东方红配置精选混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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8月27日

§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8月23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。

§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	
前端交易代码	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	3,464,043,954.21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	3,347,203,632.41份	116,840,321.80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	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金半年度报告备置地点	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(2019年1月1日–2019年6月30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	247,730,406.27	8,436,936.79
本期利润	426,232,885.38	15,570,898.72
加权平均基金份额本期利润	0.0996	0.1009
本期基金份额净值增长率	7.79%	7.51%
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	0.0504	0.0444
期末基金资产净值	3,515,888,673.57	122,030,310.40
期末基金份额净值	1.0504	1.0444

注:1、表中的“期末”均指报告期最后一日,即6月30日;“本期”指2019年1月1日– 2019年6月30日。

2、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(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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。

4、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)。

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
过去一个月	2.05%	0.34%	1.31%	0.22%	0.74%	0.12%
过去三个月	–1.37%	0.45%	–0.32%	0.29%	–1.05%	0.16%
过去六个月	7.79%	0.50%	5.36%	0.30%	2.43%	0.20%
过去一年	6.57%	0.44%	4.51%	0.29%	2.06%	0.15%
自基金合同生效起至今	5.04%	0.42%	2.79%	0.29%	2.25%	0.13%

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
过去一个月	2.00%	0.34%	1.31%	0.22%	0.69%	0.12%
过去三个月	–1.50%	0.45%	–0.32%	0.29%	–1.18%	0.16%
过去六个月	7.51%	0.50%	5.36%	0.30%	2.15%	0.20%
过去一年	6.03%	0.44%	4.51%	0.29%	1.52%	0.15%
自基金合同生效起至今	4.44%	0.42%	2.79%	0.29%	1.65%	0.13%

注:1、自基金合同生效日起至今指2018年5月21日–2019年6月30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%

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,t日收益率(benchmarkt)按下列公式计算:

benchmarkt =20% *[t日沪深300指数/(t–1日沪深300指数)–1]+80%* [t日中债综合指数/(t–1日中债综合指数)–1];

其中,t=1,2,3,. . . T,T表示时间截至日;

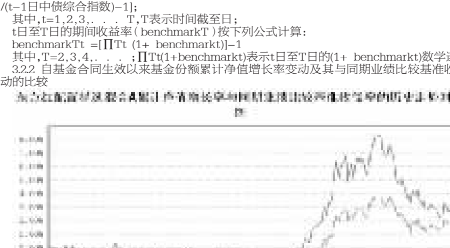
t日至T日的期间收益率(benchmarkT)按下列公式计算:

benchmarkTt =[∏Tt (1+ benchmarkt)]–1

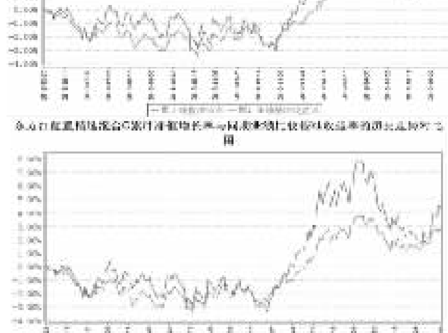
其中,T=2,3,4,. . . ;∏Tt(1+benchmarkt)表示t日至T日的(1+ benchmarkt)数学连乘。

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

东方红配置精选混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红配置精选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1、截止日期为2019年6月30日。

2、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约定。

§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2019年6月30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)、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、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、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、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、东方红策略精选灵活配置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6个月定期开放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、东方红睿轩三年定期开放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(LOF)、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、东方红睿玺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、东方红恒元五年定期开放灵活配置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基金经理。	2018年5月21日	–	8	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、东方红目标优选定开混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红创新优选定开混合、东方红配置精选混合、东方红稳健精选混合基金经理。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基金经理。	2018年5月21日	–	12	硕士,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、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、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》的规定。

4.3.2 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

债券市场方面,年初以来政策逆周期调节效果逐步显现,信贷需求有所好转,一季度经济运行开局平稳、好于预期。但受到中美贸易摩擦和银行接管事件引发市场波动的影响,尽管一季度货币政策例会上重提“把好货币供给总闸门”,但短期流动性在央行多种政策工具努力下仍然保持充裕,货币政策维持宽松局面。组合今年维持了配置高等级信用债和杠杆套息的策略,在1月中旬降准后减持了部分长端利率债,降低组合久期;在5月底银行接管事件发生时降低仓位防御,并择机增配利率债,力争获得较好的收益。

