东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

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

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、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	东方红新动力混合
基金主代码	000480
前端交易代码	000480
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月28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	1,642,328,565.31份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握中国经济转型期的一些大趋势,深入挖掘隐藏在大趋势下的投资机会,严控风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以经济发展中的大趋势为投资主线,力求挖掘孕育在大趋势下的投资机会,实现基金资产的长期稳定增值。 管理人通过定性和半定量的比较大类资产之间的风险收益比,在符合基金合同的情况下,在大类资产之间做一个相对最优的配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。
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。

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 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号

§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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	247,698,820.77
本期利润	377,234,138.00
加权平均基金份额本期利润	0.2818
本期基金份额净值增长率	13.62%
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	1.0699
期末基金资产净值	3,768,093,514.39
期末基金份额净值	2.294

注:(1)本基金合同于2014 年1 月28 日生效。表中的"期末"均指报告期最后一日,即2017年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。

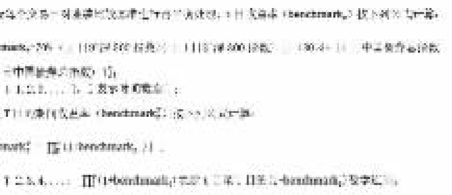
3.2 基金净值表现

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

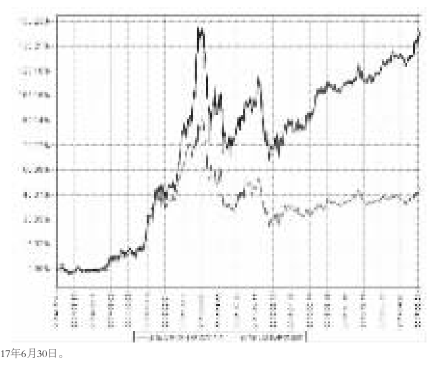
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.55%	0.56%	3.74%	0.47%	2.81%	0.09%
过去三个月	6.70%	0.49%	3.93%	0.44%	2.77%	0.05%
过去六个月	13.62%	0.50%	6.66%	0.41%	6.96%	0.09%
过去一年	23.87%	0.61%	9.95%	0.48%	13.92%	0.13%
过去三年	144.26%	1.52%	49.52%	1.23%	94.74%	0.29%
自基金合同生效起至今	144.02%	1.43%	48.74%	1.18%	95.28%	0.25%

注:1、本基金合同于2014年1月28日生效自基金合同生效日起至今指2014年1月28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=沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。



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:截止日期为2017年6月30日。

本基金建仓期6个月,即从2014年1月28日起至2014年7月27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、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金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		
周云	上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资部副总经理兼任东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、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。	2015年9月14日	-	9年	博士,曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资主办人,权益研究部高级研究员、投资主办人。现任上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资部副总经理兼任东方红新动力混合、东方红京东大数据混合、东方红睿满沪港深混合基金、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。
孙伟	东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016年1月22日	2017年4月12日	7年	硕士,曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员,上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、权益研究部高级研究员,现任东方红新动力混合基金经理。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

由于人民币汇率的企稳和A股纳入MSCI指数的预期,通过沪股通和深股通渠道北上的外资成为上半年为数不多的增量资金,这些资金青睐茅台、海康、美的、恒瑞等一线龙头,成为类似股票上涨的重要推动力量,加速了A股估值体系和海外成熟市场估值体系的对接;另一方面,这类股票的上涨也带动了国内趋势投资者的加入。两方面的力量导致上半年A股的市场风格分化的非常严重,上半年沪深300指数上涨10.78%,创业板指下跌7.34%,市值大的行业龙头有非常明显的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日,本基金份额净值为2.294元,份额累计净值为2.382元;本报告期基金份额净值增长率为13.62%,业绩比较基准收益率为6.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们依然维持"指数震荡,个股分化"的判断,随着一线白马的估值修复到了一定水平,二三线优质个股的性价比日益突出,这类股票的知名度没有那么高,外资研究覆盖难度相对较大,这类股票将是我们未来研究和投资的重点。投资思路上,我们坚持自下而上精选个股的策略,以3年的眼光筛选一批风险收益符合我们要求的个股,逐步将将部分前期上涨过多估值偏贵的标的换成滞涨的股票。

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、本基金的每份基金份额享有同等分配权;2、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配6次,每次 基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的25%;3、若《基金合同》生效不满3个月则可不进行收益分配;4、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;5、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;6、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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

本报告期,中国工商银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金的管理人——上海东方证券资产管理有限公司在东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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,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

