

# 东方合家保本混合型证券投资基金

## 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十四日

## § 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。

基金托管人中国建设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       | 东方合家保本混合         |
| 基金主代码      | 002648           |
| 前端交易代码     | 002648           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2016 年 6 月 16 日  |
| 基金管理人      | 东方基金管理有限责任公司     |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 595,001,111.76 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                        |
|--------|------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 运用保本策略，通过动态调整股票与债券等资产的组合，在有效控制投资风险、确保保本周期内本金安全的前提下，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，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 | 两年期银行定期存款收益率（税后）                                                       |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金和债券型基金，但低于股票型基金、非保本混合型基金，属于低风险水平的投资品种。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                          | 基金托管人                |
|---------|------|--------------------------------|----------------------|
| 名称      |      | 东方基金管理有限责任公司                   | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李景岩                            | 田青                   |
|         | 联系电话 | 010-66295888                   | 010-67595003         |
|         | 电子邮箱 | xxpl@orient-fund.com           | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话  |      | 010-66578578 或<br>400-628-5888 | 010-67595096         |
| 传真      |      | 010-66578700                   | 010-66275853         |

## 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<br>http://www.df5888.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

| 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       | 205,660.92                            |
| 本期利润          | 14,897,897.42                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0226                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.31%                                 |
| 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  | 0.0005                                |
| 期末基金资产净值      | 603,138,911.70                        |
| 期末基金份额净值      | 1.0137                                |

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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

### 3.2 基金净值表现

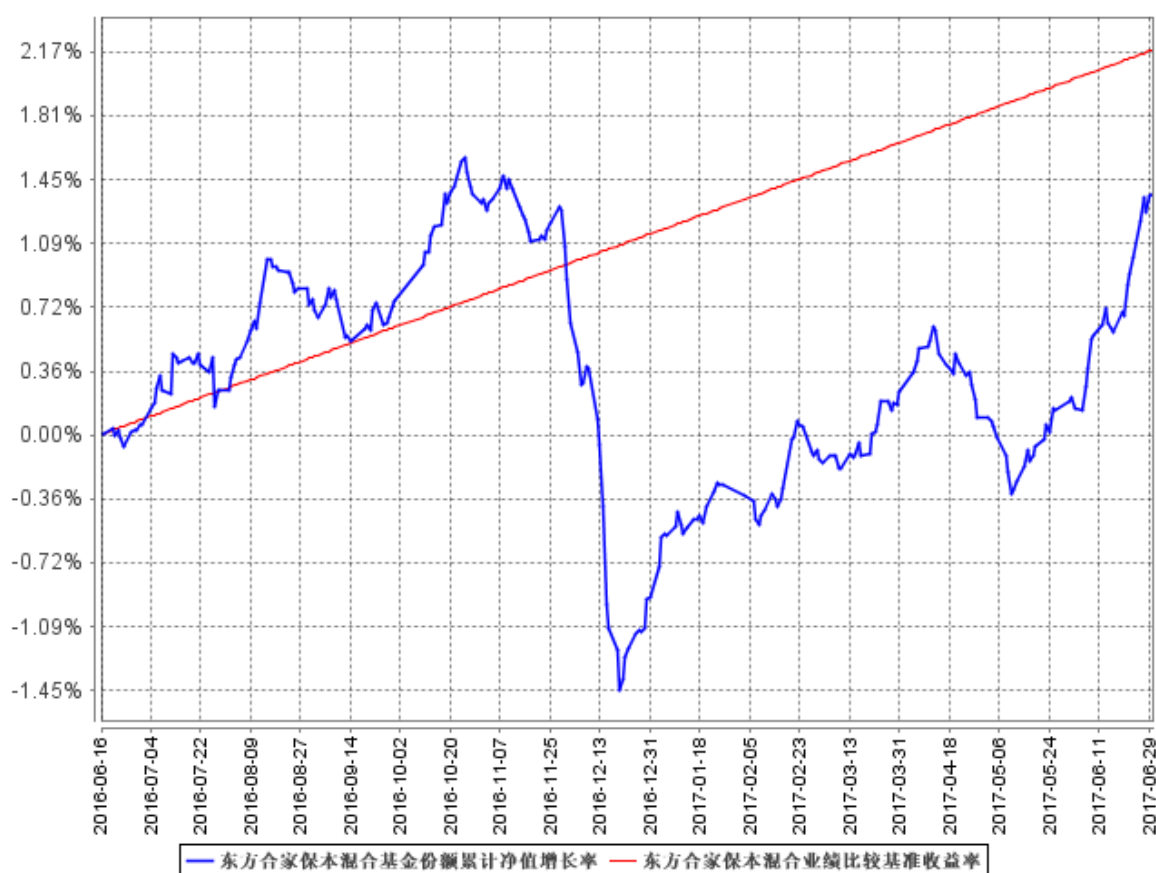
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 1.18%    | 0.08%       | 0.17%      | 0.00%         | 1.01% | 0.08% |

