# 东方红汇利债券型证券投资基金

## 2017 半年度 报告摘要

2017年6月30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：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2017年8月28日

### §1 重要提示

1.1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司的董事会及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责任。本半年度报告由董事长签发。

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2017年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

上海东方证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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2017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 | 东方红汇利债券 | |
| 基金主代码 | 002651 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年6月13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 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 970,656,098.66份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称： | 东方红汇利债券A | 东方红汇利债券C |
| 下属分级基金的交易代码： | 002651 | 002652 |
| 下属分级基金的前端交易代码 | 002651 | 002652 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 758,808,986.83份 | 211,847,111.83份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定的绝对收益。另外，本基金可投资于股票、权证等权益类资产，基金管理人将在本基金已累积一定收益的情况下，运用定性分析和定量分析相结合的方法选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资，增强基金的获利能力，提高预期收益水平，以期达到收益增强的效果。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率＊90%+沪深300指数收益率＊10%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 唐涵颖 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-63325888 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@dfham.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4009200808 | 95588 |
| 传真 | | 021-63326981 | 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 | 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<br>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

| 基金级别 | 东方红汇利债券A | 东方红汇利债券C |
|---|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2017年1月1日－2017年6月30日） | 报告期（2017年1月1日－2017年6月30日） |
| 本期已实现收益 | 7,409,299.30 | 2,038,550.51 |
| 本期利润 | 20,899,614.24 | 5,766,074.01 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0247 | 0.0188 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.63% | 2.40% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2017年6月30日） | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0179 | 0.0134 |
| 期末基金资产净值 | 779,072,981.36 | 216,543,955.04 |
| 期末基金份额净值 | 1.0267 | 1.0222 |

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日；“本期”指2017年1月1日－2017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

东方红汇利债券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 | 2.43% | 0.12% | 1.31% | 0.09% | 1.12% | 0.03% |
| 过去三个月 | 2.37% | 0.14% | -0.19% | 0.11% | 2.56% | 0.03% |
| 过去六个月 | 2.63% | 0.13% | -0.88% | 0.10% | 3.51% | 0.03% |
| 过去一年 | 3.61% | 0.14% | -1.64% | 0.12% | 5.25% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.68% | 0.14% | -1.33% | 0.12% | 5.01% | 0.02% |

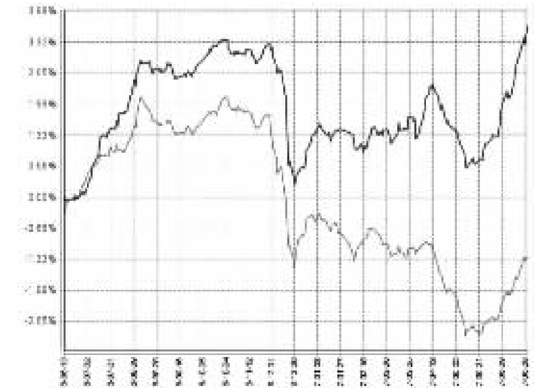
东方红汇利债券C

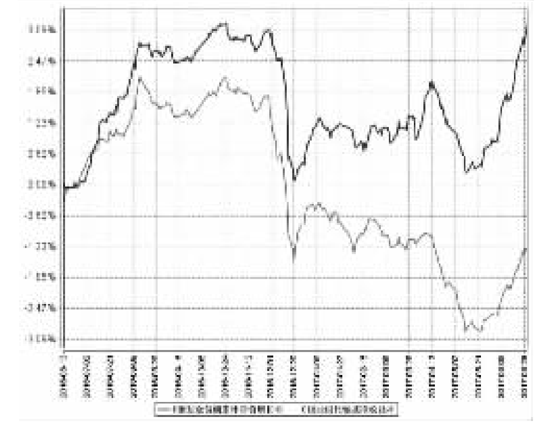
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 2.40% | 0.12% | 1.31% | 0.09% | 1.09% | 0.03% |
| 过去三个月 | 2.27% | 0.14% | -0.19% | 0.11% | 2.46% | 0.03% |
| 过去六个月 | 2.40% | 0.13% | -0.88% | 0.10% | 3.28% | 0.03% |
| 过去一年 | 3.18% | 0.14% | -1.64% | 0.12% | 4.82% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.23% | 0.14% | -1.33% | 0.12% | 4.56% | 0.02% |

