东方主题精选混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人：东方基金管理有限责任公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	东方主题精选混合
基金主代码	400032
前端交易代码	400032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月23日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	190,123,828.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过深入扎实的研究，精选投资主题，把握中国经济成长和改革带来的投资机会，力争实现基金的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资的股票资产占基金资产的比例为40%–95%，在符合相关法律法规规定和基金合同约定的投资比例限制基础上，本基金采用主题投资策略，通过对我国经济发展过程中出现的主题类投资机会进行挖掘，投资于符合当期经济发展目标且具有可持续发展前景的优秀上市公司，在力争实现基金长期稳定增值的基础上，提高基金投资收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	洪渊
	联系电话	010-66295888	（010）66105799
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95588
传真		010-66578700	（010）66105798

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	-22,390,265.58
本期利润	-28,377,061.08
加权平均基金份额本期利润	-0.1461
本期基金份额净值增长率	-19.58%
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	-0.3917
期末基金资产净值	115,644,366.29
期末基金份额净值	0.6083

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）。

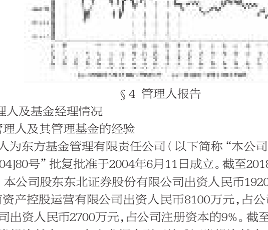
③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-9.33%	1.39%	-4.30%	0.76%	-5.03%	0.63%
过去三个月	-13.26%	1.07%	-5.33%	0.68%	-7.93%	0.39%
过去六个月	-19.58%	1.15%	-6.67%	0.69%	-12.91%	0.46%
过去一年	-19.45%	1.09%	-1.86%	0.56%	-17.59%	0.53%
过去三年	-47.17%	1.96%	-11.62%	0.89%	-35.55%	1.07%
自基金合同生效起至今	-39.17%	1.97%	-3.35%	0.96%	-35.82%	1.01%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王晓伟（先生）	本基金基金经理	2016年11月2日	–	15年	中央财经大学工商管理硕士，15年证券从业经历。曾任东北证券北京三里河东路营业部系统管理员，东方基金管理有限责任公司系统管理员、交易员，中国国际金融有限公司销售交易部交易员。2013年4月加入东方基金管理有限责任公司，曾任交易部总经理、专户投资部总经理、投资经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理。现任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理。
周思越	本基金基金经理助理	2018年6月26日	–	9年	新加坡国立大学经济专业硕士，9年证券从业经历。曾任长盛基金管理有限公司专户理财部理财经理、东方基金管理有限责任公司研究部研究员、中信证券股份有限公司资产管理部副总裁。2017年加盟东方基金管理有限责任公司，现任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理助理。

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

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、《东方主题精选混合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作基金资产，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

上半年，我国经济经历了非常不平凡的半年，内有结构性去杠杆持续深化，外有中美贸易战一波三折，逐渐发酵。得益于我国经济总量大，韧性足，以及世界经济的持续复苏，我国经济的开局还算不错。但进入二季度，影响经济增长的内因，外因逐渐发酵，伴随着一些风险事件开始暴露，如个别信用债出现违约、个别股权质押触及平仓线、人民币快速贬值等，市场对经济减速的担忧开始抬头。从已公布数据看，上半年的经济运行呈现明显的供给强劲、需求疲软的特征。供给方面，上半年工业产能利用率有所提升，增长进一步加快，1—5月工业增加值同比增速达到6.9%，比去年同期上升0.2个百分点；服务业继续保持平稳较快增长，1—5月服务业生产指数同比增长8.1%，与去年同期基本持平。需求方面，消费、投资与出口均出现疲软迹象，尤其是消费与投资需求较为低迷。就消费而言，1—5月社会消费品零售总额增速为9.5%，低于去年同期0.8个百分点，剔除价格因素之后的实际增速仅为7.8%，比去年同期下降了1.8个百分点。就投资而言，1—5月固定资产投资增速仅为6.1%，剔除房地产开发投资后固定资产投资增速更只有5.1%，比去年同期大幅下滑3.4个百分点。需求持续疲软对经济增速的影响必然将会逐步显现，这也是当前经济平稳运行态势下的主要隐忧。