|            |       |       |       |       |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月      | 1.13% | 0.08% | 0.52% | 0.01% | 0.61%  | 0.07% |
| 过去六个月      | 2.31% | 0.08% | 1.04% | 0.01% | 1.27%  | 0.07% |
| 过去一年       | 1.31% | 0.10% | 2.10% | 0.01% | -0.79% | 0.09% |
| 过去三年       | 1.37% | 0.09% | 2.18% | 0.01% | -0.81% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.37% | 0.09% | 2.18% | 0.01% | -0.81% | 0.08% |

### 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

东方合家保本混合基金份额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：本基金基金合同于 2016 年 6 月 16 日生效，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 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

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 2017 年 6 月 30 日，本公司注册资本 2 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 12800 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 5400 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 1800 万元，占公司注册资本的 9%。截至 2017 年 6 月 30 日，本公司管理 44 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、东方成长收益平衡混合型开放式证券投资基金、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、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、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方新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、东方稳定增利债券型证券投资基金、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、东方荣家保本混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方合家保本混合型证券投资基金、东方臻馨债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方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、东方民丰回报赢安定期开放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、东方价值挖掘灵活配置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、东方臻悦纯债债券型证券投资基金。

#### 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            |        |                                                 |
| 李仆（先生） | 本基金基金经理、公司总经理 | 2016 年 6 月 16 日 | 2017 年 3 月 24 日 | 17 年   | 17 年证券从业经历，曾任宝钢集团财务有限责任公司投资经理、宝钢集团有限公司投资经理、宝岛（香 |

|        |              |                 |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------|--------------|-----------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 助理、投资决策委员会委员 |                 |   |     | 港) 贸易有限公司投资部总经理、华宝信托有限责任公司资管部投资副总监、信诚基金管理有限公司基金经理。2014 年 2 月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任公司总经理助理、投资决策委员会委员、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型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、东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方臻馨债券型证券投资基金基金经理、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |
| 王然(女士) | 本基金经理        | 2016 年 6 月 16 日 | - | 9 年 | 北京交通大学产业经济学硕士, 9 年证券从业经历, 曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010 年 4 月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员, 东方策略成长股票型开放式证券投资基金(于 2015 年 8 月 7 日更名为东方策略成长混合型开放式证券投资基金)基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金(于 2015 年 8 月 7 日更名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证券投资基金）基金经理，现任东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金经理、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、东方荣家保本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、东方合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。 |
| 吴 萍 萍<br>(女士) | 本 基 金<br>基 金 经<br>理 | 2016 年 6 月 16<br>日 | - | 6 年 | 中国人民大学应用经济学硕士，6 年证券从业经历，曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015 年 11 月加盟东方基金，曾任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理，现任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方添益债券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、东方永兴 18 个月定期                                         |

|  |  |  |  |  |                                      |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------|

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方合家保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内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。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；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

从基本面来看，2017 年上半年经济表现平稳、韧性较强。具体而言，房地产开发投资增长受益于三四线去库存、棚改货币化，基建投资增长受益于年初信贷投放规模大、财政支出节奏快；实体经济在此带动下出现了一定程度的库存去化，从而带动 6 月以来补库存迹象，此外 PMI 连续保持在 50 以上的景气区间，印证了内需表现较好。

从政策面来看，2017 年上半年各金融监管机构密集发布文件，去杠杆思路明确，央行方面，一季度先后上调 OMO、MLF 等政策利率，二季度以来通过公开市场操作紧控流动性投放，贯穿着“稳健中性”的货币政策思路。在此背景下，2017 年上半年债券收益率震荡上行，十年国开债较年初上行近 50BP。较强的基本面制约了债券收益率下行，市场关注的焦点主要聚焦于金融监管政策及流动性。

