

东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:东方阿尔法基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	东方阿尔法精选混合	
基金主代码	005358	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月08日	
基金管理人	东方阿尔法基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,687,945,966.47份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C
下属分级基金的交易代码	005358	005359
报告期末下属分级基金的份额总额	968,486,829.93份	719,459,136.54份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础之上，通过灵活、主动的投资管理方式力求实现组合资产的稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要有以下9个方面内容： 1、大类资产配置策略 基金管理人将根据国内外宏观经济情况、国内外证券市场估值水平阶段性不断调整权益类资产和其他资产之间的大类资产配置比例。 2、个股优选策略 基金管理人将采用定量分析与定性分析相结合的方式对上市公司进行分析，建立备选股票池。并以备选股票池成份股未来两年的PE衡量动态性价比作为选择其进入投资组合的重要依据。 3、港股投资策略 本基金港股投资将重点关注A股稀缺性行业个股、A股缺乏投资标的行业、具有持续领先优势或核心竞争

	力的企业、符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股以及与A股同类公司相比具有估值优势的公司。 4、债券类资产投资策略 本基金的债券投资将采取较为积极的策略，通过利率预测分析、收益率曲线变动分析、债券信用分析、收益率利差分析等，研判各类属固定收益类资产的风险趋势与收益预期，精选个券进行投资。 5、权证投资策略 采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资的价值基准，并根据权证标的股票基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证趋势投资。 6、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。 7、融资买入股票策略 本基金将根据融资买入股票成本以及其他投资工具收益率综合评估是否采用融资方式买入股票。 8、国债期货的投资策略 基金管理人将结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。 9、中小企业私募债券投资策略 本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤，重点分析发行主体的公司背景、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流水平等诸多因素，采用数量化方法对主体所发行债券进行打分和投资价值评估，选择发行主体资质优良，估值合理且流通相对充分的品种进行适度投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中证综合债券指数收

	益率×40%+恒生指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	东方阿尔法基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曾健
	联系电话	0755-21872901
	电子邮箱	service@dfa66.com
客户服务电话	400-930-6677	95555
传真	0755-21872902	0755-83195201
注册地址	广东省深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦西区23楼BC单元	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518034	518040
法定代表人	刘明	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dfa66.com
基金半年度报告备置地点	广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦西区23楼BC单元

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

金融运营服务机构	招商证券股份有限公司	广东省深圳市南山区高新南九道9号金地威新软件科技园6号楼
----------	------------	------------------------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C
本期已实现收益	5,127,600.51	1,437,620.05
本期利润	167,039,676.25	135,255,745.34
加权平均基金份额本期利润	0.1913	0.1994
本期加权平均净值利润率	19.55%	20.52%
本期基金份额净值增长率	24.82%	24.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C
期末可供分配利润	4,779,318.73	-1,164,549.64
期末可供分配基金份额利润	0.0049	-0.0016
期末基金资产净值	992,593,182.93	732,273,718.36
期末基金份额净值	1.0249	1.0178
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C
基金份额累计净值增长率	2.49%	1.78%

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, 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. 所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, 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

东方阿尔法精选混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.39%	1.16%	3.59%	0.62%	1.80%	0.54%
过去三个月	-4.00%	1.56%	-0.41%	0.74%	-3.59%	0.82%
过去六个月	24.82%	1.62%	13.54%	0.76%	11.28%	0.86%
过去一年	9.81%	1.50%	6.38%	0.79%	3.43%	0.71%
自基金合同 生效起至今	2.49%	1.33%	1.11%	0.76%	1.38%	0.57%

东方阿尔法精选混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.34%	1.16%	3.59%	0.62%	1.75%	0.54%
过去三个月	-4.13%	1.56%	-0.41%	0.74%	-3.72%	0.82%
过去六个月	24.50%	1.61%	13.54%	0.76%	10.96%	0.85%
过去一年	9.26%	1.50%	6.38%	0.79%	2.88%	0.71%
自基金合同 生效起至今	1.78%	1.33%	1.11%	0.76%	0.67%	0.57%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+中证综合债券指数收益率×40%+恒生指数收益率×20%。

