩比较基准 30%×沪深300指数收益率+70%×中债总全价(含息)收益率

风险收益特征 本基金为混合型基金，其风险收益特征与沪深300指数基金、中债总全价(含息)指数基金相似，属中等风险水平的基金。

基金管理人 东方基金管理有限责任公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

1.本期已实现收益 2,360,746.74

2.本期利润 -18,413,576.70

3.期末可供分配基金份额利润 -0.0086

4.期末基金资产净值 210,286,794.45

5.期末基金份额净值 1.0008

注:①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)扣除非经常性损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所本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上述数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期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 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%)

过去三个月 -0.02% 1.01% 0.98% -0.24% 0.77%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

1.本期已实现收益 6,796,470.01

2.本期利润 1,981,967.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.00080

4.期末基金资产净值 210,885,070.61

5.期末基金份额净值 1.0706

注:①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)扣除非经常性损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所本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上述数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本期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 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%)

过去三个月 -0.02% 1.01% 0.98% -0.24% 0.77%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

1.本期已实现收益 6,796,470.01

2.本期利润 1,981,967.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.00080

4.期末基金资产净值 210,885,070.61

5.期末基金份额净值 1.0706

注:①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)扣除非经常性损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所本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上述数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本期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 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%)

过去三个月 -0.02% 1.01% 0.98% -0.24% 0.77%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

1.本期已实现收益 -15,027,062.33

2.本期利润 -17,009,581.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.00080

4.期末基金资产净值 119,644,360.29

5.期末基金份额净值 0.9803

注:①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)扣除非经常性损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所本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上述数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本期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 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%)

过去三个月 -0.02% -0.53% 0.68% -0.29% 0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

1.本期已实现收益 -15,027,062.33

2.本期利润 -17,009,581.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.00080

4.期末基金资产净值 119,644,360.29

5.期末基金份额净值 0.9803

注:①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)扣除非经常性损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所本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上述数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本期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 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%)

过去三个月 -0.02% -0.53% 0.68% -0.29% 0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

1.本期已实现收益 -15,027,062.33

2.本期利润 -17,009,581.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.00080

4.期末基金资产净值 119,644,360.29

5.期末基金份额净值 0.9803

注:①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)扣除非经常性损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所本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上述数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本期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 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%)

过去三个月 -0.02% -0.53% 0.68% -0.29% 0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

1.本期已实现收益 -15,027,062.33

2.本期利润 -17,009,581.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.00080

4.期末基金资产净值 119,644,360.29

5.期末基金份额净值 0.9803

注:①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)扣除非经常性损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所本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上述数字。

3.2.3 基金净值表现

3.2.1 本期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 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 收益率差(%)

过去三个月 -0.02% -0.53% 0.68% -0.29% 0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日～2018年6月30日)

1.本期已实现收益 -15,027,062.33

2.本期利润 -17,009,581.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.00080

4.期末基金资产净值 119,644,360.29

5.期末基金份额净值 0.9803

注:①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)扣除非经常性损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所本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上述数字。

3.2.3 基金净值表现