报告期内，股票方面，市场在 3000-3300 点之间宽幅震荡，1 季度和 2 季度末的两波上涨主要是周期品短周期库存调整带来的，其中还叠加了三四线房地产销售超预期带来的相关产业链的数据超预期行情。整体上看，上证综指上涨 2.86%、深圳成指上涨 3.46%、创业板指下跌 7.34%，分化明显；而沪深 300 表现明显好于其他指数，上涨 10.78%，主要是绩优行业龙头有较好的表现，特别是一些消费品行业的龙头标的受到资金的追捧，在 6 月 A 股 222 只标的加入 MSCI 之后更有突出的表现。

从整个上半年的情况看，基本符合我们年初的判断，即在三四线房地产去库存的背景下，家电、家具等相关产业链均有较好的增长表现，使得行业龙头业绩靓丽带动股价上涨。另外 2 季度以来，人民币汇率走稳，海外市场也有较好的表现，A 股纳入 MSCI 如期兑现，使得龙头白马股加速上行。wind 数据显示，上半年银行、建筑装饰、电子、家电、轻工等行业涨幅明显，而农业、纺织服装、商业零售、传媒、房地产行业跌幅居前。

基于以上的判断，本基金在报告期内仍然维持前期的配置策略，以低估值、高分红、业绩稳健的金融、食品、电力、交运、建筑、医药等行业龙头为重点配置对象，少量仓位进行主题投资的波段操作，同时并积极参与新股询价与申购。上半年，本基金在报告期内实现了较好的正收益，

显著超越比较基准，并在同类可比基金中排名靠前。债市方面，债市波动较大，本基金操作灵活，以谨慎防御策略为主，持仓主要以存单、高评级信用债为主，将组合久期保持在中性偏短水平，并保持较低仓位，警惕流动性风险、信用风险，实现风险与收益的平衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日，本基金净值增长率为 2.31%，业绩比较基准收益率为 1.04%，高于业绩比较基准 1.27%。

### 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 3 季度，美国经济总体稳定，缩表与加息路径较明确；欧洲经济复苏加速，开始考虑宽松政策的退出；日本经济温和复苏，通胀有所上升，将维持货币宽松不变；新兴经济体上半年复苏好转，下半年挑战仍存。整体看，全球经济复苏为我国提供了良好的外部环境，非美货币走强缓解了人民币兑美元贬值压力，资本流出明显放缓。

国内市场方面，预计国内经济呈现前高后低的态势，增速小幅下台阶，低而不崩，资金约束或将成为基建、地产投资大幅增长的桎梏，预计出口、制造业投资仍保持在相对景气区间，受益于外需回暖、库存周期、价格回暖等因素。货币增速放缓、金融加强监管特别是积极落实第五次全国金融工作会议精神，重点引导金融资源回归服务实体经济本源。财政政策推进减费降税，防范地方债务风险，助力供给侧改革；货币政策保持稳健中性，强化监管的统一性与协调性。房地产没有想象中那么差，库存去化非常快，下半年开工没那么悲观。3 月份 87 号文打压了国内基建，特别是 PPP，但是各地方又出台了鼓励一带一路相关项目的指导意见。供给侧改革仍是持续推进的重点，2016 年是煤炭，2017 年是钢铁，下半年要看电解铝的供给收缩。未来制造业的重点是产能整合、技术升级和环保对制造业的要求不断提升。另外，消费相关行业仍可关注 CPI 上行以及年底的估值切换。整体上看，第 3 季度市场震荡加剧、结构继续分化，绩优行业龙头仍受追捧。

对于 2017 年下半年债券市场而言，短期来看，央行维稳资金面、但金融去杠杆的大背景下利率中枢难以出现大幅下移，三季度仍面临较大规模的同业存单到期、委外收缩和赎回压力；长期来看，随着经济缓慢下台阶、实体融资压力加大，政策或适度呵护，债券可期待基本面重新转弱后的机会。

未来，本基金将继续以持有中短久期、高收益的信用债为主，以获得稳定的票息收入，实现绝对收益。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

根据中国证监会公告【2008】38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的要求，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”），成员由分管运营副总经理、分管投研副总经理、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，本基金本报告期末未进行利润分配。

## 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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或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，中国建设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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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。