权益方面,年初包括股票和转债等权益类资产的估值水平相对处于历史较低位置。受益于货币环境的宽松,以及信用环境的逐渐企稳,上半年权益资产表现较好。在这种环境下,本产品的股票资产有所上涨,前期配置的一些转债也兑现了目标收益,给组合带来了良好的回报。

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的基金份额净值为1.0504元,份额累计净值为1.0504元,本报告期基金份额净值增长率为7.79%;截至本报告期末东方红配置精选混合C的基金份额净值为1.0444元,份额累计净值为1.0444元,本报告期基金份额净值增长率为7.51%;同期业绩比较基准收益率为5.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

转债方面,经过二季度权益市场的回调,转债整体的估值水平较1季度末有所压缩,转股溢价率再次回到了历史偏低位置,同时随着市场的扩容,优质转债标的进一步增加,相较于其他资产而言,转债当前的配置性价比较高。因此,我们将维持较高的转债配置比例,同时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。

本基金本报告期未进行利润分配。

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净值预警情形的说明

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

托管人声明:

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。

本半年度/年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度/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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:东方红配置精选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	附注号	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		21,846,571.09	21,926,978.23
结算备付金		20,675,924.61	14,227,992.60
存出保证金		358,263.65	325,993.23
交易性金融资产		4,500,849,314.66	6,491,328,948.19
其中:股票投资		722,711,690.47	953,094,374.42
基金投资		–	–
债券投资		3,751,372,624.19	5,538,234,573.77
资产支持证券投资		26,765,000.00	–
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		2,972,493.07	5,041,935.33
应收利息		52,685,456.48	66,488,244.39
应收股利		3,083,104.60	33,996.29
应收申购款		110,891.09	–
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		4,602,582,019.25	6,599,374,088.26
负债和所有者权益	附注号	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		949,000,000.00	921,500,000.00
应付证券清算款		22.24	17.87
应付赎回款		11,185,829.86	–
应付管理人报酬		1,799,580.55	2,939,413.47
应付托管费		449,895.14	734,853.39
应付销售服务费		50,302.14	93,415.84
应付交易费用		1,121,957.65	772,796.54
应交税费		145,436.05	161,278.13
应付利息		780,039.87	1,158,147.46
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		129,971.78	251,333.00
负债合计		964,663,035.28	927,611,255.70
所有者权益:			
实收基金		3,464,043,954.21	5,820,987,015.29
未分配利润		173,875,029.76	–149,224,182.73
所有者权益合计		3,637,918,983.97	5,671,762,832.56
负债和所有者权益总计		4,602,582,019.25	6,599,374,088.26

注: 报告截止日2019年6月30日,基金份额总额3,464,043,954.21份,其中东方红配置精选混合A基金份额总额为3,347,203,632.41份,基金份额净值1.0504元;东方红配置精选混合C基金份额总额为116,840,321.80份,基金份额净值1.0444元。

6.2 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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入		475,477,227.11	–86,041,883.51
1.利息收入		57,908,507.19	17,492,264.16
其中:存款利息收入		394,419.81	3,892,570.55
债券利息收入		57,000,707.48	8,202,063.74
资产支持证券利息收入		511,876.34	111,600.00
买入返售金融资产收入		1,503.56	5,286,029.87
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以“–”填列)		231,858,698.59	7,433,832.68
其中:股票投资收益		38,208,802.73	33,000.00
基金投资收益		–	–
债券投资收益		186,321,836.58	847,245.52
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		7,328,059.28	6,553,587.16
3.公允价值变动收益(损失以“–”号填列)		185,636,441.04	–110,967,980.35
4.汇兑收益(损失以“–”号填列)		–	–
5.其他收入(损失以“–”号填列)		73,580.29	–
减:二、费用		33,673,443.01	6,394,048.78
1.管理人报酬		13,715,363.86	4,185,685.54
2.托管费		3,428,840.98	1,046,421.42
3.销售服务费		396,011.78	141,038.26
4.交易费用		1,158,638.15	962,146.38
5.利息支出		14,703,828.76	–
其中:卖出回购金融资产支出		14,703,828.76	–
6.税金及附加		96,498.12	7,492.16
7.其他费用		174,261.36	51,265.02
三、利润总额(亏损总额以“–”号填列)		441,803,784.10	–92,435,932.29
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以“–”号填列)		441,803,784.10	–92,435,932.29