本托管人依法对上海东方证券资产管理有限公司编制和披露的东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2017年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产:		
银行存款	898,547,933.12	17,994,966.45
结算备付金	129,533,771.53	87,555,822.97
存出保证金	567,032.33	300,031.22
交易性金融资产	2,750,625,403.72	1,512,129,214.98
其中:股票投资	2,750,625,403.72	1,512,129,214.98
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	750,200,000.00	311,000,000.00
应收证券清算款	-	6,994,041.57
应收利息	84,293.03	118,360.66
应收股利	-	-
应收申购款	14,285,099.64	4,959,358.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,543,843,533.37	1,941,051,796.50
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30日	上年度末 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	-	-
应付证券清算款	750,200,000.00	4,901,244.70
应付赎回款	16,637,995.61	9,880,918.13
应付管理人报酬	4,490,326.94	2,416,477.83
应付托管费	748,387.84	402,746.30
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,438,081.45	2,041,482.82
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	235,227.14	322,866.11
负债合计	775,750,018.98	19,965,735.89
所有者权益:		
实收基金	1,642,328,565.31	951,575,285.50
未分配利润	2,125,764,949.08	969,510,775.11
所有者权益合计	3,768,093,514.39	1,921,086,060.61
负债和所有者权益总计	4,543,843,533.37	1,941,051,796.50

注:(1) 本基金于 2014 年 1 月 28 日成立

(2)报告截止日 2017年6月30日,基金份额净值2.294元,基金份额总额1,642,328,565.31份。

6.2 利润表

会计主体:东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入	405,649,720.14	-64,463,069.37
1.利息收入	8,643,354.31	925,744.94
其中:存款利息收入	1,725,435.03	771,635.54
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	6,917,919.28	154,109.40
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	265,682,805.60	26,778,697.95
其中:股票投资收益	233,382,075.70	7,365,526.76
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	886,960.00
股利收益	32,300,729.90	18,526,211.19
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	129,535,317.23	-92,578,929.19
4. 汇兑收益 (损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,788,243.00	411,416.93
减:二、费用	28,415,582.14	11,955,529.03
1.管理人报酬	21,114,740.51	8,925,862.21
2.托管费	3,519,123.45	1,487,643.70
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,574,176.90	1,324,018.66
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	207,541.28	218,004.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	377,234,138.00	-76,418,598.40
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	377,234,138.00	-76,418,598.40

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

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 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)	951,575,285.50	969,510,775.11	1,921,086,060.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	377,234,138.00	377,234,138.00
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)	690,753,279.81	779,020,035.97	1,469,773,315.78
其中:1.基金申购款	1,033,459,749.29	1,175,976,587.73	2,209,436,337.02
2.基金赎回款	-342,706,469.48	-396,956,551.76	-739,663,021.24
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)	1,642,328,565.31	2,125,764,949.08	3,768,093,514.39

项目	上年度可比期间 2016年1月1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)	648,247,688.99	636,921,178.12	1,285,168,867.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-76,418,598.40	-76,418,598.40
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)	42,082,144.06	27,768,901.03	69,851,045.09
其中:1.基金申购款	144,908,166.15	106,155,578.88	251,063,745.03
2.基金赎回款	-102,826,022.09	-78,386,677.85	-181,212,699.94
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)	690,329,833.05	588,271,480.75	1,278,601,313.80

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

东方红新动力灵活配置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")《关于核准东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]1527 号文)核准,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《东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2014 年 1 月 28 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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2013年12月30日至2014年1月22日向社会公开募集, 扣除认购费后的有效认购资金1,144,927,618.60 元,利息转份额 443,550.47 元,募集规模为 1,145,371,169.07 份。上述募集资金已由立信会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红新动力灵活配置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,包括国内依法发行的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(含中小企业私募债)、中期票据、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%;本基金每个交易日日终在扣除股指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%;基金投资收益于新动力的股票不低于非现金基金资产的 80%。

本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

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》、《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

本基金本报告期内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、国家税务总局财税[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》、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、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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:以下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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1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	1,572,965,481.52	51.39%	363,294,246.57	35.81%

6.4.8.1.2 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1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	53,541,600,000.00	100.00%	1,945,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金在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 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	1,150,299.13	52.07%	2,842,329.43	82.67%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1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	265,680.83	2.75%	1,024,089.76	66.48%

注:1、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上海证券交易所买(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。

2、截至报告期末,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。

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,114,740.51	8,925,862.21
其中:支付销售机构的客户维护费	10,486,450.74	4,183,747.04

注:1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5%÷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。

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,519,123.45	1,487,643.70

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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。

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

本基金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

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1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	898,547,933.12	1,161,084.89	45,819,619.30	560,664.31

注: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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生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。于2017年6月30日,本基金无应付交易手续费余额(2015年12月31日:同)。于2017年上半年,本基金当期无交易手续费支出(2016年同期:无)。

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62,473,567.81元,无存出保证金余额(2016年12月31日:结算备付金62,246,817.02元,存出保证金无余额)。于2017年上半年,本基金当期结算备付金利息收入226,750.79元(2016同期:135,292.95元)。

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

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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末股票中不存在流通受限的情况。

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,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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2,750,501,720.62 元,第二层次的余额为123,683.10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1,478,747,792.75元,第二层次的余额为33,381,422.23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,确定相关股票和债券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),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》,本基金于2015年3月30日起采用第三方估值机构所独立提供的估值结果确定公允价值。