## § 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：东方合家保本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<br>2017 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |                                |                                  |
| 银行存款            | 836,192.31                     | 5,258,115.68                     |
| 结算备付金           | 60,507.30                      | 2,610,267.45                     |
| 存出保证金           | 40,911.35                      | 79,786.42                        |
| 交易性金融资产         | 661,201,174.79                 | 474,813,975.15                   |
| 其中：股票投资         | 63,214,074.79                  | 54,775,975.15                    |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 597,987,100.00                 | 420,038,000.00                   |
| 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        | -                              | 220,600,890.90                   |
| 应收证券清算款         | -                              | 2,882,062.75                     |
| 应收利息            | 5,700,946.39                   | 9,551,339.26                     |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| 资产总计            | 667,839,732.14                 | 715,796,437.61                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |                                |                                  |
| 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       | 62,369,768.81                  | 19,999,872.50                    |
| 应付证券清算款         | -                              | 775,546.98                       |
| 应付赎回款           | 1,272,362.88                   | 1,657,988.19                     |
| 应付管理人报酬         | 663,781.77                     | 775,482.19                       |
| 应付托管费           | 102,120.26                     | 119,304.92                       |
| 应付销售服务费         | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 156,083.71                     | 149,992.67                       |
| 应交税费            | -                              | -                                |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 应付利息          | 10,329.67      | 1,531.32       |
| 应付利润          | -              | -              |
| 递延所得税负债       | -              | -              |
| 其他负债          | 126,373.34     | 106,248.66     |
| 负债合计          | 64,700,820.44  | 23,585,967.43  |
| <b>所有者权益：</b> |                |                |
| 实收基金          | 595,001,111.76 | 698,631,151.50 |
| 未分配利润         | 8,137,799.94   | -6,420,681.32  |
| 所有者权益合计       | 603,138,911.70 | 692,210,470.18 |
| 负债和所有者权益总计    | 667,839,732.14 | 715,796,437.61 |

①报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0137 元，基金份额总额 595,001,111.76 份。

②本基金基金合同于 2016 年 6 月 16 日生效，上年度为不完整会计年度，下同。

## 6.2 利润表

会计主体：东方合家保本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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 6 月 16 日(基金合同生<br>效日)至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | 20,223,226.24                            | 958,374.80                                               |
| 1.利息收入                | 15,373,235.20                            | 914,598.37                                               |
| 其中：存款利息收入             | 350,152.92                               | 668,298.60                                               |
| 债券利息收入                | 13,231,192.80                            | 6,722.63                                                 |
| 资产支持证券利息收入            | -                                        | -                                                        |
| 买入返售金融资产收入            | 1,791,889.48                             | 239,577.14                                               |
| 其他利息收入                | -                                        | -                                                        |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | -9,951,460.59                            | -108,632.00                                              |
| 其中：股票投资收益             | 4,097,825.28                             | -148,632.00                                              |
| 基金投资收益                | -                                        | -                                                        |
| 债券投资收益                | -15,179,999.29                           | -                                                        |
| 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                  | 1,130,713.42                             | 40,000.00                                                |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 14,692,236.50                            | 152,408.43                                               |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                        | -                                                        |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 109,215.13                               | -                                                        |

|                     |               |            |
|---------------------|---------------|------------|
| 减：二、费用              | 5,325,328.82  | 498,483.92 |
| 1. 管理人报酬            | 4,264,022.04  | 397,090.72 |
| 2. 托管费              | 656,003.43    | 61,090.87  |
| 3. 销售服务费            | —             | —          |
| 4. 交易费用             | 119,043.33    | 27,175.06  |
| 5. 利息支出             | 131,078.98    | —          |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | 131,078.98    | —          |
| 6. 其他费用             | 155,181.04    | 13,127.27  |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 14,897,897.42 | 459,890.88 |
| 减：所得税费用             | —             | —          |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | 14,897,897.42 | 459,890.88 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方合家保本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<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）                        | 698,631,151.50                        | -6,420,681.32 | 692,210,470.18  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | —                                     | 14,897,897.42 | 14,897,897.42   |
| 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）      | -103,630,039.74                       | -339,416.16   | -103,969,455.90 |
| 其中：1.基金申购款                             | 183,741.41                            | 114.32        | 183,855.73      |
| 2.基金赎回款                                | -103,813,781.15                       | -339,530.48   | -104,153,311.63 |
| 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）                        | 595,001,111.76                        | 8,137,799.94  | 603,138,911.70  |

| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2016 年 6 月 16 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)                        | 798,540,221.70                                       | -          | 798,540,221.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)              | -                                                    | 459,890.88 | 459,890.88     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(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)                        | 798,540,221.70                                       | 459,890.88 | 799,000,112.58 |