6.3 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: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)	5,820,987,015.29	–149,224,182.73	5,671,762,832.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	441,803,784.10	441,803,784.10
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)	–2,356,943,061.08	–118,704,571.61	–2,475,647,632.69
其中:1.基金申购款	62,476,139.58	3,056,438.04	65,532,577.62
2.基金赎回款	–2,419,419,200.66	–121,761,009.65	–2,541,180,210.31
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)	3,464,043,954.21	173,875,029.76	3,637,918,983.97
项目	上年度可比期间 2018年5月21日(基金合同生效日)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)	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)	–	–92,435,932.29	–92,435,932.29
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)	–	–	–
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
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)	6,397,549,362.87	–92,435,932.29	6,305,113,430.58

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:	
潘鑫军	任莉	詹朋
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”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2398号《关于准予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6,397,259,327.77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290,035.10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,包含认购资金利息折合278,393.43份,东方红配置精选混合C的基金份额总额为258,747,641.61份,包含认购资金利息折合11,641.67份。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》和《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、中小企业私募债券、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资产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和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%。

6.4.2 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“中国基金业协会”)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》和其他中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于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日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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《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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
东方证券股份有限公司(“东方证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
上海东方证券资产管理有限公司(“东证资管”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2019年1月1日至2019年6月30日			
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
东方证券	511,335,346.31	77.16	713,194,730.92	69.09

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
东方证券	1,659,981,910.80	79.90	2,486,202,942.62	87.36

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
东方证券	37,154,200,000.00	100.00	19,328,500,000.00	99.49

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易

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 2019年1月1日至2019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(%)
东方证券	375,561.27	77.72	1,099,987.50	98.16
关联方名称	上年度可比期间 2018年5月21日(基金合同生效日)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(%)
东方证券	527,433.11	69.91	527,433.11	69.91

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,715,363.86	4,185,685.54
其中:支付销售机构的客户维护费	6,723,660.17	2,111,282.46

注:1.本基金的管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=EX0.60% ÷ 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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。若遇法定节假日、公休日等,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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,428,840.98	1,046,421.42

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=EX0.15% ÷ 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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延 。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红配置精选混合A	东方红配置精选混合C	合计
东方证券	–	11,107.08	11,107.08
东证资管	–	5,535.92	5,535.92
招商银行	–	379,368.78	379,368.78
合计	–	396,011.78	396,011.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年5月21日(基金合同生效日)至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红配置精选混合A	东方红配置精选混合C	合计
东方证券	–	4,227.81	4,227.81
东证资管	–	1,663.04	1,663.04
招商银行	–	135,147.41	135,147.41
合计	–	141,038.26	141,038.26

注:本基金C类份额的销售服务费率按前一日C类基金资产净值的0.50%的年费率计提。C类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×0.50% ÷ 当年天数

H 为每日C类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日C类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。

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

注:本基金本报告期及上年度可比期间未发生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

注:本基金的基金管理人于本基金本报告期及上年度可比期间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

注:本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 2019年1月1日至2019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
招商银行	21,846,571.09	119,652.98	184,530,082.85	1,027,697.74

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年07月05日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	–
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年07月05日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	–
6.4.9.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019年06月20日	2019–07–08	新债未上市	100.00	100.00	3,060	306,000.00	306,000.00	–

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

注:截至本报告期末2019年06月30日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年06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949,000,000.00元,于2019年07月01日、07月03日、07月08日、07月10日、07月11日、07月24日、07月25日、09月25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

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为2,281,649,288.12元,属于第二层次的余额为2,219,200,026.54元,无属于第三层次的余额(2018年12月31日:第一层次2,513,273,508.99元,第二层次3,978,055,439.20元,无第三层次。)

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2018年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项

§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	722,711,690.47	15.70
	其中:股票	722,711,690.47	15.70
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	3,778,137,624.19	82.09
	其中:债券	3,751,372,624.19	81.51
	资产支持证券	26,765,000.00	0.58
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	42,522,495.70	0.92
8	其他各项资产	59,210,208.89	1.29
9	合计	4,602,582,019.25	100.00

注: 本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为101,688,080.00元人民币,占期末基金资产净值比例2.80%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	20,948,431.25	0.58
C	制造业	423,744,422.52	11.65
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	24,019,886.55	0.66
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,154,603.76	0.75
J	金融业	125,133,159.79	3.44
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	–	–
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	23,106.60	0.00
S	综合	–	–
	合计	621,023,610.47	17.07

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
A 基础材料	–	–
B 消费者非必需品	52,658,080.00	1.45
C 消费者常用品	–	–
D 能源	28,780,000.00	0.79
E 金融	–	–
F 医疗保健	–	–
G 工业	–	–
H 信息科技	–	–
I 电信服务	–	–
J 公用事业	20,250,000.00	0.56
K 房地产	–	–
合计	101,688,080.00	2.80

