

(上接 D97 版) (2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

3、报告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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5、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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

6、报告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

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

7、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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行股指期货投资。

(2)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。

10、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进行国债期货投资。

(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。

11、投资组合报告附注

(1)本基金持有的兴业银行(代码:601166)发行主体兴业银行股份有限公司(以下简称“公司”),因公司存在重大关联交易未按规定审查

且未向监管部门报告等十二项违法违规行为,由中国银保监会于2018年4月19日对公司作出行政处罚决定(银保监银罚决字[2018]1号),处以5870万元罚款。

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。

(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。

(3)其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有前十名股票未持有存在流通受限情况。

(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。

十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

1、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

东方红战略精选混合 C

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

2、自基金合同生效以来基金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2018年6月30日。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1.基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)销售服务费;

(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

(6)基金份额持有人大会费用;

(7)基金的证券、期货交易费用;

(8)基金的银行汇划费用;

(9)证券、期货账户开户费及账户维护费;

(10)投资港股通标的股票的相关费用;

(11)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式,于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式,于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

基金净值表

Table with columns: 基金代码, 基金名称, 基金份额净值, 基金资产净值, 基金净值增长率, 基金净值增长率基准, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率

Table with columns: 基金代码, 基金名称, 基金简称, 基金份额净值, 基金资产净值, 基金净值增长率, 基金净值增长率基准, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率

Table with columns: 基金代码, 基金名称, 基金简称, 基金份额净值, 基金资产净值, 基金净值增长率, 基金净值增长率基准, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率

(3)基金销售服务费

本基金C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额净值的0.4%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 × 0.4% × 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。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式,于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付,支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述基金费用的种类中第4—11项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(二)与基金销售有关的费用

1.申购费率

(1)投资人申购A类基金份额时,需交纳申购费用。

本基金对通过基金管理人直销中心申购A类份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

通过基金管理人直销中心申购A类份额的养老金客户的申购费率如下:

Table with 2 columns: 申购金额(M), 费率

其他投资者申购本基金A类份额的申购费率如下:

Table with 2 columns: 申购金额(M), 费率

(2)C类份额的申购费

本基金C类份额不收取申购费,收取销售服务费。

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2.赎回费率

本基金的赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有单笔赎回,适用费率按单笔计算。具体如下:

Table with 2 columns: 份额持有时间(L), 适用赎回费率

赎回费用由基金赎回人承担。C类份额赎回时,C类份额的赎回费将全额归入基金财产;A类份额赎回时,对份额持续持有时间小于30日的,赎回费用全部归基金财产,对份额持续持有时间大于等于30日小于3个月的,赎回费用总额的75%归基金财产,对份额持续持有时间大于3个月但小于6个月的,赎回费用总额的50%归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

3.基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人应在调整费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定,在指定媒介公告。

4.当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规及监管部门、自律组织的规定,具体见基金管理人届时的相关公告。

5.基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1.基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2.基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3.《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。

调整基金管理费率、基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

(五)基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规执行。

基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十四、对招募说明书更新部分的说明

管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、“重要提示”部分更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、“三、基金管理人”部分对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。

3、“四、基金托管人”部分对基金托管人概况、主要人员情况、基金托管业务经营情况的内容进行了更新。

4、“五、相关服务机构”部分对基金销售机构的信息进行了更新。

5、“九、基金的投资”部分更新了本基金投资组合报告,内容截止至2018年6月30日。

6、更新“十二、基金的投资”,内容截止至2018年6月30日。

7、更新“十二、其他应披露事项”,内容为报告期内披露的本基金其他相关事项。

上海东方证券资产管理有限公司 二〇一八年十月九日