东方民丰回报赢安混合型证券投资基金 2019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:中国民生银行股份有限公司
送出日期:二〇一九年八月二十七日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年8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。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方民丰回报赢安混合	
基金主代码	004006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年09月13日	
基金管理人	东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	9,965,271.79份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	东方民丰回报赢安混合A	东方民丰回报赢安混合C
下属分级基金的交易代码:	004006	004006
报告期末下属分级基金的份额总额	2,818,507.52份	7,146,764.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的前提下,通过动态调整权益类资产的组合,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金运用CPPI固定比例投资组合保险机制,在严格控制基金净值波动的前提下,动态分配基金资产在权益类资产和固定收益类资产上的投资比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%＋中债总全价指数收益率×85%
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。
下属分级基金的风险收益特征	东方民丰回报赢安混合A；东方民丰回报赢安混合C；-

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李崇岩	罗菲菲
	联系电话	010-66296888	010-58560666
	电子邮箱	xcpl@orient-fund.com	tgbhxjtzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		010-66578570或400-628-5888	95568
传真		010-66578700	010-58560798

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.dfhf888.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

基金份额	东方民丰回报赢安混合A	东方民丰回报赢安混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日－2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日－2019年6月30日)
本期已实现收益	172,018.89	76,527.88
本期利润	178,226.11	67,111.41
加权平均基金份额本期利润	0.0276	0.0146
本期基金份额净值增长率	2.11%	1.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0000	-0.0041
期末基金资产净值	2,818,580.04	7,117,222.26
期末基金份额净值	1.0000	0.9959

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

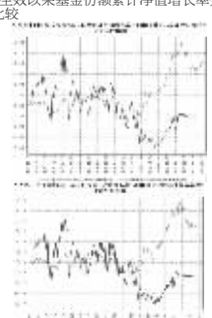
东方民丰回报赢安混合A

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
过去一个月	-0.04%	0.01%	1.21%	0.15%	-1.25%	-0.14%
过去三个月	-0.18%	0.02%	-0.54%	0.21%	0.36%	-0.19%
过去六个月	2.11%	0.16%	3.53%	0.21%	-1.42%	-0.06%
过去一年	-1.29%	0.28%	4.01%	0.22%	-5.30%	0.06%
过去三年	-0.91%	0.36%	4.22%	0.19%	-5.13%	0.17%
自基金合同生效起至今	-0.91%	0.36%	4.22%	0.19%	-5.13%	0.17%

东方民丰回报赢安混合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
过去一个月	-0.06%	0.01%	1.21%	0.15%	-1.27%	-0.14%
过去三个月	-0.25%	0.02%	-0.54%	0.21%	0.29%	-0.19%
过去六个月	1.97%	0.16%	3.53%	0.21%	-1.56%	-0.06%
过去一年	-1.58%	0.28%	4.01%	0.22%	-5.59%	0.06%
过去三年	-1.25%	0.36%	4.22%	0.19%	-5.47%	0.17%
自基金合同生效起至今	-1.25%	0.36%	4.22%	0.19%	-5.47%	0.17%

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2019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2019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、东方安心收益保本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、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方价值模型和估值方法的修改意见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、东方量化成长灵活配置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、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金、东方量化多策略混合型证券投资基金、东方城镇消费主题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		
王然	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	-	11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,11年证券从业经历,曾任融民基金交通运输、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,东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金(于2017年5月11日转型为东方成长收益平衡混合型基金)基金经理、东方采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9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2016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、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。	11年
周巍(女士)	本基金基金经理	2019年3月1日	-	10年	中国人民银行研究生部金融学博士,10年证券从业经历,曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012年7月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任固定收益部债券研究员、投资经理,东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金(于2017年8月23日起转型为东方永润债券型证券投资基金)基金经理、东方赢新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方赢新灵活配置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、东方永熙18个月定期开放债券型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、东方金证通货币市场基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。	10年
姚航	本基金基金经理、固定收益投资部副总经理、投资决策委员会委员	2017年9月13日	2019年3月6日	15	固定收益投资部副总经理,投资决策委员会委员,中国人民大学工商管理硕士,15年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司运营部。2010年10月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任债券交易员,东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理,东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金(于2017年5月11日起转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金)基金经理、东方采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9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2016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、东方岳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、东方金证通货币市场基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。	11年

