基金管理人负责人

东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司基金托管人:平安银行股份有限公司送出日期:2018年8月27日

§ 1 重要提示

医出日期:2018年3月27日

1.1 重要提示
1.1 重要提示
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。本半年度报告由董事长签发。基金托管人平安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行细阅读本基金的招募说明书及其更新。本报告申时务资料未经审计。本报告即自2018年01月01日起至06月30日止。本半年度报告语要骑自半年度报告正文。

§ 2 基金简介 2.1 基金基本情况 前端交易代码 基金运作方式

设告期末基金份额总额 2.2 基金产品说明 *基金在严格控制投资组合风险的前提下,追求资产 Q资目标

净值的长期隐健增值。

本基金中国经济增长模式转型的大背景下,寻找深合经济发展的动作可求,积极代题由新强加强化人口结构细胞、增加环境均级、产业开级、而业供或后储券大起的带来的投资组合、控制工作分中的优势的企业、分享增加时间经济增长的成果,在产龄内成设的特别企业、分享增加中国经济增长的成果,在产龄内成分的大量、自然不是金沙发生的成果,在产龄分别。 业绩比较基准 至由實化 20%,中国债券会捐款收益率 20%, 本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险。较高 侧期收益的证券投资基金尚申,其预即风险与收益员 于债券增基金与货市市场基金,低于股票型基金。 经金亩了投资人外,从可根据设计成规定投资管 值联合之厕所上市的股票,除了需要承担与调印证券 设资基金类似的市场被对风险等。 般投资风险之外。 1险收益特征 2.3 基金管理人和基金托管/

- 海东方证券资产管理2 安银行股份有限公司 **信息披露负责** 客户服务电话 .4信息披露方式

E-
全年度报告备置地点 18 5047 号 § 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

Q资策略

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	125,326,253.31
本期利润	-68,623,260.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0661
本期基金份额净值增长率	-5.08%
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	0.1425
期末基金资产净值	1,415,074,459.13
期末基金份额净值	1.362

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

《使变动收益》 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 4、期末可跌分配利润,木加粉不风,以以水、水 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 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

(I) - (3)

生主1. 自基金合同生效日起至今指2016年1月20日-2018年6月30日。
2. 根据基金合同中的有关规定,本基金的前三年封闭运作,在封闭期内不开申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金制。封闭期周漏后,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。本基金的业绩比较准

 $\label{eq:problem} \Phi(x) = (x) + (x$ become explicit who will be a compared to the second of the control of the contro

HE 1,44... 7-. 110.

ter most offer entrance.

θην και με αποκειών αποκειών αν στο αποκειών «πον.

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 27,118

E券投资					 简介
姓名	职务		基金经理(助 期限	证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期	NE-4-PR	
刚登峰	东方红虎转槽选 灵起起式诉方组配置 克克配置证券的编杆 克克配置证券的编杆 克克配置证券的编杆 是全面标列。 一般一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一	2016年1月 20日	-	9年	磁土,曾任东方证券股份有 股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级 研究员、投资经理即理。营 领研究员、投资经理即理。营 经所介及人投资经理即理。营 近年年中海经验会。东方红等等 设定海标户条。东方红 使冲速按定年的条合、东方红 中港经是有一个。东方红 新春丛从业资格、中国国 籍。

^{芝理。} 注:1、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职日期;对此后非首任基金经理,基金经理的"任 职日期"和"腐任日期"均指根据公司决定确定的明任日期和解聘日期。 2、证券从业的路义理从行业协会、征券业从业人员资格管理办法》的相关规

定等。
2、证券从业的阔义選从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。
42 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投资法》。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。
43 管理人对报告期内公平交易情的的专项说明
431 企业交易制度的执行情况
本基金管理人一贯公平对待旅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。
42 2 异常交易行为的专项说明
报告期内末发现本基金存在异常交易行为。报告期内,未出现资产管理有限公司公平交易制度》的规定。
42 2 异常交易行为的专项说明
报告期内末发现本基金存在异常交易行为,报告期内,未出现资产量和保险。
46 管理人对报告期内,基础的投资策略和业绩表现的说明
441 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
441 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4218年上半年产深公的指数下跌上90%,中小板指下跌1426%,创业板下跌833%。2018年上半年产深公的指数下跌150%,中小板指下跌1426%,创业板下跌833%。2018年上半年产资公的指数下跌150%,由一板指下跌1426%,创业板下跌833%。2018年上半年受宏观去杠杆最国际贸易争端影响,市场呈现普货的状态。从行业表现来看,休闲服务,医药生物、食品饮料等几个价值性行业出现了正收益。通信,电气设备,机械设备、有色金属等部分行业出现比较大的跌幅。本产品上半年净值下跌5.08%。