注：1、自基金合同生效日起至今指2016年6月13日－2017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=中债综合指数收益率＊90%+沪深300指数收益率＊10%

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2017年6月30日。

2、本基金建仓期6个月，即从2016年6月13日起至2016年12月12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［2016］690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2017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、东方红睿阳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、东方红纯债债券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、东方红汇利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二十七只证券投资基金。

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 | | |
| 饶刚 | 上海东方证券资产管理有限公司副总经理、兼任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基金经理。 | 2016年7月28日 | - | 18年 | 硕士，曾任兴业证券股份有限公司职员，富国基金管理有限公司研究员、固定收益部总经理兼基金经理、总经理助理，富国资产管理（上海）有限公司总经理；现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 纪文静 | 上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理、兼任东方红领先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、东方红纯债债券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、东方红信用债债券型证券投资基金、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、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、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基金经理。 | 2016年6月13日 | - | 10年 | 硕士，曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理，德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理，上海东方证券资产管理有限公司固定收益部副总监；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副总经理兼任东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红策略精选混合、东方红纯债债券、东方红收益增强债券、东方红信用债债券、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红稳添利纯债、东方红战略精选混合、东方红价值精选混合、东方红益鑫纯债债券、东方红智逸沪港深定开混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 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基金经理。 | 2016年8月5日 | - | 6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

2017年上半年权益市场分化较大，上半年上证综指上涨2.86%，深证成指上涨3.46%，沪深300上涨10.78%，创业板指下跌7.34%。上半年权益市场的结构性行情的特点突出，一些估值合理的价值股表现较好，而之前估值偏高的一些公司持续回调。本产品在个股选择上以具有较好稳定性和高分红低估值的优质龙头企业为主，包括消费品行业龙头和一些行业供给侧收缩的部分周期品龙头。同时根据宏观环境变化对仓位和配置方向进行适度调整，以起到降低组合波动、提升夏普比例的组合优化作用。

债券方面，上半年债市整体呈现下跌格局，标志性的10Y国债收益率从年初的3.01%上行50BP至3.56%，信用债收益率全面上行，长久期、低评级受影响更大。突发性的、影响较大的信用风险事件在本期间也有明显增加的趋势。本产品在配置上整体缩短了组合久期，提高债券的资质要求。通过自下而上的精选个券，在维持较低杠杆水平的前提下，努力提高组合的基础收益率。在市场超跌反弹的过程中，也积极参与，把握个体的投资机会，从而力争增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，本基金A类份额净值为1.0267元，份额累计净值为1.0367元， C 类份额净值为1.0222元，份额累计净值为1.0322元。报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为2.63%，同期业绩比较基准收益率为-0.88%，C 类份额净值增长率为2.40%，同期业绩比较基准收益率为-0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年上半年宏观经济呈现相对稳定的格局。上半年整体投资增速虽然未能延续去年的复苏趋势，但也未出现明显下行，整体仍然呈现企稳的格局。展望下半年，随着房地产调控政策的陆续出台，以及利率水平的上升，地产仍有一定的回落压力；基建投资预计仍会维持在相对较高水平，对经济形成托底作用；而随着一些产业逐渐进行了产能收缩的调整，制造业投资有望延续见底的趋势。整体上经济预计呈现平稳回落的格局。通胀方面，上半年通胀水平平稳，预计下半年CPI整体仍会延续平稳态势，PPI同比预计将逐渐从高位回落。

