东方强化收益债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:二〇一八年八月二十八日

§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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月27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	东方强化收益债券
基金主代码	400016
前端交易代码	400016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年10月9日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	216,967,745.61份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过积极主动的投资管理,追求稳定的当期收益和长期增值,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	基金管理人将采取积极的投资策略,寻找各种可能的价值增长机会,力争实现超越基准的投资收益。
业绩比较基准	本基金采用"中债综合全价指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%"作为投资业绩比较基准。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,理论上其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

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		东方基金管理有限责任公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	田东辉
	联系电话	010-66295888	010-68858113
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		010-66578578或400-628-5888	95580
传真		010-66578700	010-68858120

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	http://www.orient-fund.com或http://www.df5888.com
基金半年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

§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	3,780,001.60
本期利润	3,028,821.21
加权平均基金份额本期利润	0.0212
本期基金份额净值增长率	2.46%
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	0.0318
期末基金资产净值	231,032,353.24
期末基金份额净值	1.0648

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。

②期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

③本基金所述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所列数字。

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	-0.08%	0.07%	-0.47%	0.13%	0.39%	-0.06%
过去三个月	0.51%	0.14%	-0.11%	0.14%	0.62%	0.00%
过去六个月	2.46%	0.11%	0.62%	0.13%	1.84%	-0.02%
过去一年	4.01%	0.09%	0.41%	0.10%	3.60%	-0.01%
过去三年	4.08%	0.13%	-1.70%	0.17%	5.78%	-0.04%
自基金合同生效起至今	35.71%	0.22%	9.37%	0.17%	26.34%	0.05%

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

§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

本基金管理人为东方基金管理有限责任公司(以下简称"本公司")。本公司经中国证监会"证监基金字[2004]80号"批复批准于2004年6月11日成立。截至2018年6月30日,本公司注册资本3亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币19200万元,占公司注册资本的64%;河北省国有资产控股运营有限公司出资人民币8100万元,占公司注册资本27%;渤海国际信托股份有限公司出资人民币2700万元,占公司注册资本的9%。截至2018年6月30日,本公司管理43只开放式证券投资基金——东方龙混合型开放式证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方稳健回报债券型证券投资基金、东方核心动力混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金、东方永润债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金、东方新价值混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方稳定增利债券型证券投资基金、东方金元宝货币市场证券投资基金、东方大健康混合型证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方人工智能主题混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方合家保本混合型证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
彭成军(先生)	本基金基金经理、公司总经理助理、投资决策委员会委员	2018年6月4日	-	11年	公司总经理助理、固定收益投资总监、投资决策委员会委员,清华大学数学硕士,11年投资从业经历。曾任中国光大银行总行资金部衍生品模型分析师、外币债券投资经理、本外币衍生品投资经理;中国民生银行金融市场部投资管理中心总经理助理、交易中心负责人,负责固定收益及衍生品相关交易业务。2017年11月加盟东方基金管理有限责任公司,现任东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理。
黄诺楠(女士)	本基金基金经理	2017年4月12日	-	6年	清华大学应用经济学专业博士,6年证券从业经历。2012年7月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部研究员、固定收益部研究员、投资经理,东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方臻馨债券型证券投资基金基金经理,现任东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》和其他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,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法,各投资组合经理在授权范围内自主决策,各投资组合共享研究平台,在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,基金管理人执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析,投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合,未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,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,债券市场整体上分化行情,利率债和高等级信用债经历了幅度较大的一波牛市行情,但AA等级资质的信用债收益率却先下后上,整体收益率并未出现下行,10年期国开债半年内下行超过60bp,自去年年底国开通过置换债券、停发10年期债券始,市场和政府能切实地感受到政策性银行以及企业的融资压力,跨过新年后,整体的资金面以及公开市场投放力度都比之前的预期更乐观,特别是两会之前及两会期间,央行异常慷慨,投放的流动性超出市场期望,且年后更多地通过公开市场抚慰情绪,整体风格较去年明显改变,4月后,随着中美贸易战的发酵,市场悲观情绪蔓延,股市自春节后继续大幅回调,政府"稳"字当头,对市场的呵护多于呵责,虽然5月末有小幅的流动性压力,但6月的流动性补充则非常到位,特别是用降准置换MLF,再次给市场传达了强烈的维稳信号,同时,资管新规达标再次被推后也给了市场喘息之机,虽然有6月份的美联储加息、有6月下半月的汇率大幅贬值,均未能抵御大家对利率债和高等级信用债的看多做多。与之形成明显对比的是,AA及以下评级的债券遭到市场抛弃,收益率不降反升,对违约风险的担忧使低评级债券流动性溢价和信用风险溢价大幅上升,这更多的反应在短久期上。