(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	2,750,625,403.72	60.54
	其中:股票	2,750,625,403.72	60.54
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	750,200,000.00	16.51
	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	1,028,081,704.65	22.63
7	其他各项资产	14,936,425.00	0.33
8	合计	4,543,843,533.37	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	133,808,252.00	3.55
B	采矿业	43,776,865.00	1.16
C	制造业	1,998,495,525.68	53.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,778.24	0.00
F	批发和零售业	195,859,535.69	5.20
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	7,639.62	0.00
J	金融业	327,819,293.49	8.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,613,106.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	43,206,408.00	1.15
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	2,750,625,403.72	73.00

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	600887	伊利股份	15,800,000	341,122,000.00	9.05
2	002470	金正大	36,200,715	272,591,383.95	7.23
3	601318	中国平安	5,335,200	264,679,272.00	7.02
4	600066	宇通客车	7,700,000	169,169,000.00	4.49
5	600267	海正药业	13,000,698	151,848,152.64	4.03
6	603001	奥康国际	7,953,238	149,441,342.02	3.97
7	600426	华鲁恒升	12,474,112	146,446,074.88	3.89
8	002041	登海种业	10,098,736	133,808,252.00	3.55
9	600976	健民集团	4,850,069	131,000,363.69	3.48
10	000333	美的集团	2,719,100	117,030,064.00	3.11

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	002470	金正大	269,929,288.34	14.05
2	601318	中国平安	222,944,558.80	11.61
3	600887	伊利股份	132,698,018.88	6.91
4	002041	登海种业	131,201,559.26	6.83
5	600267	海正药业	125,275,112.46	6.52
6	002202	金风科技	100,306,895.41	5.22
7	600976	健民集团	88,188,454.23	4.59
8	600426	华鲁恒升	85,787,520.74	4.47
9	603001	奥康国际	84,748,681.80	4.41
10	601933	永辉超市	79,004,809.14	4.11
11	600060	海信电器	70,781,619.64	3.68
12	300408	三环集团	60,685,912.32	3.16
13	600875	东方电气	47,194,085.77	2.46
14	002159	三特索道	45,443,835.94	2.37
15	601328	交通银行	44,514,777.00	2.32
16	601899	紫金矿业	42,733,896.75	2.22
17	000333	美的集团	39,152,830.42	2.04
18	600066	宇通客车	31,368,904.81	1.63
19	600970	中材国际	29,733,698.42	1.55
20	002734	利民股份	29,669,188.06	1.54

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	002415	海康威视	217,157,506.71	11.30
2	000651	格力电器	127,532,281.46	6.64
3	000858	五 粮 液	65,300,805.32	3.40
4	000538	云南白药	64,084,620.06	3.34
5	300408	三环集团	50,737,787.53	2.64
6	600104	上汽集团	45,211,144.35	2.35
7	600970	中材国际	39,704,709.86	2.07
8	601933	永辉超市	33,692,005.41	1.75
9	002475	立讯精密	32,191,079.71	1.68
10	002304	洋河股份	31,469,833.98	1.64
11	002311	海大集团	25,780,051.69	1.34
12	600886	国投电力	22,557,463.75	1.17
13	600297	广汇汽车	22,538,458.20	1.17
14	600600	青岛啤酒	21,221,220.16	1.10
15	601012	隆基股份	20,652,091.12	1.08
16	600030	中信证券	19,535,145.00	1.02
17	300058	蓝色光标	19,242,788.27	1.00
18	600251	冠农股份	17,576,228.40	0.91
19	000792	盐湖股份	17,282,160.40	0.90
20	601318	中国平安	15,690,472.46	0.82

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	1,969,175,553.27
卖出股票收入(成交)总额	1,093,596,757.46

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末进行贵金属投资。

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

本基金本报告期末进行权证投资。

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

本基金本报告期末无进行股指期货持仓。

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。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

根据基金合同的约定,本基金不投资国债期货。

7.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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	567,032.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	84,293.03
5	应收申购款	14,285,099.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,936,425.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

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

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§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

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
102,464	16,028.35	64,310,452.06	3.92%	1,578,018,113.25	96.08%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,549,898.17	0.0944%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年1月28日)基金份额总额	1,145,371,169.07
本报告期期初基金份额总额	951,575,285.50
本报告期基金总申购份额	1,033,459,749.29
减:本报告期基金总赎回份额	342,706,469.48
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	1,642,328,565.31

注:总申购份额含红利再投份额(本基金暂未开通基金转换业务)。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

报告期内基金投资策略无改变。

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

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	3	1,572,965,481.52	51.39%	1,150,299.13	52.07%	-
光大证券	1	937,659,031.51	30.64%	666,958.94	30.19%	-
方正证券	1	284,287,419.06	9.29%	202,738.82	9.18%	-
中金公司	1	259,957,989.32	8.49%	184,909.96	8.37%	-
国金证券	1	5,751,036.00	0.19%	4,090.51	0.19%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注: 1. 本报告期内本基金租用交易单元的变更情况:新增光大证券、中信证券2个交易单元。

2、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。

3、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。

4、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。

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	-	-	53,541,600,000.00	100.00%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

上海东方证券资产管理有限公司

2017年8月28日