美国特朗普政府执意松起贸易争端。已经向包括中国加拿大墨西哥等国家挑起加茶船的举动,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明。必须做好对美贸易受决击的心理借备。在这种外部环境下,更加需要内围经济结构加快转型,逐步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各市因素的异常但之后恢复正常。通胀大平也随着春节因素的消除而回落到平愈水平。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础增强很低只有房地平投资增速持在较高的水平,需要观察房地产投资增速下行对经济带来的负面冲击。

同和托管协议的规定,对本基金的投资证产证分区基金证》及共电判大弦评证规、基金可同和托管协议的规定,对本基金的投资证产进行了必要的监备,对基金资产净值的计算。基金份卿申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核、未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。
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。
6.1 资产负债表。6.1 资产负债表。

3.1页广页版表 会计主体:东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金

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	169,697,468.78	163,629,086.18
结算备付金	7,364,248.99	2,597,439.18
存出保证金	853,983.69	383,919.0€
交易性金融资产	1,247,585,580.37	1,506,363,702.59
其中:股票投资	1,247,585,580.37	1,504,676,102.59
基金投资	-	-
债券投资	-	1,687,600.00
资产支持证券投资	-	
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买人返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	28,340,471.30
应收利息	33,908.66	30,562.55
应收股利	1,058,510.40	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	_	
其他资产	_	
资产总计	1,426,593,700.89	1,701,345,180.83
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	6,917,434.88	56.78
应付赎回款	-	
应付管理人报酬	1,825,787.65	2,113,572.47
应付托管费	304,297.94	352,262.07
应付销售服务费	-	
应付交易费用	2,293,196.71	1,980,912.48
应交税费	6.09	
应付利息	-	-
应付利润	-	
递延所得税负债	_	_
其他负债	178,518.49	280,000.00
负债合计	11,519,241.76	4,726,803.80
所有者权益:		. , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
实收基金	1,038,637,366.58	1,038,637,366.58
未分配利润	376,437,092.55	657,981,010.48
所有者权益合计	1,415,074,459.13	1,696,618,377.03
	-,,,,,	

6.2 利润表 会计主体:东方红睿轩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

	1-100	单位:人民
項目	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	-53,827,011.51	317,222,527.51
.利息收入	845,308.79	1,435,933.72
其中:存款利息收入	714,038.82	765,221.81
责券利息收入	183.20	-
资产支持证券利息收入	-	-
天人返售金融资产收人	131,086.77	670,711.91
其他利息收入	-	-
.投资收益(损失以"-"填列)	139,277,193.30	90,691,167.84
其中:股票投资收益	122,137,723.38	73,256,860.48
基金投资收益	-	-
责券投资收益	368,030.83	-
资产支持证券投资收益	-	-
号金属投资收益	-	_
行生工具收益	-	-
 以利收益	16,771,439.09	17,434,307.36
公允价值变动收益(损失以"-"号 真列)	-193,949,513.60	225,095,425.95
.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
其他收入(损失以"-"号填列)	-	_
或:二、费用	14,796,248.78	12,139,197.72
. 管理人报酬	11,310,828.88	8,918,759.92
. 托管费	1,885,138.14	1,486,460.00
. 销售服务费	-	_
. 交易费用	1,199,841.96	1,425,757.28
. 利息支出	-	_
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
. 税金及附加	0.65	-
. 其他费用	400,439.15	308,220.52
E、利润总額(亏损总额以"-"号填 剂)	-68,623,260.29	305,083,329.79
或:所得税费用	-	_
9、净利润(净亏损以"-"号填列)	-68,623,260.29	305,083,329.79

本报告期:2018年1	711H ± 2010+0	у 100Д	单位:人民				
		本期					
项目	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)	1,038,637,366.58	657,981,010.45	1,696,618,377.03				
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	-68,623,260.29	-68,623,260.29				
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)	_	-	-				
其中:1.基金申购款	-	_	-				
2.基金赎回款	-	_	_				
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)	-	-212,920,657.61	-212,920,657.61				
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,038,637,366.58	376,437,092.55	1,415,074,459.13				
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)	1,038,637,366.58	76,791,831.20	1,115,429,197.78				
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	305,083,329.79	305,083,329.79				
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)	-	-	-				
其中:1.基金申购款	-	_	-				
2.基金赎回款	-	-	-				
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)	-	-43,622,776.85	-43,622,776.85				
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,038,637,366.58	338,252,384.14	1,376,889,750.72				