上半年转债市场表现平平,受股市影响由涨转跌,转股溢价率大幅回升,债底对转债构成强大支撑。

报告期内,本基金规模有一定幅度增长,主要持仓以信用债为主,适当介入可转债及股票操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018年1月1日起至2018年6月30日,本基金净值增长率为2.46%,业绩比较基准收益率为0.62%,高于业绩比较基准1.84%。

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2018年下半年,国内宏观经济下台阶的趋势较为明确;分项来看,贸易摩擦对出口的负面冲击将在下半年更为明显,房地产调控仍将保持定力,关注财政政策、地方债发行提速对基建的托底。在经济下行、信用收缩、银行资负仍存压力的背景下,预计政策仍有一定放松空间,或体现为"宽货币+结构性稳信用"的组合;受此影响,流动性总量将维持合理充裕,融资环境将得以改善,预计社融信贷数据将有所修复。

对于2018年下半年而言,基本面下行、政策结构性宽松的逻辑仍支撑利率下行,利率债和高评级信用债仍有一定的安全边际,受供给压力、交易结构的影响,下行过程和节奏或有所反复;在结构性稳信用的背景下,考虑到当前绝对收益以及利差水平,被错杀的中低等级信用债仍存在一定配置价值;权益市场处于震荡磨底过程,当前估值较低,具备长期配置价值,转债市场绝对价格处于低位,表现出较强的抗跌性,整体看好。未来,本基金将以高静态收益、中性久期的优质信用债为底仓,以获得稳定的票息收入,实现绝对收益,并择机进行利率债波段操作增厚组合收益;在流动性总量宽松的背景下,预计短端维持低位,套息策略仍有价值;在控制好仓位和回撤的前提下,参与转债及权益市场,优选持有收益高、存在条款博弈可能的债性转债。感谢基金持有人对本基金的信任和支持,我们将本着勤勉尽责的精神,秉承"诚信是基、回报为金"的原则,力争获取与基金持有人风险特征一致的稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及相关会计核算业务细则,本管理人对所管理的基金各项资产进行核算,本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下:

本基金管理人成立了东方基金管理有限责任公司估值委员会(以下简称"估值委员会"),成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、督察长以及运营部、投研部门(包括但不限于权益投资部、固定收益部、量化投资部)、风险管理部负责人组成,估值委员会设立委员会主任1名,委员会副主任1-2名,估值委员会成员均具备良好的专业知识、专业胜任能力和独立性,熟悉基金投资品种及基金估值法律法规。职责分工分别如下:

1.委员会主任

负责定期或不定期组织召开估值委员会工作会议,就估值参与各方提交的估值问题组织讨论,进行决议并组织实施;因特殊原因,委员会主任无法履行职责时,由副主任代理其行使主任职责。