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



3.3 其他指标

无。

§ 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

东方阿尔法基金管理有限公司（以下简称“东方阿尔法基金”）于2017年6月24日经中国证监会批准，2017年7月4日注册成立，公司总部设在广东省深圳市，业务范围包括基金募集、基金销售、基金管理、特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。截至报告期末，注册资本为1亿元人民币。

东方阿尔法基金作为华南地区首家纯员工持股的公募基金管理公司，公司股权结构为刘明、珠海共同成长股权投资基金合伙企业（有限合伙）、肖冰、雷振锋、曾健分别持有公司39.96%、39.56%、13.98%、4.5%和2%的股权。

截至报告期末，东方阿尔法基金管理资产规模22.94亿元，旗下管理1只开放式公募基金和2只集合资产管理计划。

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		
刘明	本基金基金经理、公司总经理、公司首席投资官	2018-02-08	-	19年	男, 1991年毕业于厦门大学统计专业, 经济学硕士, 东方阿尔法基金管理有限公司创始人、实际控制人。近20年证券基金从业经验, 专业从事二级市场股票投资, 并一直在一线担任大规模投资组合基金经理。2004年3月至2015年4月在大成基金管理有限公司历任投资总监、首席投资官、副总经理、投资决策委员会主席, 领导团队管理超过1500亿人民币基金资产; 有着超过10个完

					整年度的大规模资金一线管理经验,曾分别担任过封闭式基金景宏基金经理、大成优选基金基金经理、社保一一三组合基金经理、大成景宏一期专户投资经理。所获荣誉:2006年获得“美国晨星(中国)年度大规模封闭式基金经理奖”,并有两年进入“美国晨星(中国)年度基金经理奖”提名;2007年获得《证券时报》“封闭式基金明星”奖;2010年获任中国证监会第十二届主板发审委委员。
--	--	--	--	--	--

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金《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。本报告期内,基金运作整体合法合规,没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的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

2019年上半年，上证综指冲高回落，围绕3000点上下震荡，截至上半年末上涨了19.45%。本基金管理人在上半年度维持了较高的权益类仓位，对基金持仓结构进行了部分调整，逢低增加了食品饮料、航空等板块的配置，对部分估值较高及基本面出现不利因素变化的行业持仓进行了减持。上半年本基金A类份额净值增长24.82%，C类份额净值增长24.50%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东方阿尔法精选混合A基金份额净值为1.0249元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为24.82%，同期业绩比较基准收益率为13.54%；截至报告期末东方阿尔法精选混合C基金份额净值为1.0178元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为24.50%，同期业绩比较基准收益率为13.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期看来，中美贸易摩擦持续不断，但对A股市场的影响边际在减弱。中长期看来，“强改革、促开放”是主基调。市场下一个阶段关注焦点将转向国内，“做好自己的事”成为决定下一阶段市场空间的核心因素。

国内财政及货币政策预计会持续精准定向宽松，以对冲中美贸易摩擦、全球经济波动带来的影响，并为实现国内去杠杆、经济转型的中长期目标保驾护航。同时，为顺应全球化、市场化的发展，我们可以看到政府在对内深化改革和对外扩大开放上出现更多积极的信号。随着减税降费、国企改革、供给侧改革、土地改革、负面清单逐步减少、知识产权的保护力度加强等政策推向纵深，A股有望迎来战略性机会。

目前，整体市场估值仍处于合理区间偏低水平，比较多的行业和股票存在低估。本基金管理人将布局重点立足内需的消费、中游制造业、低估值的金融地产等行业，并维持较高仓位。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人已将本基金的基金估值核算业务外包给本基金的金融运营服务机构——招商证券股份有限公司。本基金金融运营服务机构按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金金融运营服务机构使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。金融运营服务机构改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。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。同时，本基金管理人建立了估值小组，由总经理、督察长及运作保障部、投资部、研究部、中央交易室和监察稽核部业务骨干组成，负责指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

