东方大健康混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:二〇一九年三月二十八日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月26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01月01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	东方大健康混合
基金主代码	002173
前端交易代码	002173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月4日
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,504,676.83份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以我国健康产业为核心投资方向,筛选具有投资价值的优质企业,通过健康产业内各行业的灵活配置分享我国大健康产业发展带来的投资机遇。
投资策略	本基金从国际化视野审视中国经济和资本市场,全面分析影响股票市场和债券市场走势的各种因素,深入详细地评估股票市场和债券市场的运行趋势。根据影响证券市场运行的各种因素的变化趋势,及时调整大类资产的配置比例,控制系统性风险。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中债总全价指数收益率
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李景岩	贺倩
	联系电话	010-66295888	010-60060069
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95599
传真		010-66578700	010-68121816

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

§3 主要财务指标、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	2017年	2016年2月4日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	-817,028.75	53,431.16	5,296,689.89
本期利润	-1,920,973.95	1,213,576.24	4,921,902.79
加权平均基金份额本期利润	-0.1561	0.0753	0.0809
本期基金份额净值增长率	-15.98%	7.80%	-2.67%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1185	0.0492	-0.0267
期末基金资产净值	10,141,227.00	14,410,726.58	18,081,259.33
期末基金份额净值	0.8815	1.0492	0.9733

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)。

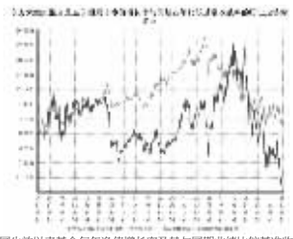
③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

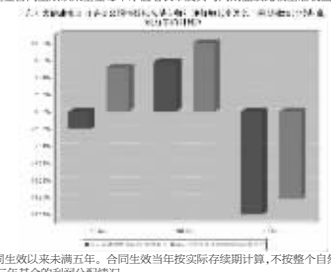
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-15.84%	1.51%	-6.41%	0.97%	-9.43%	0.54%
过去六个月	-23.60%	1.57%	-7.37%	0.89%	-16.23%	0.68%
过去一年	-15.98%	1.54%	-13.54%	0.79%	-2.44%	0.75%
过去三年	-11.85%	1.19%	2.32%	0.63%	-14.17%	0.56%
过去五年	-11.85%	1.19%	2.32%	0.63%	-14.17%	0.56%
自基金合同生效起至今	-11.85%	1.19%	2.32%	0.63%	-14.17%	0.56%

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



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:自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算,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

本基金自合同生效日(2016年2月4日)至本报告期截止日(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

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12月31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%。截止2018年12月31日,本公司管理40只开放式证券投资基金——东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方策略成长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、东方创新科技混合型证券投资基金、东方大健康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、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉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、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展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、东方睿鑫热点挖掘灵活配置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、东方稳健回报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、东方新价值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、东方新思路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、东方永照18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方臻悦纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选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
王然(女士)	本基金基金经理、权益研究部副总经理、投资决策委员会委员	2017年9月13日	-	10年	权益研究部副总经理,投资决策委员会委员,北京交通大学产业经济学硕士,10年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员、东方策略成长股票型开放式证券投资基金(于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金)基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金(于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金)基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金(于2017年6月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金)基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金(于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金)基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理,现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理。
薛子微(先生)	本基金基金经理	2016年12月27日	2018年1月24日	11年	山西大学工商管理、应用心理学专业学士,11年证券从业经历。曾任中国邮政研所研究员、中信基金管理有限责任公司助理研究员、华夏基金管理有限公司研究员。2009年7月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部应地产、综合、汽车、国防军工、机械设备行业研究员,投资经理,东方核心动力股票型开放式证券投资基金(于2015年7月31日转型为东方核心动力混合型证券投资基金)基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金(自2018年6月21日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金)基金经理。现任东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理、东方新能源汽车主题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、《东方大健康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 公平交易制度和控制方法

