东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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8月27日

§1 重要提示

1.1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司的董事会、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。本半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8月23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。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红优享红利混合
基金主代码	003396
前端交易代码	003396
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10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
报告期末基金份额总额	2,496,116,269.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于现金股息率高、分红稳定的优质上市公司,通过上市公司的高比例分红收益,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用定量和定性相结合的方式,通过大类资产配置、红利证券筛选、精选股息率高、分红稳定的优质公司作为本基金的主要投资对象。在中国经济增长模式转型的大背景下,红利策略为证券提供了高安全边际,同时在震荡市中具有较高的防御性。本基金重点关注具有较好盈利能力和持续成长能力的红利型股票,通过构建证券基础库、精选证券,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×60% +恒生指数收益率×20% +中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一以股价预基金,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	任莉	张燕
	联系电话	021-63326888	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

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com	
基金半年度报告备置地点	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	

§3主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	256,926,013.54
本期利润	-218,668,058.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0796
本期基金份额净值增长率	-6.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2046
期末基金资产净值	3,459,601,376.17
期末基金份额净值	1.3860

注:1、表中的“期末”均指报告期最后一日,即6月30日;“本期”指2018年1月1日-2018年6月30日。

2、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(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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。

4、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)。

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
过去一个月	-5.28%	1.63%	-5.75%	0.90%	0.47%	0.73%
过去三个月	-5.16%	1.38%	-5.83%	0.79%	0.67%	0.59%
过去六个月	-6.08%	1.31%	-7.19%	0.84%	1.11%	0.47%
过去一年	13.66%	1.10%	-1.85%	0.66%	15.51%	0.44%
自基金合同生效起至今	38.60%	0.92%	6.70%	0.59%	31.90%	0.33%

注:自基金合同生效日起至今指2016年10月31日-2018年6月30日。

根据基金合同中的有关规定,本基金的业绩比较基准=中证红利指数收益率×60% +恒生指数收益率×20% +中国债券总指数收益率×20%。

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(benchmarkt)按下列公式计算:

benchmarkt =60% *[t日中证红利指数/(t-1日中证红利指数)-1] +20%* [t日恒生指数/(t-1日恒生指数)-1] +20%* [t日中国债券总指数/(t-1日中国债券总指数)-1];

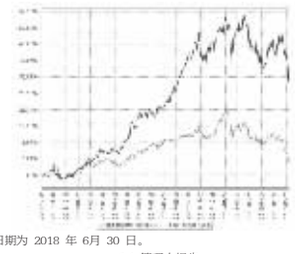
其中,t=1,2,3,. . . T,T表示时间截至日;

t日至T日的期间收益率(benchmarkTt)按下列公式计算:

benchmarkTt =[∏Tt(1+benchmarkt)]-1

其中,T=2,3,4,. . . ; ∏Tt(1+benchmarkt)表示t日至T日的(1+benchmarkt)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 6月 30 日。

§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》(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6月30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6个月定期开放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三十三只证券投资基金。

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		
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、东方红睿元三年定期开放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、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016年10月31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、东方红沪港深混合基金经理。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》的规定。

4.3.2 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

2018年上半年沪深300指数下跌12.90%,中小板指下跌14.26%,创业板下跌8.33%。2018年上半年受农观去杠杆跟国际贸易争端影响,市场呈现普跌的状态。从行业表现来看,休闲服务、医药生物、食品饮料等几个防御性行业出现了正收益。通信、电气设备、机械设备、有色金属等都分行业出现比较大的跌幅。 本产品上半年净值下跌6.08%。

美国特朗普政府执意掀起贸易争端,已经向包括中国加拿大墨西哥等国家挑起加关税的举动,并且引起各国的反击,贸易争端恐怕是未来几年世界经济面临的常态。中美之间的贸易关系也在这个背景下形势趋于不明朗,必须做好对美贸易受冲击的心理准备。在这种外部环境下,更加需要内部经济结构加快转型,逐步把经济的增长动力转移到内需上来。工业增加值的增速经历二月份的春节因素的异常值之后恢复正常。通胀水平也随着春节因素的消除而回落到平稳水平。需要关注的是,随着贸易争端的继续,出口的压力逐渐显现,消费增速也在回落,固定资产投资方面基建增速很低只有房地产投资增速维持在较高的水平,需要观察房地产投资增速下行对经济带来的负面冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.3860元,份额累计净值1.3860元;本报告期基金份额净值增长率为-6.08%,业绩比较基准收益率为-7.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,继续看好稳定性强的大众消费龙头与可选消费龙头:看好住宅后市场包括装修、家居、社区 服务等机会;看好高端精密制造的产业集群优势与生产的相对优势;看好创新医药的龙头与医药 服务龙头;看好供给侧收缩有效带来的竞争结构大幅改善的部分周期行业龙头;同时看好港股市场的历史性机会。