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、《东方民丰回报赢安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

2019年一季度,随着国内政策逆周期调节,信用扩张边际改善,另一方面美联储加息等海外因素也出现逆转。受此影响,债券收益率先下后上,年初至春节利率债收益率延续下行态势,10年期国债和10年期国开债最低下行至 3.04%、3.49%,节后整体震荡,风险偏好有所回升。2019年二季度,宏观经济增长乏力,除地产投资外各分项均有所回落。从金融数据来看,资产端,贷款结构一般,同业端再现扩张;负债端,有所修复但结构欠佳,负债成本率仍处于缓慢上升通道;在融资供给节奏放缓、需求主动收缩的背景下,机构“优质资产荒”与“信用溢价上升”并存,广谱利率整体下行。5月银行信用事件爆发后,货币政策由稳健中性转向被动放松,银行间流动性总量充裕但分层明显,非银产品户及部分中小银行融入困难,资金价差较大。

具体投资策略方面,本基金灵活调整久期及仓位,在信用风险可控情况下,优选中高等级信用债以获取稳健的底仓收益,充分发掘单个券种超额收益机会,利率债方面择机参与利率债波段机会,并适度进行了转债波段操作以增厚组合收益,博取贝塔收益,获得了较好的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019年1月1日至2019年6月30日,本基金A类净值增长率为2.11%,业绩比较基准收益率为3.53%,低于业绩比较基准1.42%;本基金C类净值增长率为1.97%,业绩比较基准收益率为3.53%,低于业绩比较基准1.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度美联储大概率降息,国内通胀压力趋于缓和,政策空间打开。包商银行的接管事件叠加贸易环境变化的影响,名义增长压力上升,宏观政策大概率于三季度再度边际宽松,政策空间看,为缓解中小银行信用定价导致的同业成本上升,货币政策价格工具如调降OMO利率等存在逻辑合理性。同时,进入三季度,地方债供给的压力将较上一年有明显减弱,信用风险偏好下降背景下金融机构对国债和金融债的需求将有所改善。从地产的政策态度和行业周期来看,下半年地产投资和销售或将有所趋弱。当前政策路径延续至三季度,财政政策仍然是稳增长发力的主要抓手。受市场整体风险偏好提升影响,信用利差走扩压力加大,而期限利差持续维持高位,下半年高评级的久期策略或是最优的选择,市场因收益率已经下行至低位,波幅会进一步扩大。流动性时点或是绝对市场下行节奏的核心,基金持仓整体需要保持在一定久期之上,但是控制回撤会比净值增长更加困难,需要综合平衡。本基金债券部分将以高静态收益、中性久期的优质信用债为底仓,以获取稳定的票息收入,实现绝对收益,并择机进行利率债波段操作增厚组合收益,在流动性总体宽松的背景下,预计资金利率维持平稳,套息策略仍有价值。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,受基金份额持有人赎回等影响,本基金存在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