2.运营部

①自行或应各方需求提请估值委员会主任召开估值委员会会议。

②征求托管行意见并借鉴行业界通行做法,提出估值模型和估值方法的修改意见。

③根据估值委员会会议决定的估值方法、估值模型及参数计算具体投资品种的公允价值并据以对基金等投资组合进行估值。

④负责编制投资组合持有的投资品种变更估值方法的相关公告。

3.投研部门

当基金等投资组合持有没有市价或不存在活跃市场的投资品种(简称"停牌有价证券")时,根据估值委员会要求和运营部的估值方案,负责评估现有估值政策和估值方法是否公允、适当,对估值方法有失公允性的"停牌有价证券",建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

4.风险管理部

在日常监控和风险管理过程中发现估值政策和估值方法有失公允性时,建议或提示运营部提请估值委员会主任召开估值会议。

上述参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

截至本报告期期末,公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》,并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值(适用非货币基金)或影子定价(适用货币基金)。公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》,并依据其提供的中证债券估值数据对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值(适用非货币基金)。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定,结合本基金实际运作情况,本基金本报告期末进行利润分配。

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,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或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

基金托管人依据《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》与《东方强化收益债券型证券投资基金托管协议》,自2012年10月9日起托管东方强化收益债券型证券投资基金(以下称本基金)的全部资产。

本报告期内,本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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,本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本基金未进行利润分配。

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

本托管人认真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,认为其真实、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:东方强化收益债券型证券投资基金

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	1,586,494.96	1,729,753.24
结算备付金	645,386.73	190,207.10
存出保证金	11,503.32	4,568.52
交易性金融资产	222,502,035.26	137,526,897.51
其中:股票投资	15,511,041.00	3,083.37
基金投资	-	-
债券投资	206,990,994.26	137,523,814.14
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	18,000,227.00	10,000,215.00
应收证券清算款	6,611,501.49	-
应收利息	3,985,526.43	3,941,803.11
应收股利	-	-
应收申购款	2,384.81	2,682.44
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	253,345,060.00	153,396,126.92
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	18,000,000.00	24,029,643.95
应付证券清算款	2,805,184.91	-
应付赎回款	1,200.21	-
应付管理人报酬	151,841.92	86,563.16
应付托管费	37,960.49	21,640.78
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	753,004.35	742,530.60
应交税费	23,924.53	-
应付利息	-3,012.19	12,117.45
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	542,602.54	724,000.00
负债合计	22,312,706.76	25,616,495.94
所有者权益:		
实收基金	216,967,745.61	122,961,083.29
未分配利润	14,064,607.63	4,818,547.69
所有者权益合计	231,032,353.24	127,779,630.98
负债和所有者权益总计	253,345,060.00	153,396,126.92

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0648元,基金份额总额216,967,745.61份。

6.2 利润表

会计主体:东方强化收益债券型证券投资基金

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	4,205,568.26	2,951,959.83
1.利息收入	4,456,103.51	11,113,684.67
其中:存款利息收入	16,011.92	38,609.36
债券利息收入	4,358,448.11	10,230,880.66
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	81,643.48	844,194.65
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	500,325.29	-7,289,470.54
其中:股票投资收益	46,016.70	-211,183.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	406,728.59	-7,078,333.84
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	47,580.00	46.32
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-751,180.39	-908,838.73
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	319.85	36,584.43
减:二、费用	1,176,747.05	2,397,797.81
1. 管理人报酬	596,477.91	1,552,502.94
2. 托管费	149,119.47	388,125.73
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	25,158.61	10,652.85
5. 利息支出	205,568.71	254,155.39
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	13,020.85	-
7. 其他费用	187,401.50	192,360.90
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	3,028,821.21	554,162.02
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	3,028,821.21	554,162.02

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方强化收益债券型证券投资基金

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)	122,961,083.29	4,818,547.69	127,779,630.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	3,028,821.21	3,028,821.21
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)	94,006,662.32	6,217,238.73	100,223,901.05
其中:1.基金申购款	95,115,630.99	6,282,805.46	101,398,436.45
2.基金赎回款	-1,108,968.67	-65,566.73	-1,174,535.40
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)	216,967,745.61	14,064,607.63	231,032,353.24