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:

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>刘鸿鹏 | _____<br>刘鸿鹏 | _____<br>肖向辉 |
| 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

东方合家保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据 2016 年 4 月 6 日中国证监会《关于准予东方合家保本混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]688 号)的核准,由基金发起人东方基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方合家保本混合型证券投资基金基金合同》自 2016 年 5 月 3 日至 2016 年 6 月 8 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 798,014,663.92 元人民币,业经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)“瑞华验字[2016]第 01300015 号”验资报告验证。经向中国证监会备案,《东方合家保本混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 798,540,221.70 份基金单位,其中认购资金利息折合 525,557.78

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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和的有关规定，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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、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。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照中国财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）及应用指南、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》、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内容与格式准则第 3 号—半年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》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 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【2002】128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 04 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、《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[2015]101 号及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

1. 以发行基金方式募集资金, 不属于营业税征收范围, 不缴纳营业税。
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, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳营业税和企业所得税。
3. 基金取得的股票股息、红利收入, 自 2015 年 9 月 8 日起, 基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 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; 上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖, 自 2008 年 09 月 19 日起, 由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税。
6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价, 暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

### 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

本报告期内不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。

### 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            |
|--------------|--------------------|
| 东北证券股份有限公司   | 本基金管理人股东、销售机构      |
| 东方基金管理有限责任公司 | 本基金管理人、注册登记机构、直销机构 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 本基金托管人、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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8.1 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 16 日 (基金合同生效日) 至<br>2016 年 6 月 30 日 |                  |
|------------|---------------------------------------|------------------|-----------------------------------------------------------|------------------|
|            | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                                                      | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 东北证券股份有限公司 | -                                     | -                | 11,364,869.81                                             | 44.54%           |

##### 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 16 日 (基金合同生效日) 至<br>2016 年 6 月 30 日 |                  |
|------------|---------------------------------------|------------------|-----------------------------------------------------------|------------------|
|            | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                                                      | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 东北证券股份有限公司 | 236,334,048.95                        | 91.49%           | 8,558,816.98                                              | 100.00%          |

##### 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 16 日 (基金合同生效日) 至<br>2016 年 6 月 30 日 |                        |
|-------|---------------------------------------|--------------------|-----------------------------------------------------------|------------------------|
|       | 回购成交金额                                | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 | 回购成交金额                                                    | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比例 |

|          |   |   |                  |         |
|----------|---|---|------------------|---------|
| 东北证券股份有限 | - | - | 1,842,300,000.00 | 100.00% |
|----------|---|---|------------------|---------|

#### 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<br>佣金                                  | 占当期佣金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 东北证券股份有限<br>公司 | -                                         | -              | 30,194.79 | 21.62%           |
| 关联方名称          | 上年度可比期间<br>2016年6月16日(基金合同生效日)至2016年6月30日 |                |           |                  |
|                | 当期<br>佣金                                  | 占当期佣金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 东北证券股份有限<br>公司 | 10,584.35                                 | 44.54%         | 10,584.35 | 44.54%           |

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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

#### 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<br>30日 | 上年度可比期间<br>2016年6月16日(基金合同生效日)<br>至2016年6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付<br>的管理费  | 4,264,022.04                   | 397,090.72                                    |
| 其中：支付销售机构的客<br>户维护费 | 2,337,287.09                   | 224,445.85                                    |

注：①计提标准：本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的 1.30%年费率计提。管理费

的计算方法如下：

$$H = E \times 1.30\% \div \text{当年天数}$$

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

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 6 月 16 日 (基金合同生效日)<br>至 2016 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 656,003.43                               | 61,090.87                                                 |

注：①计提标准：本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 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，均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均未投资本基金。

#### 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 16 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    |
| 中国建设银行股份有限公司 | 836,192.31                            | 20,533.45 | 40,807,380.64                                          | 84,965.22 |

#### 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。

#### 6.4.9 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 |
| 603617              | 君禾股份 | 2017 年 6 月 27 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