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控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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》的规定对本报告期公司不同投资组合同向交易价差进行了分析。公司采集连续四个季度,不同时间窗口(1日内、3日内、5日内)的同向交易样本,在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下,对同向交易价差进行T分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本基金与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.3 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。

基金管理人管理的投资组合参与的交易所公开竞价不存在同日反向交易,不存在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,中国先后经历了金融去杠杆、股权质押风险暴露、中美贸易摩擦升温、民企经营状况恶化、经济增长低于预期等一系列不利因素的影响。海外市场方面,美国连续多年的加息促使经济出现见顶迹象,日欧等发达经济体也出现放缓迹象并加大货币放松的预期。到2018年下半年,中国国内对于经济放缓的悲观预期愈加强烈,一系列稳经济政策出台,包括持续的降低存款准备金率、降低增值税率、调高个税起征点等刺激经济、改善企业经营的政策,但资本市场的悲观预期仍旧浓厚。

报告期内,主要宽基指数基本呈现单边下跌态势,其中上证综指全年跌幅24.6%,沪深300指数跌幅25.3%,创业板指跌幅28.6%。根据wind的数据统计,申万行业中50%的行业跌幅超过20%,其中传媒、有色金属、采掘跌幅居前,分别下跌37%、35%、34%;跌幅最小的三个行业是银行、计算机、通信,分别下跌了15%、21%、22%。从结构上来看,上半年以医药为代表的消费行业表现不俗,而下半年市场出现了系统性的全面下跌,而银行在下半年表现出了明显的防御属性。

报告期内,本基金考虑到2018年面临诸多不确定性因素的状况,通过自下而上优选行业龙头的方式,进行基金配置,其中重点配置了创新药及服务领域、医疗服务、品牌中药和器械等。上半年以受益政策、医药行业有较好的表现;7月受到长生生物的事件影响以及后续行业监管政策趋严,医药行业出现了大幅的调整,我们也从上半年较高的仓位调整至中性偏低仓位,以规避一定的系统性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018年1月1日起至2018年12月31日,本基金净值增长率为-15.98%,业绩比较基准收益率为-13.54%,低于业绩比较基准2.44%。

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,欧美经济面临较大不确定性因素,但全球流动性释放的预期较强,同时中美贸易关系有望得到阶段性进展,缓解了市场的不安情绪。同时,国内的宏观政策,宽信用的政策导向有望使经济在下半年企稳。科创板等金融供给侧改革有望进一步规范市场秩序,改善企业投融资环境,吸引外资持续流入,对市场构成了政策面的利好。诸多因素有望改善市场的悲观预期,提升风险偏好,同时经济状况和企业盈利有待进一步确认,我们认为2019年整体状况将好于2018年。从结构上看,符合国家中长期战略的领域,如生物技术、新一代信息技术、人工智能、5G、新能源等战略新兴产业经过近年来的培育,为经济结构转型升级积蓄力量,我们认为这里面蕴含的机会值得我们深入挖掘。对于健康医药板块,创新类、服务类、品牌类仍具备中长期投资价值,我们将中长期持有相关领域的龙头企业。

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"),成员由分管运营高管、分管投研高管、督察长以及运营部、投研部门(包括但不限于权益投资部、固定收益投资部、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报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,本基金本报告期内进行利润分配。

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,受基金份额持有人赎回等影响,本基金存在本基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况,本基金管理人已将此情况上报中国证监会并拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。

§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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—东方基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害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