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard,GICS)。

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601601	中国太保	2,421,235	88,399,289.85	2.43
2	002078	太阳纸业	6,697,002	45,606,583.62	1.25
3	002415	海康威视	1,599,894	44,125,076.52	1.21
4	600887	伊利股份	1,200,000	40,092,000.00	1.10
5	600196	复星医药	1,500,000	37,950,000.00	1.04
6	601211	国泰君安	2,000,000	36,700,000.00	1.01
7	000333	美的集团	698,800	36,239,768.00	1.00
8	600104	上汽集团	1,307,100	33,331,050.00	0.92
9	01088	中国神华	2,000,000	28,780,000.00	0.79
10	00175	吉利汽车	2,300,000	27,025,000.00	0.74

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	600019	宝钢股份	31,092,000.00	0.55
2	002008	大族激光	27,100,703.78	0.48
3	600031	三一重工	26,455,165.80	0.47
4	02238	广汽集团	23,611,636.52	0.42
5	603228	景旺电子	22,504,382.88	0.40
6	600690	海尔智家	9,078,808.60	0.16
7	002271	东方雨虹	6,164,920.26	0.11
8	600104	上汽集团	2,032,000.00	0.04
9	600989	宝丰能源	270,838.72	0.00
10	600968	海油发展	208,845.00	0.00
11	601298	青岛港	109,487.50	0.00
12	002948	青岛银行	94,522.24	0.00
13	600928	西安银行	90,684.36	0.00
14	002958	青农商行	70,092.00	0.00
15	603379	三美股份	66,546.36	0.00
16	601615	明阳智能	63,797.25	0.00
17	002955	鸿合科技	58,070.28	0.00
18	002945	华林证券	48,826.56	0.00
19	300770	新媒股份	45,972.07	0.00
20	300773	拉卡拉	41,600.00	0.00

注:“本期累计买入金额” 按买入成交金额(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	601939	建设银行	103,145,307.80	1.82
2	601818	光大银行	82,930,000.00	1.46
3	600031	三一重工	66,827,956.60	1.18
4	600019	宝钢股份	51,149,699.12	0.90
5	002008	大族激光	39,740,892.48	0.70
6	002271	东方雨虹	35,931,516.70	0.63
7	601211	国泰君安	31,323,706.06	0.55
8	601668	中国建筑	25,680,327.00	0.45
9	600887	伊利股份	20,945,451.00	0.37
10	601111	中国国航	15,253,778.00	0.27
11	600011	华能国际	13,005,000.00	0.23
12	002475	立讯精密	11,403,052.72	0.20
13	603228	景旺电子	10,910,026.00	0.19
14	600690	海尔智家	10,759,839.40	0.19
15	002470	金正大	10,502,920.00	0.19
16	300036	超图软件	9,017,912.00	0.16
17	002027	分众传媒	8,462,190.00	0.15
18	600196	复星医药	6,695,844.00	0.12
19	600143	金发科技	4,693,648.00	0.08
20	002311	海大集团	1,189,591.00	0.02

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(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	150,122,904.10
卖出股票收入(成交)总额	563,598,461.21

注:“买入股票成本(成交)总额” 和“卖出股票收入(成交)总额”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。

7.5 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	1,226,123,850.00	33.70
	其中:政策性金融债	1,123,422,000.00	30.88
4	企业债券	966,254,200.00	26.56
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	1,558,994,574.19	42.85
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	3,751,372,624.19	103.12

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	180211	18国开11	4,500,000	455,400,000.00	12.52
2	132013	17宝武EB	3,086,110	308,425,833.40	8.48
3	190203	19国开03	2,100,000	208,656,000.00	5.74
4	132009	17中油EB	1,898,520	187,744,642.80	5.16
5	180209	18国开09	1,800,000	180,054,000.00	4.95

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1989094	19上和2A1	500,000	26,455,000.00	0.73
2	1989013	19上和1A1	500,000	310,000.00	0.01

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

注: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

注: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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量,以萃取相应股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金持有的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票未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	358,263.65
2	应收证券清算款	2,972,493.07
3	应收股利	3,083,104.60
4	应收利息	52,685,456.48
5	应收申购款	110,891.09
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	59,210,208.89