从权益市场来看，在经济转型期虽然整体经济增速回落，但仍有一些竞争优势突出、符合经济转型方向的公司能够获得稳定成长，其中一些估值合理的股票具备长期配置价值。下半年我们认为权益市场仍是以结构性机会为主，我们仍将追随社会发展的大趋势而选择估值合理的优秀公司，期望给投资者带来回报。

从债券市场来看，金融去杠杆仍在路上，只是节奏发生变化，预计监管政策的协调性和一致性会得到增强；各国央行宽松货币政策逐步退出是大势所趋；市场参与者与监管当局之间的预期差仍将反复出现，加剧市场的波动。面对更加复杂的局势，我们将积极的参与市场，精选个券、努力提高组合基础收益率；努力为持有人获取长期、稳健的回报。

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。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人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。同时，公司设估值决策小组，成员包括：公司总经理、合规总监（或督察长）、交易总监、运营总监、基金会计主管等。基金经理不参与基金日常估值业务，对于属于东证资管估值政策范围内的特殊估值变更可参与讨论，但最终决策由估值决策小组讨论决策并联名审批。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议，由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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某类基金份额净值减去每单位该类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。

本基金本报告期内未进行利润分配。

本基金于资产负债表日后实施的收益分配情况如下：2017年7月10日公告每10份基金份额派发红利0.1元，收益分配基准日为2017年6月30日，共计派发红利9,461,096.57元，其中9,087,062.16元为现金红利发放形式，374,034.41元为红利再投资方式。

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，在本报告期内，基金托管人——中国工商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：东方红汇利债券型证券投资基金
报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末<br>2017年6月30日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 1,404,855.01 | 77,012,418.75 |
| 结算备付金 | 28,307,303.85 | 26,248,159.67 |
| 存出保证金 | 189,770.51 | 129,871.13 |
| 交易性金融资产 | 1,129,669,313.68 | 1,567,603,014.95 |
| 其中：股票投资 | 109,649,963.63 | 124,439,529.65 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 998,949,350.05 | 1,408,383,985.30 |
| 资产支持证券投资 | 21,070,000.00 | 34,779,500.00 |
| 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 | - | - |
| 应收利息 | 17,326,034.31 | 15,861,876.32 |
| 应收股利 | 22,733.18 | 22,733.18 |
| 应收申购款 | 1,310,987.58 | 551,095.24 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,178,230,998.12 | 1,687,429,169.24 |
| 负债和所有者权益 | 本期末<br>2017年6月30日 | 上年度末<br>2016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 | 177,200,000.00 | 302,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | 457,728.92 | 2,493,032.51 |
| 应付赎回款 | 3,285,178.23 | 1,360,341.58 |
| 应付管理人报酬 | 575,446.09 | 896,667.52 |
| 应付托管费 | 164,413.16 | 256,190.71 |
| 应付销售服务费 | 74,052.94 | 158,635.27 |
| 应付交易费用 | 785,187.94 | 486,715.26 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | -68,273.89 | 9,791.80 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 140,328.33 | 140,564.68 |
| 负债合计 | 182,614,061.72 | 307,801,939.33 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 970,656,098.66 | 1,379,973,166.92 |
| 未分配利润 | 24,960,837.74 | -345,937.01 |
| 所有者权益合计 | 995,616,936.40 | 1,379,627,229.91 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,178,230,998.12 | 1,687,429,169.24 |

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.0257元，基金份额总额970,656,098.66份，其中A类基金份额净值1.0267元，基金份额758,808,986.83份；C类基金份额净值1.0222元，基金份额211,847,111.83份。