本托管人认为,东方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《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。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人认为,东方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2019]第ZB30067号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	东方大健康混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了东方大健康混合型证券投资基金(以下简称东方大健康基金)财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了东方大健康基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方大健康基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
其他信息	东方大健康基金的基金管理人东方基金管理有限责任公司(以下简称基金管理人)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人负责评估东方大健康基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
会计师事务所的名称	立信会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	朱锦梅 / 高慧丽
会计师事务所的地址	上海市南京东路61号4楼
审计报告日期	2019年3月26日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:东方大健康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	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	3,806,317.94	965,312.96
结算备付金	123,551.49	54,536.53
存出保证金	13,172.76	13,959.95
交易性金融资产	7,770,963.00	14,110,673.00
其中:股票投资	7,770,963.00	12,611,923.00
基金投资	-	-
债券投资	-	1,498,750.00
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	500,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	703.69	33,259.09
应收股利	-	-
应收申购款	5,457.36	7,932.57
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	12,220,166.24	15,185,674.10
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	1,897,198.26	464,461.95
应付赎回款	1,959.87	106,983.10
应付管理人报酬	13,453.65	18,441.71
应付托管费	2,242.28	3,073.61
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	19,584.70	31,791.61
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	144,500.48	150,196.54
负债合计	2,078,939.24	774,947.52
所有者权益:		
实收基金	11,504,676.83	13,734,506.62
未分配利润	-1,363,449.83	676,219.96
所有者权益合计	10,141,227.00	14,410,726.58
负债和所有者权益总计	12,220,166.24	15,185,674.10

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.8815元,基金份额总额11,504,676.83份。

7.2 利润表

会计主体:东方大健康混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-1,371,970.49	1,744,727.13
1.利息收入	36,832.98	40,077.91
其中:存款利息收入	16,468.51	20,269.46
债券利息收入	10,287.50	19,783.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	10,076.97	24.77
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-360,973.92	521,350.35
其中:股票投资收益	-476,682.89	459,654.78
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,785.17	-
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	118,393.54	61,696.57
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,103,945.20	1,160,145.08
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	56,115.65	23,153.79
减:二、费用	549,003.46	531,150.89
1. 管理人报酬	194,526.46	240,278.83
2. 托管费	32,421.18	40,046.43
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	200,588.95	134,011.10
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	121,466.87	116,814.53
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-1,920,973.95	1,213,576.24
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-1,920,973.95	1,213,576.24

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方大健康混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1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)	13,734,506.62	676,219.96	14,410,726.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,920,973.95	-1,920,973.95
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)	-2,229,829.79	-118,695.84	-2,348,525.63
其中:1.基金申购款	13,346,733.09	1,525,796.30	14,872,529.39
2.基金赎回款	-15,576,562.88	-1,644,492.14	-17,221,055.02
五、期末所有者权益(基金净值)	11,504,676.83	-1,363,449.83	10,141,227.00
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	18,576,855.65	-495,596.32	18,081,259.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,213,576.24	1,213,576.24
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)	-4,842,349.03	-41,759.96	-4,884,108.99
其中:1.基金申购款	3,768,986.78	103,535.15	3,872,521.93
2.基金赎回款	-8,611,335.81	-145,295.11	-8,756,630.92
五、期末所有者权益(基金净值)	13,734,506.62	676,219.96	14,410,726.58

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:

_____刘鸿鹏 _____刘鸿鹏 _____王丹丹____

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

东方大健康混合型证券投资基金(以下简称"本基金")根据2015年7月13日中国证监会《关于准于东方大健康混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1613号)和《关于东方大健康混合型证券投资基金备案确认的函》(证券基金机构监管部函[2016]288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《东方大健康混合型证券投资基金合同》自2016年1月13日至2016年2月2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302,376,409.65元人民币,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)"瑞华验字[2016]第01300002号"验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方大健康混合型证券投资基金基金合同》于2016年2月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为302,390,471.18份基金单位,其中认购资金利息折合14,061.53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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方大健康混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于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(包括创业板股票、中小板股票以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)、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(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XBRL模板第3号—年度报告和半年度报告》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

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12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 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》、[2006]11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《关于金融推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确金融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《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]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》及及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

1.以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围,不征收增值税。

2.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。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务,转让2017 年12 月31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3.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。

4.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