东方红配置精选混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月27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2019年3月22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。

本报告期自2018年5月21日(基金合同生效日)起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红配置精选混合	
基金主代码	005974	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年5月21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	5,820,987,015.29份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东方红配置精选混合A	东方红配置精选混合C
下属分级基金的交易代码:	005974	005975
下属分级基金的前端交易代码	005974	005975
报告期末下属分级基金的份额总额	5,599,763,849.47份	221,223,165.82份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略, 在做好风险管理的基础上,运用多样化的投资策略力争实现基金资产的稳定增值。
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×20%+中债综合指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,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	李云亮	张燕
	联系电话	021-63325888	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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年5月21日(基金合同生效日)-2018年12月31日	
	东方红配置精选混合A	东方红配置精选混合C
本期已实现收益	78,609,499.92	2,497,187.06
本期利润	-150,816,648.20	-6,966,227.15
加权平均基金份额本期利润	-0.0252	-0.0281
本期基金份额净值增长率	-2.55%	-2.86%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0255	-0.0286
期末基金资产净值	5,456,875,305.45	214,887,527.11
期末基金份额净值	0.9745	0.9714

注:1.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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.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。

3.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)。

4.表中的“期末”指报告期最后一日,即12月31日;“本期”指2018年5月21日(基金合同生效日)-2018年12月31日。

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

东方红配置精选混合A

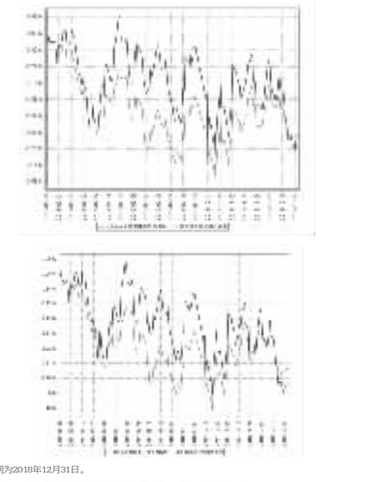
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.22%	0.40%	-0.94%	0.32%	-1.28%	0.08%
过去六个月	-1.13%	0.37%	-0.81%	0.29%	-0.32%	0.08%
自基金合同生效起至今	-2.55%	0.36%	-2.43%	0.28%	-0.12%	0.08%

东方红配置精选混合C

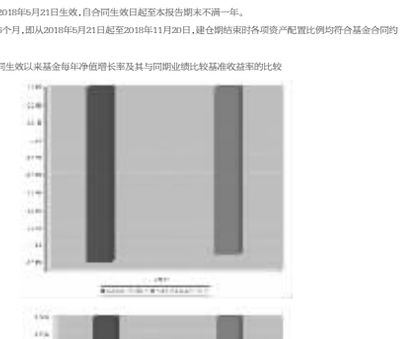
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.35%	0.40%	-0.94%	0.32%	-1.41%	0.08%
过去六个月	-1.38%	0.37%	-0.81%	0.29%	-0.57%	0.08%
自基金合同生效起至今	-2.86%	0.36%	-2.43%	0.28%	-0.43%	0.08%

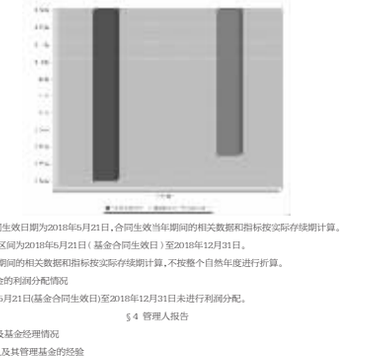
注:1.自基金合同生效日起至今指2018年5月21日-2018年12月31日。

2.根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金的业绩比较基准=沪深300指数收益率*20%+中债综合指数收益率*80%



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



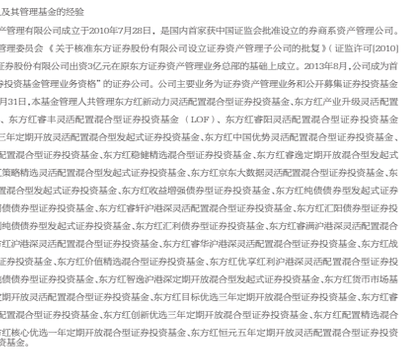


注:1.截止日期为2018年12月31日。

2.本基金合同于2018年5月21日生效,自合同生效日起至本报告期末不满一年。

3.本基金建仓期6个月,即从2018年5月21日起至2018年11月20日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同的定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:1.本基金合同生效日期为2018年5月21日,合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.本图所示时间区间为2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

3.合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日未进行利润分配。

§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》(证监许可[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12月31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、东方红京东大数据灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、东方红睿星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、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金三十五只证券投资基金。