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署

2018年半年度报告摘要

本报告期内及上年度可比期间基金管理人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

6.4.8.5 且	1关联方保管的	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		は期 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		
冶你	期末余額	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
平安银行	169,697, 468.78	692,378.36	159,096,642.64	704,568.68	

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

64.9.1 因认购新发/增发证券而于明末持有的流通受限证券 6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

互联互通机制类似的机制参与其他市场的证券投资、本基金可且投参与相关市场的证券投资、本基金与直接处通投资的相关约定通用于本基金参与其他市场的证券投资、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。开放期内每个交易日日终、股票资产投资比例为基金资产的0%—95%、投资于推股通标的股票的比例占基金资产的0%—95%、投资于推股通标的股票的比例占基金资产的0%—95%、投资于推股通标的股票的比例占基金资产的0%—96%。投资于推股通标的股票的比例占基金资产的0%—50%),封闭期内存 时0%-95%,投资于程股連标的股票的比例占基金资产的0%-05%,其初期内每个交易日日终、股票资产投资比例为基金资产的0%-100%,其中20%。 发行上市的股票的比例占基金资产的0%-100%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0%-10%),按证投资比例为基金资产的0%-05%-1开放期每个交易日日终,在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持观金或者到明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%,在封闭期内, 注:基金可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办

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》),但可以发现出的发现。 报告》),但可证券投资基金财务会以下商标"中国基金业协会"以下府的"证券投资基金基金"的企业。 资基金会计核算业务指引》、《东方红普轩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

本基金不受上述5%的限制。本基金的业绩比较基准为:沪深300 指数×60%+恒

本财务报表以持续经营为基础编制。

生指数×20%+中国债券总指数收益率×20%。

本则为我农纪/有沙森尼岛/为盐咖油制。 64.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明 本基金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 6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间经营成果和基 金净值变动情况等有关信息。

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

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

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。

本基金本报告期未发生会计估计变更。

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

0.40 06/9。 根据财政部、国家税务总局财税1200811号《关于企业所得税若干优惠政策的 通知》、财税12012185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12014181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 急至此的企作增值核试点的通知》,財稅[2016]46号《关于进一步明确全面推开营政 增试点金融业有关政策的通知》,財稅[2016]70号《关于金融財財同业往来等增值 核政策的计关通知》,財稅[2016]70号《关于金融財財同业往来等增值 张政策的计关通知》,財稅[2016]127号《財政部国家稅务总局证监会关于落港股 票市场交易互联互通机制试点有关稅收政策的通知》,財稅[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 等资产品等值移成效单方间题的补充通知》,财税12017196号《天子资管产品增值 税有关问题的通知》,财税12017190号《天子租人固定资产进项税额抵扣等增值税 政策的通知及其他相关的核法规和设务操作、主要线项列示如下。 (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

幼科人 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从以后月份的增值税的转移额中抵绌。 对证券投资基金管理人运用超金买卖股票、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 的17-671-1、00.627%的T-7人的特殊。对基本外上口公司取得的18.63年代的 在1个月以内含1个月的,其股息红利所得全额计人应纳税所得额;持股期限在1 个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计人应纳税所得额;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, 按昭上述规定计算幼科,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 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市口股取得的股息红利, 口股公

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,由中国结算向日股公司提供内地个人投资者名册,日股公司按照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日股取得的股息红利,由中 国结算按昭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。 亚人股票不征收股票交

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。 6.4.7.1 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

本报告期存在控制关系或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 基金管理人、基金销售机构 \$全托管人,基金销售和料

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

成交余額 成交余額 本基金本报告期内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

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元 上年度可比期间 月1日至2017年6月30日 6.4.8.1.4 权证交易 本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

关联方名称	2018年1月1日至2018年6月30日					
天味月老桥	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	303,082.01	51.64%	2,146,849.14	93.62%		
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日					
天联万石桥	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	426,963.55	59.15%	1,183,220.81	86.56%		
注:1、上述佣金	参考市场价格	经本基金的基	金管理人与对力	方协商确定,以		

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 日中国组分至12年7月成月正公司成队的加昌设料经于风口行动的小。 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。

6.4.8.2.1 基金管理费

为前一日的基金资产净值

单位:人民币元 項目 8.918.759 其中:支付销售机构的 中维护费 5.688.651.38 4.513.198.