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)	478,176,731.17	9,805,350.83	487,982,082.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	554,162.02	554,162.02
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)	-239,416,588.07	-4,691,403.26	-244,107,991.33
其中:1.基金申购款	441,596.25	9,355.62	450,951.87
2.基金赎回款	-239,858,184.32	-4,700,758.88	-244,558,943.20
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)	238,760,143.10	5,668,109.59	244,428,252.69

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:

______刘鸿鹏______ ______刘鸿鹏______ ____肖向辉____

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

东方强化收益债券型证券投资基金(以下简称"本基金")根据2012年7月9日中国证监会《关于核准东方强化收益债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]914号)和《关于东方强化收益债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2012]740号)的核准,由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》自2012年9月3日至2012年9月28日公开募集设立。本基金为债券型开放式基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集632,133,353.07元人民币,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)"信会师报字(2012)第230048号"验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》于2012年10月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为632,434,257.84份基金单位,其中认购资金利息折合300,904.77份基金单位。本基金基金管理人为东方基金管理有限责任公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方强化收益债券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,主要投资于固定收益类金融工具,包括国债、中央银行票据、地方政府债、金融债(含政策性金融债)、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转债(含可分离交易可转债)、次级债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金也可以参与新股申购、增发股票申购、要约收购类股票投资、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)以及权证等中国证监会允许基金投资的其它权益类金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号—半年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求,真实、完整地反映了本基金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保持一致。

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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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[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]140号《财政部、国家税务总局关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

1、于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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,存款利息收入不征收增值税。

根据规定,基金产品运营过程中发生的增值税应税行为,以基金产品管理人为增值税纳税人。

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。

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。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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

本报告期内不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。

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
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	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
东北证券股份有限公司	18,385,201.08	100.00%	1,439,485.00	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
东北证券股份有限公司	159,704,050.14	100.00%	96,491,658.53	100.00%

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 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	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
东北证券股份有限公司	546,700,000.00	100.00%	613,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间,本基金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 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
东北证券股份有限公司	17,005.21	100.00%	745,657.86	100.00%

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 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
东北证券股份有限公司	1,316.31	100.00%	728,652.65	100.00%

注:①上述佣金按照市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	596,477.91	1,552,502.94
其中:支付销售机构的客户维护费	8,818.69	11,325.36

注:①计提标准:在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.8%

其中:H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式:基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

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	149,119.47	388,125.73

注:①计提标准:在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.2%

其中:H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式:基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

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

本报告期及上年度可比期间,本基金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

本报告期及上年度可比期间,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

本报告期末及上年度末,除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

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 期末余额	当期利息收入	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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	1,586,494.96	10,643.19	967,161.08	31,678.49

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间,本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年06月30日止,本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

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,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额18,000,000.00元,于2018年7月6日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本半年度报告报出日,本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	15,511,041.00	6.12
	其中:股票	15,511,041.00	6.12
2	固定收益投资	206,990,994.26	81.70
	其中:债券	206,990,994.26	81.70
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	18,000,227.00	7.11
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,231,881.69	0.88
7	其他各项资产	10,610,916.05	4.19
8	合计	253,345,060.00	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	957,120.00	0.41
C	制造业	8,071,141.00	3.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	968,400.00	0.42
E	建筑业	917,280.00	0.40
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	954,900.00	0.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	957,600.00	0.41
K	房地产业	880,650.00	0.38
L	租赁和商务服务业	966,150.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	837,800.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	15,511,041.00	6.71

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603899	晨光文具	31,100	985,559.00	0.43
2	002372	伟星新材	55,000	972,950.00	0.42
3	600900	长江电力	60,000	968,400.00	0.42
4	601888	中国国旅	15,000	966,150.00	0.42
5	601398	工商银行	180,000	957,600.00	0.41
6	601088	中国神华	48,000	957,120.00	0.41
7	002120	韵达股份	18,000	954,900.00	0.41
8	002003	伟星股份	110,000	931,700.00	0.40
9	002032	苏泊尔	18,000	927,000.00	0.40
10	601668	中国建筑	168,000	917,280.00	0.40