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、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	9,078,027.23	7,639,629.67
结算备付金		-	8,612,143.78
存出保证金		-	194,767.59
交易性金融资产	6.4.7.2	1,702,551,563.60	1,013,057,989.70
其中：股票投资		1,615,586,663.20	922,905,246.03
基金投资		-	-
债券投资		86,964,900.40	90,152,743.67
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	16,000,000.00	28,500,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	935,330.22	1,171,397.93
应收股利		129,693.44	-
应收申购款		4,182,328.80	52,469.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,732,876,943.29	1,059,228,398.37
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2019年06月30日	2018年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,403,844.74	113,931.52
应付管理人报酬		2,066,117.64	1,420,418.53
应付托管费		344,352.94	236,736.43
应付销售服务费		298,255.58	199,486.93
应付交易费用	6.4.7.7	787,984.49	182,815.40
应交税费		-	485.42
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,486.61	90,427.46
负债合计		8,010,042.00	2,244,301.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,687,945,966.47	1,289,672,376.92
未分配利润	6.4.7.10	36,920,934.82	-232,688,280.24
所有者权益合计		1,724,866,901.29	1,056,984,096.68
负债和所有者权益总计		1,732,876,943.29	1,059,228,398.37

注：报告截止日2019年6月30日，东方阿尔法精选混合基金A类基金份额净值1.0249元，基金份额总额968,486,829.93份；东方阿尔法精选混合基金C类基金份额净值1.0178元，基金份额总额719,459,136.54份。

6.2 利润表

会计主体：东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年01月01 日 至2019年06月3 0日	上年度可比期间 2018年02月08日（基金 合同生效日）至2018 年06月30日
一、收入		319,104,229.59	-67,687,842.52
1. 利息收入		1,434,143.77	9,853,912.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	65,902.00	7,870,422.73
债券利息收入		966,250.07	542,480.24
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		401,991.70	1,441,009.15
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		17,967,796.65	9,015,955.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-9,037,935.21	2,759,441.81
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	14,835,025.14	-27,106.80
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	12,170,706.72	6,283,620.26
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.18	295,730,201.03	-86,682,815.62
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.19	3,972,088.14	125,105.71
减：二、费用		16,808,808.00	9,663,424.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	11,210,245.77	6,658,561.74

2. 托管费	6.4.10.2. 2	1,868,374.26	1,109,760.28
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	1,631,308.44	977,462.85
4. 交易费用	6.4.7.20	1,992,037.05	807,593.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		77.54	3.55
7. 其他费用	6.4.7.21	106,764.94	110,042.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		302,295,421.59	-77,351,266.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		302,295,421.59	-77,351,266.75

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06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）	1,289,672,376.92	-232,688,280.24	1,056,984,096.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	302,295,421.59	302,295,421.59
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）	398,273,589.55	-32,686,206.53	365,587,383.02

其中：1. 基金申购款	1,402,936,796.25	-25,349,688.18	1,377,587,108.07
2. 基金赎回款	-1,004,663,206.70	-7,336,518.35	-1,011,999,725.05
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）	1,687,945,966.47	36,920,934.82	1,724,866,901.29
项 目	上年度可比期间 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06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）	1,164,035,083.25	-	1,164,035,083.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-77,351,266.75	-77,351,266.75
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）	3,188,752.58	-1,483,312.07	1,705,440.51
其中：1. 基金申购款	116,475,718.58	-4,325,657.17	112,150,061.41
2. 基金赎回款	-113,286,966.00	2,842,345.10	-110,444,620.90
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）	1,167,223,835.83	-78,834,578.82	1,088,389,257.01

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：

刘明

曹渊

张珂

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

东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第2013号《关于准予东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由东方阿尔法基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,163,778,381.98元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0110号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2018年2月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,164,035,083.25份基金份额,其中认购资金利息折合256,701.27份基金份额。本基金的基金管理人为东方阿尔法基金管理有限公司,基金金融运营服务机构为招商证券股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,005,850.58份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》(含更新),本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异,将基金份额分为不同的类别。收取认购/申购费用、赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;不收取认购/申购费、赎回时收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择认购/申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象为良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、港股通标的股票(包括沪港通股票及深港通股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、证券公司短期融资券、

短期融资券)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、权证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。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%-95%;其中对港股通标的股票(包括沪港通股票及深港通股票)的投资比例不超过股票资产的50%。本基金在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 40%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 40%+恒生指数收益率 $\times$ 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人东方阿尔法基金管理有限公司于2019年8月24日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
活期存款	8,052,084.15
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	1,025,943.08
合计	9,078,027.23