市场方面，上半年市场熊市特征明显，各主要指数均大幅下跌。上半年，上证综指、沪深300指数、创业板指数分别录得-13.90%、-12.90%、-8.33%的跌幅。看二季度，上证综指、沪深300指数、创业板指数分别录得-10.14%、-9.94%、-15.46%的跌幅。板块方面，半年看食品饮料、休闲服务、生物医药三个行业录得了正收益，涨幅分别为+0.14%，+8.98%，+3.11%。单看二季度，只有食品饮料和休闲服务录得正收益，分别为+7.78%和+2.45%。从相对收益看，食品饮料、休闲服务、生物医药、家用电器仍是表现最出色的四个行业。

操作方面，二季度是系统性风险集中释放的一个季度，用内外交困来形容并不为过，本基金在二季度整体上采取了防御策略，降仓位，调配置。配置上，减持了贝塔属性较高的计算机、电子、通信和周期品行业，大幅提高了消费品行业的配置，必选消费品行业主要是超配了医药，增配了食品饮料，可选消费品行业继续增配了家用电器。

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-19.58%，业绩比较基准收益率为-6.67%，低于业绩比较基准12.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济方面，上半年经济运行较为平稳，但隐忧已现，主要是总需求疲软，这对未来经济增长的持续性带来了挑战，下半年随着去杠杆的深入以及中美贸易战的升级，料宏观经济相比上半年会有所回落。政策方面，如果内外因结合导致经济下行压力过大，料会有对冲政策出台，财政政策方面，如加大减税和加大基建投资；货币政策方面，相比"稳健中性"的货币政策或有微调，如加大定向降准力度，确保社会融资规模平稳增长并谨防融资成本继续上升，为"去杠杆"创造良好的宏观环境。

市场方面，预计三季度总体仍然是弱市震荡格局。下半年在去杠杆不断推进，中美贸易战长期化，国内信用风险逐渐暴露的影响下，市场流动性环境难以宽松，愈发悲观的风险偏好也难以出现大的改观，对比以往，市场将以更加复杂的方式磨底，筑底。另外，上半年经济基本面尚可，企业盈利也总体平稳，下半年虽然经济面临一定的下行压力，但预计政策会有相应的对冲动作，整体表现为外紧内松，外松内紧的"跷跷板"格局。从估值角度看，各主要指数（整体法）都已创出了2015年股灾后的新低，或在新低附近。从估值角度，从政策预期改变的角度去看，市场似乎已跌无可跌，但我们现在面临的是一个史无前例的复杂环境，因此，市场的底部特征预计比以往也更加复杂。估值底部、政策缓冲为市场提供阶段反弹支撑；贸易战激化、内部风险事件爆发打压市场继续探底。操作上，下半年本基金仍以积极防御为主，适当降低权益投资仓位，配置方面仍以处于合理估值区间的食品饮料、生物医药、家用电器等消费品行业为主，适当增加低估值蓝筹的配置。

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，本基金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，本基金本报告期未进行利润分配。

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

本报告期内，本基金托管人在对东方主题精选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，东方主题精选混合型证券投资基金的管理人——东方基金管理有限责任公司在东方主题精选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，东方主题精选混合型证券投资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

本托管人依法对东方基金管理有限责任公司编制和披露的东方主题精选混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：东方主题精选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	1,891,435.12	1,496,338.43
结算备付金	2,107,337.43	1,367,709.17
存出保证金	206,158.93	255,287.35
交易性金融资产	91,864,428.31	137,479,520.14
其中：股票投资	81,864,428.31	127,527,520.14
基金投资	–	–
债券投资	10,000,000.00	9,952,000.00
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	–	15,000,000.00
应收证券清算款	20,013,315.07	48,550.74
应收利息	340,235.72	188,132.94
应收股利	–	–
应收申购款	40,462.86	4,860.72
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	116,463,373.44	155,840,399.49
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	–	150.00
应付赎回款	43,015.48	61,086.36
应付管理人报酬	152,403.82	198,576.83
应付托管费	25,400.64	33,096.17
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	371,277.58	980,265.86
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	226,909.63	500,054.07
负债合计	819,007.15	1,773,229.29
所有者权益：		
实收基金	190,123,828.95	203,671,682.58
未分配利润	-74,479,462.66	-49,604,512.38
所有者权益合计	115,644,366.29	154,067,170.20
负债和所有者权益总计	116,463,373.44	155,840,399.49

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.6083元，基金份额总额190,123,828.95份。