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	132013	17宝武EB	308,425,833.40	8.48
2	132009	17中油EB	187,744,642.80	5.16
3	132015	18中油EB	166,410,063.30	4.57
4	132014	18中化EB	165,423,411.00	4.55
5	113508	新凤转债	88,788,867.90	2.44
6	110043	无锡转债	69,112,249.90	1.90
7	110042	航电转债	66,119,057.60	1.82
8	132006	16皖新EB	59,749,250.40	1.64
9	113019	玲珑转债	56,345,807.40	1.55
10	132004	15国盛EB	49,188,146.60	1.35
11	110047	山鹰转债	43,444,000.00	1.19
12	113020	桐昆转债	42,765,694.40	1.18
13	128028	赣锋转债	35,822,832.50	0.98
14	128027	崇达转债	24,135,423.18	0.66
15	132012	17巨化EB	23,837,760.00	0.66
16	132011	17浙报EB	18,925,312.00	0.52
17	128032	双环转债	18,660,366.90	0.51
18	113509	新泉转债	15,608,776.50	0.43
19	110041	蒙电转债	13,697,197.50	0.38
20	127007	湖广转债	6,386,374.51	0.18

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

份额级别	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(%)
东方红配置精选混合A	29,960	111,722.42	9,921.08	0.00	3,347,193,711.33	100.00
东方红配置精选混合C	885	132,022.96	–	–	116,840,321.80	100.00
合计	30,845	112,304.88	9,921.08	0.00	3,464,034,033.13	100.00

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	东方红配置精选混合A	300,054.21	0.0090
	东方红配置精选混合C	12,612.43	0.0108
	合计	312,666.64	0.0090

注:从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3 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情况

项目	份额级别	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	东方红配置精选混合A	0~10
	东方红配置精选混合C	–
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红配置精选混合A	0~10
	东方红配置精选混合C	–
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	东方红配置精选混合A	东方红配置精选混合C
基金合同生效日(2018年5月21日)基金份额总额	6,138,801,721.26	258,747,641.61
本报告期期初基金份额总额	5,599,763,849.47	221,223,165.82
本报告期基金总申购份额	57,865,015.48	4,611,124.10
减:本报告期基金总赎回份额	2,310,425,232.54	108,993,968.12
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	3,347,203,632.41	116,840,321.80

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。2019年4月1日

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,卢强同志自2019年5月21日起辞去基金管理人副总经理职务;李云亮同志自2019年5月29日起兼任公司首席信息官职务。 本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。2019年4月1日

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。2019年4月1日

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。2019年4月1日

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。2019年4月1日

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

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。2019年4月1日

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	
东方证券	3	511,335,346.31	77.16%	375,561.27	77.72%	–
宏信证券	1	151,068,228.24	22.80%	107,454.95	22.24%	–
国金证券	1	274,955.82	0.04%	195.58	0.04%	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	2	–	–	–	–	–
川财证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	1	–	–	–	–	–
天风证券	1	–	–	–	–	–
汇丰前海	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
西部证券	1	–	–	–	–	–
高华证券	1	–	–	–	–	–
长江证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
申万宏源	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
民生证券	1	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
中泰证券	1	–	–	–	–	–
华菁证券	1	–	–	–	–	–
海通证券	2	–	–	–	–	–
广发证券	2	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	–	–	–	–	–
国盛证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	1	–	–	–	–	–
中信建投证券	2	–	–	–	–	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–

注:1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易(如有)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

(1)选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范,最近一年无重大违规行为;具有较强的研究服务能力;交易佣金收费合理。

(2)选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价,然后根据评价选择券商,与其签订协议租用交易单元。

3、报告期内本公司已取得上海交易所租用其他券商交易单元的资格并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜,后续将陆续切换租用的其他券商交易单元;本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格,并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

4、本报告期内新增交易单元情况:新增东方证券1个、国金证券1个、国信证券1个、中信证券2个、川财证券1个、东吴证券1个、汇丰前海1个、安信证券1个、西部证券1个、高华证券1个、长江证券1个、兴业证券1个、申万宏源1个、华泰证券1个、民生证券1个、光大证券1个、中泰证券1个、华菁证券1个、海通证券2个、广发证券2个、华创证券1个、西南证券1个、方正证券1个、中信建投证券2个、国泰君安1个交易单元。

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
东方证券	1,659,981,910.80	79.90%	37,154,200,000.00	100.00%	–	–
宏信证券	417,592,960.94	20.10%	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
川财证券	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–
汇丰前海	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–
高华证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
中泰证券	–	–	–	–	–	–
华菁证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	–	–	–	–
国盛证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
中信建投证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–

§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

注:本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

上海东方证券资产管理有限公司
2019年8月27日