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,526,960,652.33	1,615,586,663.20	88,626,010.87
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	86,918,100.20	86,964,900.40	46,800.20
	银行间市场	—	—	—
	合计	86,918,100.20	86,964,900.40	46,800.20
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,613,878,752.53	1,702,551,563.60	88,672,811.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	16,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	16,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	1,198.43
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	532.54
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	933,599.25
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	935,330.22

注：“其他”为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

无

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	787,984.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	787,984.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,086.67
预提费用	106,399.94
合计	109,486.61

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 东方阿尔法精选混合A

金额单位：人民币元

项目 (东方阿尔法精选混合A)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	740,049,384.12	740,049,384.12
本期申购	550,804,616.94	550,804,616.94
本期赎回（以“-”号填列）	-322,367,171.13	-322,367,171.13
本期末	968,486,829.93	968,486,829.93

6.4.7.9.2 东方阿尔法精选混合C

金额单位：人民币元

项目 (东方阿尔法精选混合C)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	549,622,992.80	549,622,992.80
本期申购	852,132,179.31	852,132,179.31

本期赎回（以“-”号填列）	-682,296,035.57	-682,296,035.57
本期末	719,459,136.54	719,459,136.54

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 东方阿尔法精选混合A

单位：人民币元

项目 (东方阿尔法精选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	345,018.32	-132,716,782.45	-132,371,764.13
本期利润	5,127,600.51	161,912,075.74	167,039,676.25
本期基金份额交易产生的变动数	-693,300.10	-9,868,259.02	-10,561,559.12
其中：基金申购款	-1,981,974.00	-1,319,240.31	-3,301,214.31
基金赎回款	1,288,673.90	-8,549,018.71	-7,260,344.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,779,318.73	19,327,034.27	24,106,353.00

6.4.7.10.2 东方阿尔法精选混合C

单位：人民币元

项目 (东方阿尔法精选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,008,323.86	-98,308,192.25	-100,316,516.11
本期利润	1,437,620.05	133,818,125.29	135,255,745.34
本期基金份额交易产生的变动数	-593,845.83	-21,530,801.58	-22,124,647.41
其中：基金申购款	-7,423,174.93	-14,625,298.94	-22,048,473.87
基金赎回款	6,829,329.10	-6,905,502.64	-76,173.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,164,549.64	13,979,131.46	12,814,581.82

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	38,140.16
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	19,577.39
结算备付金利息收入	8,166.87
其他	17.58
合计	65,902.00

注：“其他”为申购款利息收入及结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	531,283,569.27
减：卖出股票成本总额	540,321,504.48
买卖股票差价收入	-9,037,935.21

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	14,835,025.14
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	14,835,025.14

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	118,070,001.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	101,455,798.99
减：应收利息总额	1,779,177.65
买卖债券差价收入	14,835,025.14

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	12,170,706.72

基金投资产生的股利收益	-
合计	12,170,706.72

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	295,730,201.03
——股票投资	295,997,600.51
——债券投资	-267,399.48
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	295,730,201.03

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	3,972,088.14
合计	3,972,088.14

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，其中，A类份额将不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类份额将赎回费收入全额归入基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	1,992,037.05
银行间市场交易费用	-
合计	1,992,037.05

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	56,811.37
汇划手续费	365.00
合计	106,764.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
东方阿尔法基金管理有限公司（“东方阿尔法基金”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
珠海共同成长股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东

刘明	基金管理人股东
肖冰	基金管理人股东
雷振锋	基金管理人股东
曾健	基金管理人股东

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日 至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年02月08日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,210,245.77	6,658,561.74
其中：支付销售机构的客户维护费	1,486,155.60	284,425.35

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

$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$

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、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日 至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年02月08日（基金合同生 效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,868,374.26	1,109,760.28

注：基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C	合计
招商银行 股份有限 公司	0.00	22,616.16	22,616.16
东方阿尔 法基金管 理有限公	0.00	1,140,904.36	1,140,904.36