6.2 利润表

会计主体：东方主题精选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	-24,631,831.89	289,274.90
1.利息收入	350,499.47	485,825.05
其中：存款利息收入	49,476.70	61,125.80
债券利息收入	175,049.32	243,978.09
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	125,973.45	180,721.16
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以"-"填列）	-19,032,396.25	-4,843,817.38
其中：股票投资收益	-19,309,589.42	-5,316,394.80
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
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	277,193.17	472,577.42
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-5,986,795.50	4,634,764.37
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）	36,860.39	12,502.86
减：二、费用	3,745,229.19	3,740,890.17
1. 管理人报酬	1,010,878.39	1,348,515.49
2. 托管费	168,479.75	224,752.53
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	2,478,452.23	1,983,313.71
5. 利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6. 税金及附加		
7. 其他费用	87,418.82	184,308.44
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-28,377,061.08	-3,451,615.27
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-28,377,061.08	-3,451,615.27

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方主题精选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）	203,671,682.58	-49,604,512.38	154,067,170.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	–	-28,377,061.08	-28,377,061.08
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）	-13,547,853.63	3,502,110.80	-10,045,742.83
其中：1.基金申购款	11,397,565.26	-3,669,191.02	7,728,374.24
2.基金赎回款	-24,945,418.89	7,171,301.82	-17,774,117.07
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）	190,123,828.95	-74,479,462.66	115,644,366.29
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）	249,989,723.57	-57,610,869.11	192,378,854.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	–	-3,451,615.27	-3,451,615.27
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）	-16,894,746.12	3,996,795.04	-12,897,951.08
其中：1.基金申购款	3,404,178.87	-876,513.58	2,527,665.29
2.基金赎回款	-20,298,924.99	4,873,308.62	-15,425,616.37
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）	233,094,977.45	-57,065,689.34	176,029,288.11

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

东方主题精选混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）根据2014年12月15日中国证监会《关于准予东方主题精选混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2014]1365号）和《关于东方主题精选混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（机构部函【2015】274号）的核准，自2015年2月16日至2015年3月18日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,099,469,582.75元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）"瑞华验字[2015]第01300006号"验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同》于2015年3月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,099,609,139.25份基金单位，其中认购资金利息折合139,556.50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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方主题精选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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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相关规定)。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。

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
中国工商银行股份有限公司	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

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股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

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	1,010,878.39	1,348,515.49
其中：支付销售机构的客户维护费	578,755.24	774,928.20

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷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

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前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、公休假等，支付日期顺延。

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	168,479.75	224,752.53

注：①计提标准：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

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。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

本基金本报告期及上年度可比期间均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		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
中国工商银行股份有限公司	1,891,435.12	33,694.55	8,951,264.74	42,479.07

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6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，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止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	81,864,428.31	70.29
	其中：股票	81,864,428.31	70.29
2	固定收益投资	10,000,000.00	8.59
	其中：债券	10,000,000.00	8.59
	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	–	–
	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	3,998,772.55	3.43
7	其他各项资产	20,600,172.58	17.69
8	合计	116,463,373.44	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	–	–
C	制造业	73,055,849.85	63.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,389,826.46	2.07
J	金融业	4,759,200.00	4.12
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,659,552.00	1.44
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	81,864,428.31	70.79

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	002179	中航光电	260,000	10,140,000.00	8.77
2	000651	格力电器	150,000	7,072,500.00	6.12
3	600498	烽火通信	250,000	6,212,500.00	5.37
4	002677	浙江美大	350,000	6,090,000.00	5.27
5	000858	五粮液	79,949	6,076,124.00	5.25
6	600887	伊利股份	200,000	5,580,000.00	4.83
7	002572	索菲亚	150,000	4,827,000.00	4.17
8	600036	招商银行	180,000	4,759,200.00	4.12
9	002281	光迅科技	200,000	4,240,000.00	3.67
10	600196	复星医药	100,000	4,139,000.00	3.58