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600340	华夏幸福	1,983,290.00	1.55
2	601398	工商银行	1,018,800.00	0.80
3	002003	伟星股份	1,009,648.50	0.79
4	603899	晨光文具	1,007,950.00	0.79
5	601888	中国国旅	1,006,219.96	0.79
6	601088	中国神华	1,001,280.00	0.78
7	000423	东阿阿胶	995,860.00	0.78
8	601668	中国建筑	991,200.00	0.78
9	600066	宇通客车	990,122.00	0.77
10	002032	苏泊尔	989,640.00	0.77
11	002372	伟星新材	988,900.00	0.77
12	600900	长江电力	978,000.00	0.77
13	002120	韵达股份	936,000.00	0.73
14	603288	海天味业	930,000.00	0.73
15	000895	双汇发展	918,400.00	0.72
16	603096	新经典	834,518.00	0.65
17	600519	贵州茅台	752,740.00	0.59
18	-	-	-	-
19	-	-	-	-
20	-	-	-	-

注:①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②"买入金额"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。

7.4.2 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

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600340	华夏幸福	1,049,400.00	0.82
2	600754	锦江股份	2,366.70	0.00
3	601555	东吴证券	865.92	0.00
4	-	-	-	-
5	-	-	-	-
6	-	-	-	-
7	-	-	-	-
8	-	-	-	-
9	-	-	-	-
10	-	-	-	-
11	-	-	-	-
12	-	-	-	-
13	-	-	-	-
14	-	-	-	-
15	-	-	-	-
16	-	-	-	-
17	-	-	-	-
18	-	-	-	-
19	-	-	-	-
20	-	-	-	-

注:①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②"卖出金额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	17,332,568.46
卖出股票收入(成交)总额	1,052,632.62

注:①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	37,094,195.00	16.06
	其中:政策性金融债	16,120,195.00	6.98
4	企业债券	115,025,577.41	49.79
5	企业短期融资券	30,177,000.00	13.06
6	中期票据	9,733,000.00	4.21
7	可转债(可交换债)	14,961,221.85	6.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	206,990,994.26	89.59

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180205	18国开05	200,000	20,974,000.00	9.08
2	136547	16国发02	180,000	18,000,000.00	7.79
3	018005	国开1701	155,000	15,558,900.00	6.73
4	122399	15中投G1	140,000	13,988,800.00	6.05
5	136503	16兴杭债	140,000	13,694,800.00	5.93

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资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金所持有16洛娃01(136506.SH)于2017年12月11日对外公告了被采取行政监管措施的事宜。洛娃科技实业集团公司董事会于2017年12月11日发布公告,公告称,公司近日收到了北京证监局出具的《中国证券监督管理委员会北京监管局行政监管措施决定书》([2017]148号),针对公司存在的公司债券募集资金违规使用、信息披露违规、财务管理不规范等问题,北京证监局对公司采取责令整改的行政监管措施。

本基金决策依据及投资程序:

(1)研究:本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台,由研究部负责,采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势进行分析,深入研究国家宏观经济走势、政策走向和利率变化趋势;通过对信用利差的分析判断,可转债的投资价值分析等,深入研究各类债券合理的投资价值。在全面深入研究的基础上,提出大类资产配置建议、目标久期建议、类属资产配置建议等。

(2)资产配置决策:投资决策委员会依据上述研究报告,对基金的资产配置比例、目标久期设定等提出指导性意见。基金经理基于投研部门的投资建议,根据自己对未来一段时期内宏观经济走势的基本判断,对基金资产的投资,制定月度资产配置和久期设置计划,并报投资决策委员会审批,审批通过,方可按计划执行。