H 为每日应计提的基金管理费

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 018年6月30 当期发生的基金应支付 1,885,138.14 主: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

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。 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 本基金本报告期内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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基

6.4.8.5 <u>#</u>	关联方保管的	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		່≭期 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		
-12193	期末余額	当期利息收入	期末余额	当期利息收入	
平安银行	169,697,	692.378.36	159.096.642.64	704.568.68	

注:本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管,按银行同业利率计息 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6487 甘州关联交易事项的说明

0.4.10	.1.1 3	CHKHL93	5Ac739 :	IIX.src						
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
6036 93	江苏新能	2018 年6月 25日	201 8年 7月 3日	新股 流通 受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
6037 06	东方环宇	2018 年6月 29日	201 8年 7月 9日	新股 流通 受限	13.0 9	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
6031 05	芯能科技	2018 年6月 29日	201 8年 7月 9日	新股 流通 受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
0020 27	分众传媒	2018 年4 月26 日	201 8年 10 月 26	大宗 交易 流限	10.1	9.04	2,220, 000	18,777, 500.00	20,068, 800.00	-

法》规范的非公开发行股份,所认购的股份自发行结束。己起12个月内不得转让。 法》规范的非公开发行股份,所认购的股份自发行结束。己起12个月内不得转让。 根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳、上海证券交易所上 市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施组则》。本基金持有的上市 公司非公开发行股份,自股份解除限售之日起12个月内,通过集中资价交易减持的 数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%;采取大宗交易方式的,在任 意连续90日内,减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。此外,本基金通过大 意义等公司分,他们我们自己放下的通过公司成功。然而2~%。此个几个基础通过 实交易方式受让的展上市公司大股东藏持或者特定股东藏持的股份,在受让后6· 月内,不得转让所受让的股份。 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末末持有暂时停牌等流通受限股票。 64.93. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 64.93.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2018年6月30日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购 交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末2018年6月30日止。本基金无因从事交易所市场债券正回购 交易形成的卖出同购证券款全额 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(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

% 不完了。 第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第一层次: 綠第一层次輸入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第二层次: 綠第一层次輸入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第二层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

的持续的以公允价值计量的金融工具

()洛层次金融工具公允价值 于2018年6月30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1,227,428,750.22元,属于第二层次的余额为 20,156,830.15元, 无属于第三层次的余额 (2017年12月31日:第一层次1,377,847,889.39元,第二层次128,515,813.20元,无第三层次)。

647、693.5357、第二度公12.5 (10公本行動) 18.5 (20公本行動) 18.5 (20公本行動) 18.5 (20公本行動) 19.5 (20公本行動) 19.5 (20公本行動) 19.5 (20公本行動) 19.5 (20公本行動) 19.5 (20公本行動) 19.5 (20公本行动) 19.5 (20公本行动 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一层次还是第三层次 (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年12月31日:同)。(d)不以公允价值计量的金融工具 不以公分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 而价值与公允价值相差很小。 (2)除公允价值和,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

《7 投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况 全额单位, 人民币元

			並领中世:八民
序号	项目	金額	占基金总资产的比 例(%)
1	权益投资	1,247,585, 580.37	87.45
	其中:股票	1,247,585, 580.37	87.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	177,061,717.77	12.41
8	其他各项资产	1,946,402.75	0.14
9	合计	1,426,593,	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178,460、 381.61元人民币,占期末基金资产净值比例12.61%。

72 期末按行业分类的股票投资组合 7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别		公允价值		占基金资产净值比例 (%)
Α	农、林、牧、渔业	9,213,450	3.54	0.65	
В	采矿业			-	_
C	制造业		762,213,362	2.23	53.86
D	电力、热力、燃气及水生产 应业	和供	71,555	9.85	0.01
Е	建筑业		55,870,946	5.91	3.95
F	批发和零售业			-	-
G	交通运输、仓储和邮政业			-	-
Н	住宿和餐饮业			-	-
Ι	信息传输、软件和信息技术服 务业		14,180,865.60		1.00
J	金融业		-		-
K	房地产业		123,707,784.65		8.74
L	租赁和商务服务业		93,904,010.84		6.64
M	科学研究和技术服务业		9,881,984.00		0.70
N	水利、环境和公共设施管理	即业	81,220	5.14	0.01
О	居民服务、修理和其他服务	子出た	-		-
Р	教育		-		_
Ω	卫生和社会工作		-		-
R	文化、体育和娱乐业		-		-
S	综合			-	-
	合计		1,069,125,198.76		75.55
7.2.	2报告期末按行业分割	烂的	巷股通投资股票投资	且合	
	行业类别		公允价值(人民币)	占	基金资产净值比例(%)
Αž	基础材料		25,293,000.00		1.79
B 消	接者非必需品		31,875,601.05		2.25
en 2nh	and the state of the same and			-	

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry 7.3 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

数量(股

有股票明细...