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	000063	中兴通讯	30,030,367.43	19.49
2	002179	中航光电	29,759,503.78	19.32
3	002024	苏宁易购	20,411,138.52	13.25
4	600048	保利地产	20,225,136.40	13.13
5	601988	中国银行	20,206,662.71	13.12
6	000651	格力电器	19,999,937.44	12.98
7	002281	光迅科技	18,850,792.00	12.24
8	002405	四维图新	17,942,577.90	11.65
9	600028	中国石化	16,369,418.00	10.62
10	601939	建设银行	16,001,806.00	10.39
11	601288	农业银行	15,423,768.00	10.01
12	600340	华夏幸福	15,309,088.08	9.94
13	300616	尚品宅配	14,038,774.00	9.11
14	600029	南方航空	13,980,282.36	9.07
15	300136	信维通信	13,397,523.38	8.70
16	600498	烽火通信	13,245,783.91	8.60
17	601857	中国石油	13,205,122.00	8.57
18	000960	锡业股份	12,454,997.80	8.08
19	002439	启明星辰	10,573,667.42	6.86
20	601668	中国建筑	10,373,833.00	6.73
21	600887	伊利股份	10,197,297.79	6.62
22	601328	交通银行	10,049,356.56	6.52
23	002572	索菲亚	9,589,288.91	6.22
24	603833	欧派家居	9,427,911.00	6.12
25	600066	宇通客车	8,833,699.03	5.73
26	002092	中泰化学	8,738,962.20	5.67
27	600690	青岛海尔	8,518,787.00	5.53
28	002371	北方华创	8,361,421.00	5.43
29	601601	中国太保	8,343,192.00	5.42
30	601211	国泰君安	7,809,024.00	5.07
31	600315	上海家化	7,727,307.50	5.02
32	600196	复星医药	7,452,771.00	4.84
33	600038	中直股份	7,435,144.00	4.83
34	600036	招商银行	7,367,181.76	4.78
35	600597	光明乳业	7,307,318.71	4.74
36	300232	洲明科技	7,231,951.00	4.69
37	600282	南钢股份	7,189,717.00	4.67
38	601899	紫金矿业	7,162,999.00	4.65
39	601818	光大银行	7,085,000.00	4.60
40	000776	广发证券	6,993,300.00	4.54
41	002399	海普瑞	6,944,771.60	4.51
42	002153	石基信息	6,915,516.46	4.49
43	600104	上汽集团	6,781,912.00	4.40
44	002773	康弘药业	6,771,842.00	4.40
45	002449	国星光电	6,652,633.81	4.32
46	600183	生益科技	6,598,613.32	4.28
47	002677	浙江美大	6,243,782.82	4.05
48	000333	美的集团	6,103,837.82	3.96
49	000807	云铝股份	6,099,263.31	3.96
50	600030	中信证券	6,083,498.00	3.95
51	002583	海能达	5,847,600.00	3.80
52	300059	东方财富	5,844,979.68	3.79
53	000858	五粮液	5,725,100.90	3.72
54	300498	温氏股份	5,382,052.08	3.49
55	000933	神火股份	5,378,248.00	3.49
56	600703	三安光电	5,248,206.00	3.41
57	601336	新华保险	5,230,622.96	3.40
58	600570	恒生电子	4,978,696.00	3.23
59	000915	山大华特	4,937,795.24	3.20
60	601166	兴业银行	4,755,000.00	3.09
61	001979	招商蛇口	4,719,325.00	3.06
62	600009	上海机场	4,618,904.07	3.00
63	000426	兴业矿业	4,438,134.66	2.88
64	600019	宝钢股份	4,340,000.00	2.82
65	601788	光大证券	4,225,183.48	2.74
66	601600	中国铝业	4,072,000.00	2.64
67	600879	航天电子	4,035,973.00	2.62
68	601699	潞安环能	4,024,007.00	2.61
69	600566	济川药业	3,948,911.10	2.56
70	600111	北方稀土	3,926,385.00	2.55
71	600000	浦发银行	3,921,457.22	2.55
72	601318	中国平安	3,893,249.88	2.53
73	002415	海康威视	3,780,766.98	2.45
74	002475	立讯精密	3,764,087.00	2.44
75	002049	紫光国微	3,756,411.00	2.44
76	600760	中航沈飞	3,744,910.00	2.43
77	002340	格林美	3,650,000.00	2.37
78	300308	中际旭创	3,575,831.00	2.32
79	002737	葵花药业	3,456,192.20	2.24
80	002343	慈文传媒	3,419,062.00	2.22
81	600050	中国联通	3,411,698.00	2.21
82	300424	航新科技	3,408,576.48	2.21
83	002294	信立泰	3,387,713.69	2.20
84	600519	贵州茅台	3,379,497.00	2.19
85	000910	大亚圣象	3,370,428.22	2.19
86	601111	中国国航	3,334,000.00	2.16
87	300188	美亚柏科	3,327,167.00	2.16
88	000002	万科A	3,291,297.96	2.14
89	600585	海螺水泥	3,247,751.93	2.11
90	601766	中国中车	3,218,212.10	2.09
91	002007	华兰生物	3,211,788.73	2.08
92	300027	华谊兄弟	3,210,416.01	2.08
93	002456	欧菲科技	3,139,378.00	2.04