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

#### 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 06 月 30 日止，本基金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 62,369,768.81 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称              | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|-------------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 111799664 | 17 南京银行 CD121     | 2017 年 7 月 3 日 | 95.55  | 130,000 | 12,421,500.00 |
| 111698187 | 16 广州农村商业银行 CD130 | 2017 年 7 月 3 日 | 96.69  | 500,000 | 48,345,000.00 |
| 合计        |                   |                |        | 630,000 | 60,766,500.00 |

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 06 月 30 日止, 本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本半年度报告报出日, 本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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               | 63,214,074.79  | 9.47          |
|    | 其中: 股票             | 63,214,074.79  | 9.47          |
| 2  | 固定收益投资             | 597,987,100.00 | 89.54         |
|    | 其中: 债券             | 597,987,100.00 | 89.54         |
|    | 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           | -              | -             |
|    | 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       | 896,699.61     | 0.13          |
| 7  | 其他各项资产             | 5,741,857.74   | 0.86          |
| 8  | 合计                 | 667,839,732.14 | 100.00        |

### 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              | 37,398,774.06 | 6.20          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,563,300.73  | 0.76          |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业             | -             | -     |
| F | 批发和零售业          | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 7,220,000.00  | 1.20  |
| H | 住宿和餐饮业          | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | -             | -     |
| J | 金融业             | 8,548,500.00  | 1.42  |
| K | 房地产业            | 5,483,500.00  | 0.91  |
| 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       | -             | -     |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 63,214,074.79 | 10.48 |

### 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 | 370,000 | 7,988,300.00 | 1.32         |
| 2  | 600104 | 上汽集团 | 250,000 | 7,762,500.00 | 1.29         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 300,000 | 7,173,000.00 | 1.19         |
| 4  | 600688 | 上海石化 | 950,000 | 6,279,500.00 | 1.04         |
| 5  | 600048 | 保利地产 | 550,000 | 5,483,500.00 | 0.91         |
| 6  | 600350 | 山东高速 | 800,000 | 4,960,000.00 | 0.82         |
| 7  | 600452 | 涪陵电力 | 99,919  | 4,563,300.73 | 0.76         |
| 8  | 600519 | 贵州茅台 | 9,000   | 4,246,650.00 | 0.70         |
| 9  | 603866 | 桃李面包 | 110,000 | 3,913,800.00 | 0.65         |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药 | 60,000  | 3,035,400.00 | 0.50         |

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  | 600104 | 上汽集团 | 7,331,538.30 | 1.06           |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 5,472,300.00 | 0.79           |
| 3  | 601333 | 广深铁路 | 5,434,285.00 | 0.79           |
| 4  | 600048 | 保利地产 | 5,279,997.00 | 0.76           |
| 5  | 601857 | 中国石油 | 4,189,681.32 | 0.61           |
| 6  | 600298 | 安琪酵母 | 2,139,811.40 | 0.31           |
| 7  | 601169 | 北京银行 | 1,501,266.00 | 0.22           |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 1,239,959.00 | 0.18           |
| 9  | 600688 | 上海石化 | 987,000.00   | 0.14           |
| 10 | 603626 | 科森科技 | 47,030.75    | 0.01           |
| 11 | 603768 | 常青股份 | 44,961.60    | 0.01           |
| 12 | 603630 | 拉芳家化 | 36,504.15    | 0.01           |
| 13 | 603717 | 天域生态 | 36,428.70    | 0.01           |
| 14 | 603345 | 安井食品 | 35,884.24    | 0.01           |
| 15 | 603801 | 志邦股份 | 32,998.82    | 0.00           |
| 16 | 603639 | 海利尔  | 30,089.70    | 0.00           |
| 17 | 603665 | 康隆达  | 25,359.00    | 0.00           |
| 18 | 603615 | 茶花股份 | 24,398.55    | 0.00           |
| 19 | 603043 | 广州酒家 | 23,855.80    | 0.00           |
| 20 | 603238 | 诺邦股份 | 23,292.50    | 0.00           |

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”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。