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		
孔令超	东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红汇睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿选定期开放混合型发起式证券投资基金、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、东方红稳健精选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、东方红货币市场基金、东方红睿逸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、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金经理。	2018年5月21日	-	7年	硕士,曾任平安证券有限责任公司总部综合研究所策略研究员、国信证券股份有限公司经济研究所策略研究员,现任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿选定期开放混合型发起式证券投资基金、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、东方红稳健精选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、东方红货币市场基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
徐觅	东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红睿选定期开放混合型发起式证券投资基金、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、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金经理。	2018年5月21日	-	12年	本科,曾任长信基金管理有限责任公司基金事务部基金会计、交易管理部债券交易员,广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员,富国基金管理有限公司固定收益部基金经理助理,上海东方证券资产管理有限公司私募固定收益投资部投资经理。现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部基金经理兼任东方红策略精选混合、东方红汇利债券、东方红汇阳债券、东方红益鑫纯债债券、东方红货币、东方红目标优选定开混合、东方红配置精选混合、东方红核心优选定开混合基金经理。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 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规关于公平交易的规定,公司建立了与公平交易相关的控制制度、流程以及信息披露程序等,保证公司在投资管理活动中以公平对待各投资组合,防范不同投资组合之间进行利益输送,并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。交易部使用恒生交易系统中的公平交易模块进行交易执行和分配,合规与风控管理部对公司各投资组合及组合之间的交易行为进行事后分析,检验公平交易执行情况。对于同向交易,合规与风控管理部侧重于对公司管理的不同产品(包含了公募产品、私募产品)的整体收益率差异、投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内交易所竞价交易的所有交易记录,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易价差按两两组合进行显著性检验,并根据显著性检验结果,对符合异常交易筛选条件并超过规定阈值的交易记录,通过逐笔检查或抽样分析的方法,分析相应交易行为的公平性。对同一投资人员管理的不同产品,则持续监控和跟踪其同向交易价差,如价差显著不为零,则在逐笔分析相关交易记录的基础上,对投资人员进行访谈,要求其进行相关的解释和说明,以更为审慎地判断其合理性。对于反向交易,除程序化交易外原则上禁止组合内部及组合之间的日内反向交易,如有投资策略或流动性等特殊需要的,需由投资经理提供投资依据,经投资决策委员会审慎审批后留档备查。本年度未发现公司管理的投资组合间存在违反公平交易原则的交易行为。

4.3.2 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》等规定。

4.3.3 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

权益方面,2018年市场表现不佳。国内方面,前期货币政策的收紧开始逐渐往信用收紧传递,市场对经济的预期出现了向下的修正;海外方面贸易战的发酵也给市场带来了更多的不确定性。

债券方面,2018年国内经济增速放缓趋势仍在延续,叠加中美贸易战的不利影响,促使宏观政策做出适度调整:从上半年的“去杠杆”向下半年的“稳杠杆”政策转向。央行稳健的货币政策也更加注重松紧适度,年内三次宣布调低存款准备金率,流动性保持合理充裕,债券呈现分化走势,利率债和中高等级信用债整体表现良好,但高杠杆、中低等级的债券发行人再融资存在一定压力,信用风险事件不断爆发。本报告期内,我们逐步拉长了利率债的久期,增配高等级信用债,并提高了组合的杠杆水平,取得了较为良好的回报。

转债市场在2018年经历了较大的变化。历史上转债市场一直属于小众市场,品种相对较少,且估值水平整体偏高。而经过2018年新转债的不断发行,存量的转债市场规模大幅扩容,大幅增加的转债数量给投资者带来了更多的挑选余地。而供给的增加以及股票市场的低迷表现,也使得转债市场的估值水平不断压缩,目前估值水平已经处于较低的位置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东方红配置精选混合A基金份额净值为0.9745元,份额累计净值为0.9745元,本报告期基金份额净值增长率为-2.55%;截至本报告期末东方红配置精选混合C基金份额净值为0.9714元,份额累计净值为0.9714元,本报告期基金份额净值增长率为-2.86%;同期业绩比较基准收益率为-2.43%。

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2019年,权益方面,虽然经济尚未看到明显企稳迹象,地产等因素也存在一定的不确定性,但一些积极因素也在出现,主要体现在全球的货币环境都开始有所改善,市场的主要边际变化也逐渐由紧信用向宽货币转化。而股市经过2018年的持续调整后,对于负面因素已经有所反应,当前股市整体估值已经处在历史较低水平,一些优质公司的估值更是具备投资吸引力,在这种环境下,权益资产的配置价值较2018年有所提升。因此,我们将坚持价值投资理念,逐渐加大估值合理、基本面稳健的优质龙头公司的配置比例。

债券整体仍处于较为有利的环境,利率债和高等级信用债具有配置价值。流动性宽松和市场利率走低将对债市的中长期走势提供良好支撑,配置高等级信用债和杠杆套息的策略预计将可能为组合带来显著贡献。除此以外,我们会坚持个体研究和宏观调研,自下而上的寻找被市场错误定价的优质企业并与之共同成长,努力为持有人获取长期、稳健的回报。