本报告期内, 中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在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,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、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方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有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,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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:东方民丰回报赢安混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	8,367,902.98	9,169,093.74
结算备付金	-	54,370.57
存出保证金	2,905.11	9,006.03
交易性金融资产	1,697,607.40	3,779,660.00
其中:股票投资	-	1,505,620.00
基金投资	-	-
债券投资	1,697,607.40	2,274,040.00
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	-	4,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	28,470.69	7,510.88
应收股利	-	-
应收申购款	-	298.22
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	10,096,916.18	17,019,939.44
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 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	-	-
应付证券清算款	-	3,952,489.91
应付赎回款	14,969.41	391.51
应付管理人报酬	6,534.14	8,740.78
应付托管费	1,225.15	1,638.90
应付销售服务费	1,702.49	1,019.15
应付交易费用	107,841.77	135,876.14
应交税费	15.13	22.23
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	28,835.79	99,000.24
负债合计	161,113.88	4,199,178.86
所有者权益:		
实收基金	9,965,271.79	13,102,640.77
未分配利润	-29,469.49	-281,880.19
所有者权益合计	9,935,802.30	12,820,760.58
负债和所有者权益总计	10,096,916.18	17,019,939.44

注:报告截止日2019年6月30日,东方民丰回报赢安混合A基金份额净值1.0000元,基金份额总额2,818,507.52份;东方民丰回报赢安混合C基金份额净值0.9959元,基金份额总额7,146,764.27份。东方民丰回报赢安混合份额总额合计为9,965,271.79份。

6.2 利润表

会计主体:东方民丰回报赢安混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	350,607.71	1,838,850.92
1.利息收入	60,540.44	566,380.06
其中:存款利息收入	28,435.89	53,020.12
债券利息收入	23,046.39	278,696.56
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	9,058.16	234,664.18
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	293,092.31	2,443,934.98
其中:股票投资收益	248,083.00	3,467,648.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	45,009.31	-1,180,814.88
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	-	157,101.60
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-3,209.25	-1,199,598.91
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	184.23	28,133.99
减:二、费用	105,270.19	631,565.31
1、管理人报酬	43,680.29	218,731.81
2、托管费	8,190.06	41,012.16
3、销售服务费	6,772.21	21,140.81
4、交易费用	7,653.20	282,982.65
5、利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6、税金及附加	11.81	679.73
7、其他费用	39,062.63	67,018.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	245,337.52	1,207,285.61
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	245,337.52	1,207,285.61

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方民丰回报赢安混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	13,102,640.77	-281,880.19	12,820,760.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	245,337.52	245,337.52
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)	-3,137,368.98	7,073.18	-3,130,295.80
其中:1.基金申购款	4,636,794.41	-14,159.26	4,622,635.15
2.基金赎回款	-7,774,163.39	21,232.44	-7,752,930.95
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)	9,965,271.79	-29,469.49	9,935,802.30
项目	上年度可比期间 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)	121,029,357.91	4,206,829.65	125,236,187.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,207,285.61	1,207,285.61
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)	-94,243,241.26	-3,448,050.23	-97,691,291.49
其中:1.基金申购款	25,168,994.24	399,316.33	25,568,310.57
2.基金赎回款	-119,412,235.50	-3,847,366.56	-123,259,602.06
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)	-	-1,624,108.03	-1,624,108.03
五、期末所有者权益(基金净值)	26,786,116.65	341,967.00	27,128,073.65

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_____ _____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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方民丰回报赢安混合型证券投资基金于2017年9月13日由东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金转型而来。

东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2016年11月29日中国证监会《关于准予东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2905号)准予募集注册,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《东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金基金合同》自2016年12月13日至2017年1月9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224,894,916.11元人民币,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)“瑞华验字[2017]第01300005号”验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为225,013,252.48份基金单位,其中认购资金利息折合118,336.37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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

2017年7月18日至2017年8月14日,东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议对《关于东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金转型有关事项的议案》进行了审议,会议于2017年8月15日完成计票,表决通过上述议案。根据议案内容,自2017年9月13日起,东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金,《东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金基金合同》失效,《东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金合同》生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方民丰回报赢安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(国债、中央银行票据、地方政府债、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、证券公司短期公司债券、超短期融资券、可交换债券、可转换债券、可分离交易可转债)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、股指期货、国债期货、权证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。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例不高于40%,投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。

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管理办法》、《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。

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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019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

本基金在本报告期间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》、[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《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