司			
合计	0.00	1,163,520.52	1,163,520.52
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2018年02月08日（基金合同生效日）至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C	合计
招商银行 股份有限 公司	0.00	25,949.60	25,949.60
东方阿尔 法基金管 理有限公 司	0.00	669,638.02	669,638.02
合计	0.00	695,587.62	695,587.62

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.5%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

东方阿尔法精选混合A

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06 月30日	上年度可比期间 2018年02月08日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018 年02月08日）持有的基	-	30,017,551.16

金份额		
报告期初持有的基金份额	10,017,551.16	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,017,551.16	30,017,551.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.03%	4.78%

注：1、以上表中“报告期末持有的基金份额占基金总份额比例”的计算中，对下属不同类别基金比例的分母采用各自级别的份额。

2、基金管理人东方阿尔法基金管理有限公司在本会计期间认购/赎回本基金的交易委托直销柜台办理，适用费率为每笔1000元。

3、本报告期内基金管理人运用固有资金未投资“东方阿尔法精选混合C”。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

东方阿尔法精选混合A

关联方名称	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
珠海共同成长股权投资合伙企业（有限合伙）	10,140,929.56	1.05%	10,140,929.56	1.37%

刘明	6,670,566.58	0.69%	6,670,566.58	0.9%
肖冰	1,245,847.14	0.13%	1,000,225.22	0.14%
曾健	950,552.83	0.1%	950,552.83	0.13%

注:1. 以上表中“持有的基金份额占基金总份额的比例”的计算中,对下属不同类别基金比例的分母采用各自级别的份额。

2. 报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资“东方阿尔法精选混合C”。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年02月08日(基金合同生效日) 至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	8,052,084.15	38,140.16	5,740,867.55	262,648.22

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值	数量(单)	期末成本	期末估值	备注

		日		类型		单价	位：股)	总额	总额	
002867	周大生	2019-04-12	2019-10-14	大宗交易买入限售	31.68	32.60	1,000,000	31,680.00	32,600.00	-
002563	森马服饰	2019-03-06	2019-09-09	大宗交易买入限售	10.00	10.62	2,600,000	26,000.00	27,612.00	-
601021	春秋航空	2019-04-11	2019-10-14	大宗交易买入限售	38.16	43.01	581,588	22,193.80	25,014.98	-
002745	木林森	2018-08-23	2019-08-26	非公开发行限售	15.71	11.30	1,973,265	30,999.31	22,297.45	-
002127	南极电商	2019-05-15	2019-11-18	大宗交易买入限售	11.34	10.41	2,000,000	22,680.00	20,820.00	-
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截止至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和收益水平高于债券基金及货币市场基金，低于股票基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和交易所回购等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的三级风险防控体系。一级风险防范指基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等。二级风险防范指在公司投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。公司经理层设投资决策委员会，对涉及基金投资的重大问题进行决策，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部在督察长的领导下，独立于公司各业务部门，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行。因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。本基金在交易所进行交易前均对交易对手进

行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金目前暂未开展银行间同业市场业务，无此类信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部债券信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于2019年06月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，监察稽核部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于2019年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监察稽核部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发

行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持的证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资和资产支持证券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2019年06月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计占基金资产净值的比例为7.44%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2019年06月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,078,027.23	-	-	-	-	-	9,078,027.23
交易性金融资产	2,000.40	-	86,962,900.00	-	-	1,615,586,663.20	1,702,551,563.60
买入返售金融资产	16,000,000.00	-	-	-	-	-	16,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	935,330.22	935,330.22
应收股利	-	-	-	-	-	129,693.44	129,693.44
应收申购款	-	-	-	-	-	4,182,328.80	4,182,328.80
资产总计	25,080,027.63	-	86,962,900.00	-	-	1,620,834,015.66	1,732,876,943.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,403,844.74	4,403,844.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,066,117.64	2,066,117.64
应付托管费	-	-	-	-	-	344,352.94	344,352.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-	298,255.58	298,255.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	787,984.49	787,984.49