转债市场的低估值、标的扩容以及权益市场预期收益率的提升使得转债市场具备较高的配置价值。在操作中,我们将结合对转债公司基本面的研究,以及对股票及转债自身估值、条款的考量,精选性价比高的转债进行配置。

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》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。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性,对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致(中国证监会规定的特殊品种除外)。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值,本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系,估值委员会成员由投资、研究、运营、合规、风控等相关业务分管领导组成,运营业务分管领导为估值委员会主任委员,运营部是估值委员会的日常办事机构,运营部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。对于基金特殊估值调整事项,由估值委员会下设的估值业务工作小组提出调整方案并提交估值委员会审议,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.本基金的同一类别的每份基金份额享有同等分配权,由于本基金各类基金份额收取销售服务费情况不同,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同;

2.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该类基金份额净值自动转为同一类别的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;

3.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;

4.法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

本基金本报告期末进行利润分配。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度投向中未发生利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师薛竞、陈嘉雪字出具了普华永道中天审字(2019)第21684号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:东方红配置精选混合型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日
资 产:	
银行存款	21,926,978.23
结算备付金	14,227,992.60
存出保证金	325,993.23
交易性金融资产	6,491,328,948.19
其中:股票投资	953,094,374.42
基金投资	-
债券投资	5,538,234,573.77
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	5,041,935.33
应收利息	66,488,244.39
应收股利	33,996.29
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	6,599,374,088.26

负债和所有者权益	本期末 2018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	921,500,000.00
应付证券清算款	17.87
应付赎回款	-
应付管理人报酬	2,939,413.47
应付托管费	734,853.39
应付销售服务费	93,415.84
应付交易费用	772,796.54
应交税费	161,278.13
应付利息	1,158,147.46
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	251,333.00
负债合计	927,611,255.70
所有者权益:	
实收基金	5,820,987,015.29
未分配利润	-149,224,182.73
所有者权益合计	5,671,762,832.56
负债和所有者权益总计	6,599,374,088.26

注:1.报告截止日2018年12月31日,基金份额总额5,820,987,015.29份,其中 A类基金份额净值0.9745元,基金份额5,599,763,849.47份;C类基金份额净值0.9714元,基金份额221,223,165.82份。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:东方红配置精选混合型证券投资基金

本报告期:2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
一、收入	-122,754,234.21
1.利息收入	85,125,120.41
其中:存款利息收入	4,428,420.67
债券利息收入	73,750,728.92
资产支持证券利息收入	623,911.25
买入返售金融资产收入	6,322,059.57
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	30,190,949.97
其中:股票投资收益	-10,556,375.40
基金投资收益	-
债券投资收益	17,993,086.43
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	22,754,238.94
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-238,889,562.33
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	819,257.74
减:二、费用	35,028,641.14
1. 管理人报酬	22,649,600.33
2. 托管费	5,662,400.15
3. 销售服务费	751,730.70
4. 交易费用	1,512,582.10
5. 利息支出	4,057,285.46
其中:卖出回购金融资产支出	4,057,285.46
6. 税金及附加	98,411.10
7. 其他费用	296,631.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-157,782,875.35
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-157,782,875.35

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方红配置精选混合型证券投资基金

本报告期:2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31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)	6,397,549,362.87	-	6,397,549,362.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-157,782,875.35	-157,782,875.35
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)	-576,562,347.58	8,558,692.62	-568,003,654.96
其中:1.基金申购款	11,873,154.19	-174,336.64	11,698,817.55
2.基金赎回款	-588,435,501.77	8,733,029.26	-579,702,472.51
四、本期向基金分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)	5,820,987,015.29	-149,224,182.73	5,671,762,832.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

潘鑫军	任莉	詹明
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

东方红配置精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]298号《关于核准东方红配置精选混合型证券投资基金注册的批复》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》和《东方红配置精选混合型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币6,397,289,327.77元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0350号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红配置精选混合型证券投资基金合同》于2018年5月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,397,549,362.87份基金份额。其中认购资金利息折合230,035.10份基金份额。其中东方红配置精选混合A的基金份额总额为6,138,801,721.26份,净值为6,138,801,721.26元;东方红配置精选混合C的基金份额总额为258,747,641.61份,净值为258,747,641.61元。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。

根据《东方红配置精选混合型证券投资基金基金合同》《东方红配置精选混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。A类基金份额在投资人认购、申购时收取基金申购费用,申购费用,销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。A类基金份额在投资人认购、申购时收取基金申购费用,申购费用,销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。A类基金份额在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费,而不计提销售服务费。C类基金份额在投资人认购、申购基金时不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置基金代码,并且分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红配置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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),港股通标的股票、债券(国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-30%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货及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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率*80%+沪深300指数收益率*20%。

7.4.2 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”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方红配置精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的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年12月31日的财务状况以及2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目,应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日后的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值;与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响,特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的折旧

本基金持有的资产和采积的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1.具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债抵销后的净额资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日入账。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益;基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购