6.2 利润表

会计主体：东方红汇利债券型证券投资基金
本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 37,644,154.02 | 586,849.04 |
| 1.利息收入 | 21,354,126.28 | 664,908.84 |
| 其中：存款利息收入 | 279,569.45 | 219,358.62 |
| 债券利息收入 | 20,571,613.57 | 352,703.97 |
| 资产支持证券利息收入 | 502,943.26 | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 92,846.25 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -1,127,069.50 | -43,691.33 |
| 其中：股票投资收益 | 15,980,600.04 | -55,171.33 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -19,096,386.23 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | 75,900.00 | - |
| 股利收益 | 1,912,816.69 | 11,480.00 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 17,217,838.44 | -34,368.47 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 199,258.80 | - |
| 减：二、费用 | 10,978,465.77 | 297,427.11 |
| 1.管理人报酬 | 4,045,163.54 | 148,695.38 |
| 2.托管费 | 1,155,761.01 | 42,484.41 |
| 3.销售服务费 | 614,433.86 | 42,273.43 |
| 4.交易费用 | 623,285.60 | 45,286.78 |
| 5.利息支出 | 4,381,025.04 | 847.49 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 4,381,025.04 | 847.49 |
| 6.其他费用 | 158,796.72 | 17,839.62 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 26,665,688.25 | 289,421.93 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 26,665,688.25 | 289,421.93 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红汇利债券型证券投资基金
本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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） | 1,379,973,166.92 | -345,937.01 | 1,379,627,229.91 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 26,665,688.25 | 26,665,688.25 |
| 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） | -409,317,068.26 | -1,358,913.50 | -410,675,981.76 |
| 其中：1.基金申购款 | 48,590,612.63 | 334,279.28 | 48,924,891.91 |
| 2.基金赎回款 | -457,907,680.89 | -1,693,192.78 | -459,600,873.67 |
| 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） | 970,656,098.66 | 24,960,837.74 | 995,616,936.40 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016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） | 457,412,717.49 | - | 457,412,717.49 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 289,421.93 | 289,421.93 |
| 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） | 457,412,717.49 | 289,421.93 | 457,702,139.42 |

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：

______陈光明______　　______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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方红汇利债券型证券投资基金（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”）《关于准予东方红汇利债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可［2016］690号文）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》及其配套规则和《东方红汇利债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年6月13日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金于2016年5月16日至2016年6月3日向社会公开募集， 扣除认购费后的有效认购资金457,341,923.22元， 利息转份额70,794.27元，募集规模为457,412,717.49份。其中东方红汇利A的基金份额总额为229,831,167.58份，包含认购资金利息折合41,018.12份，东方红汇利C基金份额总额为227,581,549.91， 包含认购资金利息折合29,776.15份。上述募集资金已由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红汇利债券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）、债券、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、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）。本基金投资的具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、债券质押及买断式回购、可转换债券、可分离交易可转债、证券公司发行的短期公司债券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款、同业存单）等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率＊90%+沪深 300 指数收益率＊10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日止期间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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部财税［2004］78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）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。

（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。

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、基金代销机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 上海东方证券资产管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |

注：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 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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016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 | 367,890,636.91 | 80.98% | 43,706,693.58 | 100.00% |

注：上年度可比期间指2016年6月13日－6月30日。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016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 | 643,741,583.08 | 91.23% | 134,816,659.76 | 100.00% |

注：上年度可比期间指2016年6月13日－6月30日。

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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 东方证券 | 29,292,000,000.00 | 100.00% | 1,140,000,000.00 | 100.00% |

注：上年度可比期间指2016年6月13日－6月30日。

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017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 | 269,037.82 | 81.40% | 750,052.99 | 95.67% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016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 | 31,962.33 | 100.00% | 31,962.33 | 100.00% |

注：1、上年度可比期间指2016年6月13日－6月30日。

2、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

3、本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；截至报告期末，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。

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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,045,163.54 | 148,695.38 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,151,179.04 | 68,357.24 |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.7%÷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。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

3、本期指2017年1月1日－6月30日，上年度可比期间指2016年6月13日－6月30日。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,155,761.01 | 42,484.41 |

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.2%÷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。