(3)组合构建:大类资产配置比例范围及目标久期设定范围确定后,基金经理参考研究员的投资建议,结合自身的研究判断,决定具体的投资品种并决定买卖时机,其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。

(4)交易执行:交易管理部负责具体的交易执行,依据基金经理的指令,制定交易策略,统一执行证券投资组合计划,进行具体品种的交易。

(5)风险监控:本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控,定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况,责令投资不规范的基金经理进行检讨,并及时调整。

(6)风险绩效评估:风险管理部定期和不定期对基金的投资进行风险绩效评估,并提供相关报告,使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略,并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整和优化投资组合。

(7)组合调整:基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化,以及组合风险与绩效的评估结果,结合基金申购和赎回的现金流量情况,对投资组合进行动态调整,使之不断得到优化。

本基金投资16洛娃01主要基于以下原因:

洛娃科技实业集团有限公司(以下简称"公司"或"洛娃集团")前身系北京洛娃新型化工

材料技术开发有限责任公司,是经北京市工商局批准于1995年9月设立的有限责任公司。历经多次增资,截至2017年3月底,公司注册资本为21,000万元,第一大股东为自然人胡克勤,持股比例为80.24%,系公司实际控制人。公司是集乳业、日化和进出口贸易三大产业于一体的多元化企业,于2002年开始连续十余年被认证为高新技术企业,各产业已先后有多项产品填补国内空白,共有9项成果被列入全国和北京市火炬计划,5个项目被列入北京市重大科技成果推广计划。截至2016年底,公司合并资产总额167.88亿元,所有者权益合计88.91亿元,归属于母公司的所有者权益88.71亿元。2016年,公司实现营业收入75.52亿元,净利润(含少数股东损益)5.60亿元,全部为归属于母公司所有者的净利润。经营活动产生的现金流量净额10.05亿元,现金及现金等价物净增加额4.75亿元。

16洛娃01的债项评级为AA,主体评级为AA,表明发行人偿还债务的能力较强,受不利经济环境的影响不大,违约风险较低。

除上述情况外,本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

7.12.2

本报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资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

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,503.32
2	应收证券清算款	6,611,501.49
3	应收股利	-
4	应收利息	3,985,526.43
5	应收申购款	2,384.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,610,916.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113010	江南转债	15,226.50	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
981	221,169.98	211,519,780.79	97.49%	5,447,964.82	2.51%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年10月9日)基金份额总额	632,434,257.84
本报告期期初基金份额总额	122,961,083.29
本报告期基金总申购份额	95,115,630.99
减:本报告期基金总赎回份额	1,108,968.67
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	216,967,745.61

注:基金总申购份额包含基金转换入份额,基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未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

本报告期内,基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

截至报告期末,公司不存在诉讼情况。

本报告期内无涉及本基金基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
东北证券股份有限公司	2	18,385,201.08	100.00%	17,005.21	100.00%	-

注:(1)此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易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:

券商选择标准:①资力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;②财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;③经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚;④内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务;⑥研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时为基金提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告;⑦收取的佣金率。

券商选择程序:①对符合选择标准的券商的服务进行评价;②拟定租用对象:由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商;③签约:拟定备选的券商后,按公司签约程序与备选券商签约。签约时,要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

(3)本报告期内本基金租用的券商交易单元未发生变更。

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

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券股份有限公司	159,704,050.14	100.00%	546,700,000.00	100.00%	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	97,722,075.63	0.00	0.00	97,722,075.63	45.04%
	2	20180524-20180630	0.00	46,898,977.58	-	46,898,977.58	21.62%
	3	20180524-20180630	0.00	46,898,977.58	-	46,898,977.58	21.62%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。

(1)当持有基金份额比例达到或超过20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时,可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本,可能造成基金净值的波动。

(2)当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时,基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理,可能会影响投资者赎回。

东方基金管理有限责任公司

2018年8月28日