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	000063	中兴通讯	33,191,662.54	21.54
2	002179	中航光电	30,877,183.38	20.04
3	002024	苏宁易购	20,413,991.61	13.25
4	601988	中国银行	20,271,800.00	13.16
5	300616	尚品宅配	19,369,915.20	12.57
6	601288	农业银行	18,794,000.00	12.20
7	600048	保利地产	18,370,748.00	11.92
8	002405	四维图新	18,251,943.06	11.85
9	002281	光迅科技	17,761,174.22	11.53
10	601939	建设银行	16,608,055.00	10.78
11	600028	中国石化	16,406,947.00	10.65
12	600038	中直股份	16,303,613.67	10.58
13	300232	洲明科技	15,648,088.94	10.16
14	603833	欧派家居	15,263,818.70	9.91
15	600340	华夏幸福	14,307,473.35	9.29
16	600029	南方航空	14,060,247.70	9.13
17	601857	中国石油	13,537,386.00	8.79
18	300136	信维通信	13,308,390.10	8.64
19	601766	中国中车	13,021,357.28	8.45
20	600887	伊利股份	12,996,574.56	8.44
21	002583	海能达	12,576,408.05	8.16
22	000960	锡业股份	12,180,704.22	7.91
23	000651	格力电器	11,950,374.60	7.76
24	600498	烽火通信	11,650,717.94	7.56
25	600597	光明乳业	11,538,104.03	7.49
26	601668	中国建筑	10,406,523.00	6.75
27	601328	交通银行	10,185,000.00	6.61
28	002439	启明星辰	9,974,982.36	6.47
29	600066	宇通客车	8,470,846.24	5.50
30	600690	青岛海尔	8,386,422.55	5.44
31	002092	中泰化学	8,354,249.00	5.42
32	002399	海普瑞	8,272,034.86	5.37
33	601601	中国太保	8,269,857.90	5.37
34	002371	北方华创	7,956,210.20	5.16
35	002572	索菲亚	7,945,445.61	5.16
36	600566	济川药业	7,932,574.02	5.15
37	300424	航新科技	7,511,231.85	4.88
38	600282	南钢股份	7,256,177.66	4.71
39	601211	国泰君安	7,235,180.16	4.70
40	600111	北方稀土	7,126,056.50	4.63
41	601818	光大银行	6,700,000.00	4.35
42	600104	上汽集团	6,635,991.25	4.31
43	002449	国星光电	6,534,780.75	4.24
44	000776	广发证券	6,513,723.00	4.23
45	601899	紫金矿业	6,445,000.00	4.18
46	002153	石基信息	6,328,033.00	4.11
47	600183	生益科技	6,096,673.00	3.96
48	600030	中信证券	6,072,306.67	3.94
49	300059	东方财富	5,994,933.56	3.89
50	300133	华策影视	5,376,752.60	3.49
51	300498	温氏股份	5,189,239.50	3.37
52	600570	恒生电子	5,129,936.72	3.33
53	000333	美的集团	5,108,252.00	3.32
54	000807	云铝股份	5,080,119.43	3.30
55	600703	三安光电	4,952,549.00	3.21
56	001979	招商蛇口	4,847,650.00	3.15
57	000915	山大华特	4,845,495.00	3.15
58	601336	新华保险	4,731,736.00	3.07
59	000426	兴业矿业	4,636,964.00	3.01
60	000933	神火股份	4,605,916.91	2.99
61	600019	宝钢股份	4,568,320.00	2.97
62	600009	上海机场	4,520,866.00	2.93
63	601166	兴业银行	4,479,130.00	2.91
64	600879	航天电子	4,253,754.30	2.76
65	601788	光大证券	4,093,076.00	2.66
66	601699	潞安环能	4,030,153.82	2.62
67	600000	浦发银行	3,929,565.00	2.55
68	601318	中国平安	3,887,500.00	2.52
69	002475	立讯精密	3,882,000.00	2.52
70	002049	紫光国微	3,775,782.00	2.45
71	002415	海康威视	3,758,300.09	2.44
72	300308	中际旭创	3,750,304.00	2.43
73	600760	中航沈飞	3,723,222.38	2.42
74	601600	中国铝业	3,621,558.00	2.35
75	002340	格林美	3,580,000.00	2.32
76	300188	美亚柏科	3,567,806.00	2.32
77	600967	内蒙一机	3,517,531.86	2.28
78	600050	中国联通	3,456,659.00	2.24
79	002343	慈文传媒	3,303,700.00	2.14
80	600585	海螺水泥	3,233,494.00	2.10
81	000910	大亚圣象	3,202,225.00	2.08
82	600699	均胜电子	3,150,474.00	2.04
83	600315	上海家化	3,127,885.50	2.03