2、本期指2017年1月1日－6月30日，上年度可比期间指2016年6月13日－6月30日。

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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 东方红汇利债券A | 东方红汇利债券C | 合计 |
| 上海东方证券资产管理有限公司 | - | 132,219.42 | 132,219.42 |
| 工商银行 | - | 46,909.07 | 46,909.07 |
| 东方证券 | - | 2,081.85 | 2,081.85 |
| 合计 | - | 181,210.34 | 181,210.34 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 东方红汇利债券A | 东方红汇利债券C | 合计 |
| 上海东方证券资产管理有限公司 | - | 7,898.29 | 7,898.29 |
| 工商银行 | - | 8,799.33 | 8,799.33 |
| 东方证券 | - | 501.41 | 501.41 |
| 合计 | - | 17,199.03 | 17,199.03 |

注：1、本基金 C 类份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%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×0.40%÷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。

2、本期指2017年1月1日－6月30日，上年度可比期间指2016年6月13日－6月30日。

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未与关联方进行银行间同业市场债券（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<br>2017年1月1日至2017年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2016年6月13日（基金合同生效日）至2016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 |
| 工商银行 | 1,404,855.01 | 48,778.04 | 123,179,480.83 | 80,052.97 |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

2、本期指2017年1月1日－6月30日，上年度可比期间指2016年6月13日－6月30日。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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

本基金支付给东证期货的交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定， 以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。本基金本报告期末及上年度末无应付交易手续费余额。于2017年1月1日至2017年6月30日，本基金当期交易手续费支出390元（上年度可比期间2016年6月13日至2016年6月30日无交易手续费）。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，存出保证金不计息。于2017年6月30日，本基金的结算备付金余额为4,563,229.38元，无存出保证金余额（2016年12月31日：期货结算备付金余额为4,471,269.20，无存出保证金余额）。于2017年1月1日至2017年6月30日，本基金当期结算备付金利息收入16,376.45元（上年度可比期间2016年6月13日至2016年6月30日无结算备付金利息收入）。

本基金本报告期及上年度可比期间没有其他需作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2017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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金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

截至本报告期末2017年6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2017年6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177,200,000.00元，于2017年7月3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2017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136,535,157.08元，第二层次的余额为993,134,156.60元，无属于第三层次的余额。

于2016年12月31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117,965,529.65元，第二层次的余额为1,449,637,485.30元，无属于第三层次的余额。

（ii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值确定为第二层次。

（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2017年6月30日及2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

（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）增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税［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》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税［2017］2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税［2017］56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

### §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 | 109,649,963.63 | 9.31 |
| | 其中：股票 | 109,649,963.63 | 9.31 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,020,019,350.05 | 86.57 |
| | 其中：债券 | 998,949,350.05 | 84.78 |
| | 资产支持证券 | 21,070,000.00 | 1.79 |
| 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 | 29,712,158.86 | 2.52 |
| 7 | 其他各项资产 | 18,849,525.58 | 1.60 |
| 8 | 合计 | 1,178,230,998.12 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.2 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 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 77,962,030.78 | 7.83 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,184,000.00 | 1.32 |
| 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 | 2,148,732.85 | 0.22 |
| J | 金融业 | 15,182,200.00 | 1.52 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,173,000.00 | 0.12 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 109,649,963.63 | 11.01 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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 | 600426 | 华鲁恒升 | 1,312,939 | 15,413,903.86 | 1.55 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 580,000 | 12,522,200.00 | 1.26 |
| 3 | 600066 | 宇通客车 | 560,000 | 12,303,200.00 | 1.24 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 200,000 | 9,922,000.00 | 1.00 |
| 5 | 601012 | 隆基股份 | 550,000 | 9,405,000.00 | 0.94 |
| 6 | 600486 | 扬农化工 | 132,602 | 5,597,130.42 | 0.56 |
| 7 | 002311 | 海大集团 | 300,000 | 5,481,000.00 | 0.55 |
| 8 | 002470 | 金正大 | 700,000 | 5,271,000.00 | 0.53 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 220,000 | 5,260,200.00 | 0.53 |
| 10 | 603001 | 奥康国际 | 278,350 | 5,230,196.50 | 0.53 |