### 7.4.2 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  | 000858 | 五 粮 液 | 4,350,504.00 | 0.63 |
| 2  | 600298 | 安琪酵母  | 4,314,005.12 | 0.62 |
| 3  | 601857 | 中国石油  | 4,164,475.00 | 0.60 |
| 4  | 600872 | 中炬高新  | 3,452,084.36 | 0.50 |
| 5  | 600808 | 马钢股份  | 3,361,343.00 | 0.49 |
| 6  | 000902 | 新洋丰   | 3,332,060.40 | 0.48 |
| 7  | 601333 | 广深铁路  | 2,675,000.00 | 0.39 |
| 8  | 600519 | 贵州茅台  | 2,669,313.00 | 0.39 |
| 9  | 600309 | 万华化学  | 2,332,169.00 | 0.34 |
| 10 | 600104 | 上汽集团  | 1,460,352.28 | 0.21 |
| 11 | 002570 | 贝因美   | 1,310,285.00 | 0.19 |
| 12 | 603866 | 桃李面包  | 848,370.00   | 0.12 |
| 13 | 601375 | 中原证券  | 236,250.75   | 0.03 |
| 14 | 603630 | 拉芳家化  | 142,820.75   | 0.02 |
| 15 | 603345 | 安井食品  | 137,226.80   | 0.02 |
| 16 | 603626 | 科森科技  | 112,524.50   | 0.02 |
| 17 | 603717 | 天域生态  | 110,506.20   | 0.02 |
| 18 | 603768 | 常青股份  | 109,924.50   | 0.02 |
| 19 | 603665 | 康隆达   | 91,245.00    | 0.01 |
| 20 | 603138 | 海量数据  | 90,310.40    | 0.01 |

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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 | 34,065,339.06 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 36,318,245.47 |

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（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      | 34,867,500.00  | 5.78  |
|    | 其中：政策性金融债 | 34,867,500.00  | 5.78  |
| 4  | 企业债券      | 19,556,000.00  | 3.24  |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -     |
| 6  | 中期票据      | 272,106,000.00 | 45.11 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 220,600.00     | 0.04  |
| 8  | 同业存单      | 271,237,000.00 | 44.97 |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 597,987,100.00 | 99.15 |

## 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  | 111799664 | 17 南京银行 CD121     | 1,000,000 | 95,550,000.00 | 15.84        |
| 2  | 111698187 | 16 广州农村商业银行 CD130 | 500,000   | 48,345,000.00 | 8.02         |
| 3  | 1382234   | 13 鄂联投 MTN1       | 400,000   | 40,252,000.00 | 6.67         |
| 4  | 101356005 | 13 渝两江 MTN001     | 300,000   | 30,846,000.00 | 5.11         |
| 5  | 101453009 | 14 铁道 MTN001      | 300,000   | 30,723,000.00 | 5.09         |

## 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股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发现存在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

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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   | 40,911.35    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 5,700,946.39 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |

|   |      |              |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | -            |
| 8 | 其他   | -            |
| 9 | 合计   | 5,741,857.74 |

#### 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换债券。

#### 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的情况。

### § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 4,975        | 119,598.21    | 3,475,747.68 | 0.58%      | 591,525,364.08 | 99.42%     |

#### 8.3 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 | 0.99      | 0.0000%  |

#### 8.4 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 | 0                 |
| 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（ 2016 年 6 月 16 日 ）基金份额总额 | 798,540,221.70 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 698,631,151.50 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 183,741.41     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 103,813,781.15 |
| 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                     | 595,001,111.76 |

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未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未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内审计机构未发生变更。

## 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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 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 |    |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1      | 60,901,234.09 | 87.13%       | 56,717.35 | 87.13%     | -  |
| 中国中投证券有限责任公司 | 1      | 8,992,849.40  | 12.87%       | 8,375.03  | 12.87%     | -  |
| 华泰证券股份有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券股份有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券股份有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源证券有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券股份有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券股份有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券股份有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券有限责任公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券股份有限公司   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券股份有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |

注：（1）此处的佣金指本基金通过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

券商选择标准：①资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

(3) 本报告期内，本基金新增租用 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 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 21,987,700.70 | 8.51%        | 481,300,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 中国中投证券有限责任公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华泰证券股份有限公司   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 方正证券股份有限公司   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 招商证券股份有限公司   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 申万宏源证券有限公司   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国金证券股份有限公司   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东方证券股份有限公司   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国信证券股份有限公司   | -             | -            | -              | -              | -    | -            |

|                |                |        |   |   |   |   |
|----------------|----------------|--------|---|---|---|---|
| 华创证券有限<br>责任公司 | -              | -      | - | - | - | - |
| 东北证券股份<br>有限公司 | 236,334,048.95 | 91.49% | - | - | - | - |
| 安信证券股份<br>有限公司 | -              | -      | - | - | - | - |

## § 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

1

东方基金管理有限责任公司  
2017 年 8 月 24 日