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	802,138,838.17
卖出股票收入（成交）总额	822,457,545.08

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	10,000,000.00	8.65
	其中：政策性金融债	10,000,000.00	8.65
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	10,000,000.00	8.65

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	170207	17国开07	100,000	10,000,000.00	8.65
2	–	–	–	–	–
3	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–

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。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金所持有的格力电器（000651）于2017年7月26日公告：公司近日收到中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称"广东证监局"）对公司董事徐自发先生下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发采取出具警示函措施的决定》（〔2017〕39 号，以下简称"《决定书》"），《决定书》的主要内容为："徐自发，经查，你于2015年6月起至今任格力电器董事。2016年11月24日，你通过交易所集中竞价交易的方式买入格力电器股票575,300股，成交均价为26.39元/股，成交金额1518.22万元。2017年5月22日，你再次通过交易所集中竞价交易的方式，卖出格力电器股票400,825股，成交均价为33.45元/股，成交金额1340.76万元。你作为格力电器的董事，将持有的格力电器股票在买入后不足6个月卖出，违反了《证券法》第四十七条的规定，现对你采取出具警示函的监管措施。你应认真吸取教训，加强证券法律法规学习，严格规范买卖上市公司股票行为，采取切实有效措施杜绝此类违规行为再次发生。"公司同时给出相关说明："徐自发先生于2017年5月22日通过深圳证券交易所集中竞价交易系统减持了本公司部分股份。减持过程中，因其委托某券商营业部客户经理对短线交易相关法律法规理解偏差，出现本次短线交易。公司已于2017年5月27日对相关情况进行了公告（公告编号：2017–020），徐自发先生因本次短线交易产生的收益2,829,824.5元已经收归公司所有。"

格力电器于2017年10月19日公告：公司董事徐自发先生于 2017 年 10 月 18 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《调查通知书》（编号：粤证调查通字170202 号），该通知书内容为"因涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，我会决定对你立案调查，请予以配合。"

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序：

（1）研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

（2）投资决策委员会定期召开会议，讨论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范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

（3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

（4）交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

（5）投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资格力电器主要基于以下原因：长期来看，空调行业还有较大的成长空间，竞争格局优良，格力电器作为行业龙头具备强大的品牌优势，空间尚大。短期来看，地产2017年正增长滞后一年对空调仍然是正贡献，目前渠道库存较低，内销量不必过忧，格力同时作为竞争优势明显的龙头企业销量增速有望高于行业；同时格力18年出厂均价提升较确定，毛利率有望提升，业绩稳定增长无忧。对标国际国内同行，公司处于估值折价；历史上分红率高，今年有望继续维持高分红，极具价值属性。

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

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	206,158.93
2	应收证券清算款	20,013,315.07
3	应收股利	–
4	应收利息	340,235.72
5	应收申购款	40,462.86
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	20,600,172.58

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可转换债券。

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		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,947	31,969.70	–	–	190,123,828.95	100.00%

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	343,171.08	0.1805%

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	10~50
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（2015年3月23日）基金份额总额	1,099,609,139.25
本报告期期初基金份额总额	203,671,682.58
本报告期基金总申购份额	11,397,565.26
减：本报告期基金总赎回份额	24,945,418.89
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	190,123,828.95

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
南京证券股份有限公司	2	1,437,337,592.37	88.53%	1,338,592.80	88.53%	–
中信证券股份有限公司	2	157,021,125.71	9.67%	146,235.05	9.67%	–
广发证券股份有限公司	1	17,652,979.30	1.09%	16,440.27	1.09%	–
东兴证券股份有限公司	1	11,494,468.44	0.71%	10,704.88	0.71%	–
东方证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国金证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东北证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
安信证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国国际金融股份有限公司	1	–	–	–	–	–

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
南京证券股份有限公司	–	–	133,000,000.00	18.40%	–	–
中信证券股份有限公司	–	–	536,000,000.00	74.14%	–	–
广发证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东兴证券股份有限公司	–	–	54,000,000.00	7.47%	–	–
东方证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国金证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东北证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
安信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国国际金融股份有限公司	–	–	–	–	–	–

§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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

东方基金管理有限责任公司
2018年8月28日