网络的半年度报告正义。 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号 股票代码 股票名称 本期累计买人金额

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资

				值比例(%)
1	000961	中南建设	48,811,950.23	2.88
2	600048	保利地产	40,514,063.92	2.39
3	600104	上汽集团	23,357,482.36	1.38
4	01918	融创中国	21,889,571.75	1.29
5	600031	三一田工	21,853,352.00	1.29
6	002027	分众传媒	18,777,500.00	1.11
7	300166	东方国信	16,419,631.22	0.97
8	600690	青岛海尔	15,029,197.00	0.89
9	600741	华域汽车	14,384,727.57	0.88
10	600060	海信电器	14,192,041.00	0.84
11	000537	广宇发展	13,872,077.10	0.82
12	300012	华测检测	8,864,164.00	0.52
13	01999	敏华控股	8,778,624.73	0.52
14	001979	招商蛇口	7,226,135.04	0.43
15	02869	绿城服务	5,915,250.86	0.35
16	300196	长海股份	5,673,604.10	0.33
17	002043	兔宝宝	4,661,614.47	0.27
18	300285	国瓷材料	3,804,490.00	0.22
19	002292	奥飞娱乐	3,087,069.00	0.18
20	002475	立讯精密	3,043,875.82	0.18

不考虑相关交易费用。 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细 金额单位:人民币元

股票名称 宇通客车 30,726,840 安踏体育 蓝色光标 注,"木期累计壶出全额"按壶出成交全额(成交单价乘以成交数量)值别不

考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:"买人股票成本(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。 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。 7.6 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

木甚全木报告期末去持有资产支持证券

本基金本报告期末未持有债券投资。 7.7 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

7.8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

7.9 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。 7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 本基金本报告期未进行股指期货投资

7.10.2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, 7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1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,以萃取相应债券组合的超额收益,

本基金本报告期未进行国债期货投资。 7.11.3本期国债期货投资评价 本基金本报告期未进行国债期货投资。

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。

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。 7.12.3 期末其他各项资产构成

7.12 投资组合报告附注

单位:人民而元

金额单位:人民币元 流通受限情况说明

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,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。 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

份额单位,份 持有人户数 (户) **技术(公)**斯 技有份額

8.2 期末上市基金前十名持有人 802,500 2.60 岚集合资金信托计划 677,100 2.19 云闸国际后托有限公司-溪集合资金信托计划

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 8.4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

注,上述共有人为太其全太担告期实场内份额共有人

本基金基金经理持有本开放式基金 § 9 开放式基金份额变动

单位:份 报告期期初基金份额总额 注:本基金合同生效日为2016年1月20日

§ 10 重大事件揭示 10.1 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。 10.2 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 8理人于2018年3月8日发布公告,陈光明同志自2018年3月7日走鑫军同志担任公司董事长职务。于2018年5月11日发布公告,林鹏

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉 10.4 基金投资策略的改变 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计 事务所自2017年度起为本基全超优审计服务至今

10.7.1 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 佣金 成交金额

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) 洗择标准

券商财务状况良好、经营行为规范,最近一年无重大违规行;具有较强的研究 服务能力;交易佣金收费合理。 1827、2次7013至以10日至。 (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,

与其签订协议和用交易单元。 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 用其他券裔交易单元的资格, 此事已向中国证监会报告, 并等待进一步指示与解 のまたが同义の半小山が内に、ルデーローではLLLにないには、ハイザウル ショハー海 炭、本公司自在条削で多角が表得相用券商交易単元的资格、并已按公司相关制度与 流程开展交易単元租用事宜。

4 木报告期内无新增交易单元 10.7.2 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

	1四分5×200		1四分十四四分之 200		TXHEX 90		1	
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比 例	成交金額	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金額	占当期权 证 成交总额 的比例		
东方证券	-	-	284,900, 000.00	100.00%	-	1	l	
广发证券	2,055,930.44	100.00%	-	-	-	-	ı	
上海东方证券资产管理有限公司								

2018年8月27日