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 | 601668 | 中国建筑 | 14,399,034.08 | 1.04 |
| 2 | 600900 | 长江电力 | 10,645,344.16 | 0.77 |
| 3 | 600886 | 国投电力 | 10,509,548.00 | 0.76 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 10,260,000.00 | 0.74 |
| 5 | 600027 | 华电国际 | 8,740,552.00 | 0.63 |
| 6 | 600426 | 华鲁恒升 | 8,451,866.60 | 0.61 |
| 7 | 601111 | 中国国航 | 7,879,976.59 | 0.57 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 7,842,247.00 | 0.57 |
| 9 | 600029 | 南方航空 | 7,395,052.26 | 0.54 |
| 10 | 600115 | 东方航空 | 7,125,033.59 | 0.52 |
| 11 | 600489 | 中金黄金 | 6,636,158.00 | 0.48 |
| 12 | 000930 | 中粮生化 | 6,377,598.80 | 0.46 |
| 13 | 600585 | 海螺水泥 | 6,308,000.00 | 0.46 |
| 14 | 600491 | 龙元建设 | 6,177,320.00 | 0.45 |
| 15 | 600011 | 华能国际 | 5,904,000.00 | 0.43 |
| 16 | 300078 | 思创医惠 | 5,306,353.00 | 0.38 |
| 17 | 601601 | 中国太保 | 5,229,153.00 | 0.38 |
| 18 | 002311 | 海大集团 | 5,155,872.00 | 0.37 |
| 19 | 002470 | 金正大 | 4,984,789.00 | 0.36 |
| 20 | 600023 | 浙能电力 | 4,696,000.00 | 0.34 |

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 | 601668 | 中国建筑 | 15,346,725.12 | 1.11 |
| 2 | 002466 | 天齐锂业 | 13,188,243.45 | 0.96 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 11,664,317.16 | 0.85 |
| 4 | 600900 | 长江电力 | 10,924,478.00 | 0.79 |
| 5 | 600028 | 中国石化 | 10,522,000.00 | 0.76 |
| 6 | 601111 | 中国国航 | 9,066,881.04 | 0.66 |
| 7 | 002202 | 金风科技 | 8,838,269.45 | 0.64 |
| 8 | 600489 | 中金黄金 | 8,800,265.94 | 0.64 |
| 9 | 600029 | 南方航空 | 7,925,032.00 | 0.57 |
| 10 | 600886 | 国投电力 | 7,350,000.00 | 0.53 |
| 11 | 601600 | 中国铝业 | 7,044,393.51 | 0.51 |
| 12 | 600547 | 山东黄金 | 6,929,909.96 | 0.50 |
| 13 | 600993 | 马应龙 | 6,847,436.00 | 0.50 |
| 14 | 600115 | 东方航空 | 6,601,446.00 | 0.48 |
| 15 | 600585 | 海螺水泥 | 6,543,064.00 | 0.47 |
| 16 | 600491 | 龙元建设 | 6,433,643.90 | 0.47 |
| 17 | 600660 | 福耀玻璃 | 6,402,607.00 | 0.46 |
| 18 | 601601 | 中国太保 | 6,278,579.00 | 0.46 |
| 19 | 000930 | 中粮生化 | 6,257,122.34 | 0.45 |
| 20 | 002074 | 国轩高科 | 6,200,326.04 | 0.45 |

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 | 206,740,973.09 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 247,584,005.85 |

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 | 142,213,000.00 | 14.28 |
| | 其中：政策性金融债 | 49,785,000.00 | 5.00 |
| 4 | 企业债券 | 780,406,156.60 | 78.38 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 26,885,193.45 | 2.70 |
| 8 | 同业存单 | 49,445,000.00 | 4.97 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 998,949,350.05 | 100.33 |