4.6 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的持续使用性,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,具有基金从业人员资格,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。

4.7 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、若《基金合同》生效不满3个月则可不进行收益分配;

4、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;

5、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;

6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

本基金本报告期未进行利润分配。

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。

4.8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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半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半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	323,844,822.48	409,260,697.26
结算备付金	437,561.85	41,814,849.97
存出保证金	477,606.78	4,159,489.96
交易性金融资产	3,147,353,621.08	4,070,406,398.45
其中:股票投资	3,147,353,621.08	4,064,834,598.45
基金投资	-	-
债券投资	-	5,571,800.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	721,876.98	108,132,810.51
应收利息	70,980.81	103,376.96
应收股利	2,561,616.00	-
应收申购款	7,849,081.99	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,483,317,167.97	4,633,877,623.01
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	48,419,827.09
应付赎回款	13,769,428.36	14,417,664.13
应付管理人报酬	4,534,237.56	5,751,221.38
应付托管费	755,706.28	958,536.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,465,669.78	3,868,517.22
应交税费	20.37	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	190,729.45	336,293.23
负债合计	23,715,791.80	73,752,059.95
所有者权益:		
实收基金	2,496,116,269.10	3,090,063,483.47
未分配利润	963,485,107.07	1,470,062,079.59
所有者权益合计	3,459,601,376.17	4,560,125,563.06
负债和所有者权益总计	3,483,317,167.97	4,633,877,623.01

6.2 利润表

会计主体:东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-180,036,904.27	422,143,258.15
1.利息收入	1,635,964.58	4,187,874.37
其中:存款利息收入	1,585,496.93	1,940,790.74
债券利息收入	604.64	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	49,863.01	2,247,083.63
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	292,360,779.59	76,756,786.70
其中:股票投资收益	246,775,342.40	48,327,596.46
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,214,568.01	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	44,370,869.18	28,429,191.24
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-475,594,071.98	340,286,885.37
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,560,423.54	911,711.71
减:二、费用	38,631,154.17	18,100,801.98
1. 管理人报酬	30,199,245.07	13,091,524.31
2. 托管费	5,033,207.55	2,181,920.73
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,247,260.93	2,627,314.80
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	2.18	-
7. 其他费用	151,438.44	200,042.14
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-218,668,058.44	404,042,456.17
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-218,668,058.44	404,042,456.17

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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)	3,090,063,483.47	1,470,062,079.59	4,560,125,563.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-218,668,058.44	-218,668,058.44
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)	-593,947,214.37	-287,908,914.08	-881,856,128.45
其中:1.基金申购款	95,286,887.30	41,844,019.71	137,130,907.01
2.基金赎回款	-689,234,101.67	-329,752,933.79	-1,018,987,035.46
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)	2,496,116,269.10	963,485,107.07	3,459,601,376.17
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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)	989,179,597.10	-8,453,115.24	980,726,481.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	404,042,456.17	404,042,456.17
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)	1,349,363,000.95	117,569,580.79	1,466,932,581.74
其中:1.基金申购款	1,641,468,193.19	154,833,324.79	1,796,301,517.98
2.基金赎回款	-292,105,192.24	-37,263,744.00	-329,368,936.24
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)	2,338,542,598.05	513,158,921.72	2,851,701,519.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方红优享红利沪港深灵活配置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”)《关于准予东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金的注册的批复》(证监许可[2016]1258)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》及其配套规则和《东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2016年10月31日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期。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。

本基金于2016年10月24日向社会公开募集, 并于2016年10月24日提前结束募集,扣除认购费后的有效认购资金989,089,780.91元, 利息结转份额89,816.19元, 募集规模为989,179,597.10份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红优享红利沪港深灵活配置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,包括国内依法发行的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或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的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。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%—95%(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0-95%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%); 本基金投资于红利型证券不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货和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%。

本基金的业绩比较基准为:中证红利指数收益率×60% +恒生指数收益率×20% +中国债券总指数收益率×20%。

6.4.2 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》、《东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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》、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。

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2018年1月1日起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。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。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。-

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券	1,059,932,875.53	49.82%	1,547,240,583.38	68.75%

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券	182,000,000.00	100.00%	8,177,700,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 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1月1日至2018年6月30日				上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	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	799,293.62	51.10%	4,055,857.18	90.82%	1,154,799.24	69.78%	1,494,817.24	84.32%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	30,199,245.07	13,091,524.31
其中:支付销售机构的客户维护费	15,588,191.59	7,208,449.89

注:1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提 。管理费的计算方法如下:

H = E X 1.50% ÷ 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,033,207.55	2,181,920.73

注: 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H = E × 0.25% ÷ 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。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	323,844,822.48	1,540,889.79	626,139,181.68	1,803,503.88

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内