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 | 170204 | 17国开04 | 500,000 | 49,785,000.00 | 5.00 |
| 2 | 111710279 | 17兴业银行CD279 | 500,000 | 49,445,000.00 | 4.97 |
| 3 | 136754 | 16兵装03 | 500,000 | 48,310,000.00 | 4.85 |
| 4 | 136713 | 16康恩贝 | 500,000 | 48,265,000.00 | 4.85 |
| 5 | 112469 | 16涪陵02 | 400,000 | 38,240,000.00 | 3.84 |

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 | 1689247 | 16上和1A2 | 350,000 | 21,070,000.00 | 2.12 |

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国债期货交易情况说明

7.10.1本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

7.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | 75,900.00 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | - |

注：本基金本报告期末无国债期货持仓。

7.10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期国债期货投资在一定程度上对冲了利率波动的风险，符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金持有的招商银行（代码：600036）发行主体招商银行股份有限公司（以下简称“公司”），因其批量转让个人贷款，中国银行业监督管理委员会2017年03月29日对公司采取罚款50万元的行政处罚决定。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余九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 | 189,770.51 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 22,733.18 |
| 4 | 应收利息 | 17,326,034.31 |
| 5 | 应收申购款 | 1,310,987.58 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 18,849,525.58 |

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 | 110032 | 三一转债 | 11,066,220.00 | 1.11 |
| 2 | 110033 | 国贸转债 | 7,105,200.00 | 0.71 |
| 3 | 128010 | 顺昌转债 | 4,598,957.55 | 0.41 |

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不存在流通受限的情况。

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，投资组合报告中市值占净值比例的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 |
| 东方红汇利债券A | 2,326 | 326,229.14 | 429,491,972.94 | 56.60% | 329,317,013.89 | 43.40% |
| 东方红汇利债券C | 987 | 214,637.40 | 48,761,483.97 | 23.02% | 163,085,627.86 | 76.98% |
| 合计 | 3,313 | 292,984.03 | 478,253,456.91 | 49.27% | 492,402,641.75 | 50.73% |

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 | 东方红汇利债券A | 543,685.87 | 0.0716% |
| | 东方红汇利债券C | 170,171.49 | 0.0803% |
| | 合计 | 713,857.36 | 0.0735% |

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的情况

| 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 | 东方红汇利债券A | 0~10 |
| | 东方红汇利债券C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 东方红汇利债券A | 0 |
| | 东方红汇利债券C | 0 |
| | 合计 | 0 |

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东方红汇利债券A | 东方红汇利债券C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2016年6月13日）基金份额总额 | 229,831,167.58 | 227,581,549.91 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 977,500,761.22 | 402,472,405.70 |
| 本报告期基金总申购份额 | 46,727,334.43 | 1,863,278.20 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 265,419,108.82 | 192,488,572.07 |
| 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 | 758,808,986.83 | 211,847,111.83 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有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

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

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。

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有限公司。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。

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。

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 | 2 | 367,890,636.91 | 80.98% | 269,037.82 | 81.40% | - |
| 中泰证券 | 1 | 86,414,007.03 | 19.02% | 61,466.74 | 18.60% | - |

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、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格，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、本报告期内本基金租用交易单元的变更情况：新增中泰证券交易单元1个。

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 | 643,741,583.08 | 91.23% | 29,292,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 中泰证券 | 61,869,281.36 | 8.77% | - | - | - | - |

### §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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20170410-20170630 | 224,079,407.31 | - | - | 224,079,407.31 | 23.09 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金由于存在单一投资者份额集中度较高的情况，可能存在巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力；基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金份额集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。 | | | | | | | |

注：上表列示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，分级基金按总份额占比计算。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

上海东方证券资产管理有限公司
2017年8月28日