其他负债	-	-	-	-	-	109,486.61	109,486.61
负债总计	-	-	-	-	-	8,010,042.00	8,010,042.00
利率敏感度缺口	25,080,027.63	-	86,962,900.00	-	-	1,612,823,973.66	1,724,866,901.29
上年度末2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,639,629.67	-	-	-	-	-	7,639,629.67
结算备付金	8,612,143.78	-	-	-	-	-	8,612,143.78
存出保证金	194,767.59	-	-	-	-	-	194,767.59
交易性金融资产	-	8,409,722.40	52,419,779.70	29,323,241.57	-	922,905,246.03	1,013,057,989.70
买入返售金融资产	28,500,000.00	-	-	-	-	-	28,500,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,171,397.93	1,171,397.93
应收申购款	-	-	-	-	-	52,469.70	52,469.70
资产总计	44,946,541.04	8,409,722.40	52,419,779.70	29,323,241.57	-	924,129,113.66	1,059,228,398.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	113,931.52	113,931.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,420,418.53	1,420,418.53
应付托管费	-	-	-	-	-	236,736.43	236,736.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	199,486.93	199,486.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	182,815.40	182,815.40
应交税	-	-	-	-	-	485.42	485.42

费							
其他负债	-	-	-	-	-	90,427.46	90,427.46
负债总计	-	-	-	-	-	2,244,301.69	2,244,301.69
利率敏感度缺口	44,946,541.04	8,409,722.40	52,419,779.70	29,323,241.57	-	921,884,811.97	1,056,984,096.68

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年06月30日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为5.04%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	27,885.22	-	27,885.22
应收股利	-	129,693.44	-	129,693.44
资产合计	-	157,578.66	-	157,578.66
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	157,578.66	-	157,578.66

项目	上年度末 2018年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

注：上年度末未持有港股通股票投资。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	港币兑人民币汇率升值5%	7,878.93	-
	港币兑人民币汇率贬值5%	-7,878.93	-

注：上年度末未持有港股通股票投资。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%-95%；其中对港股通标的股票（包括沪港通股票及深港通股票）的投资比例不超过股票资产的50%。本基金在任何交易日日终持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,615,586,663.20	93.66	922,905,246.03	87.32
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	29,323,241.57	2.77
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,615,586,663.20	93.66	952,228,487.60	90.09

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单

		位：人民币元)	
		本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	沪深300指数上升5%	82,823,565.39	47,266,875.59
	沪深300指数下降5%	-82,823,565.39	-47,266,875.59

6.4.14 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

2019年06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1,487,242,668.82元，属于第二层次的余额为215,308,894.78元，属于第三层次的余额为0.00元。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具 于2019年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,615,586,663.20	93.23
	其中：股票	1,615,586,663.20	93.23
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	86,964,900.40	5.02
	其中：债券	86,964,900.40	5.02
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	16,000,000.00	0.92
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	9,078,027.23	0.52
8	其他各项资产	5,247,352.46	0.30
9	合计	1,732,876,943.29	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为27,885.22元，占资产净值比例0.00%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	36,058,212.00	2.09
B	采矿业	58,512,623.78	3.39
C	制造业	677,697,477.27	39.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	138,643,669.81	8.04

G	交通运输、仓储和邮政业	116,085,774.88	6.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	104,328.76	0.01
J	金融业	333,869,113.00	19.36
K	房地产业	122,465,562.68	7.10
L	租赁和商务服务业	89,044,552.00	5.16
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	21,243,056.00	1.23
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	21,834,407.80	1.27
S	综合	-	-
	合计	1,615,558,777.98	93.66

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	27,885.22	0.00
合计	27,885.22	0.00

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002867	周大生	4,101,599	138,643,669.81	8.04
2	601021	春秋航空	2,605,403	116,085,774.88	6.73

3	000001	平安银行	8,419,868	116,025,781.04	6.73
4	601877	正泰电器	4,750,936	109,699,112.24	6.36
5	601318	中国平安	1,229,938	108,984,806.18	6.32
6	002142	宁波银行	4,489,466	108,824,655.84	6.31
7	002202	金风科技	7,968,301	99,045,981.43	5.74
8	002127	南极电商	8,069,800	89,044,552.00	5.16
9	600031	三一重工	6,237,733	81,589,547.64	4.73
10	000858	五 粮 液	690,800	81,479,860.00	4.72
11	600519	贵州茅台	76,200	74,980,800.00	4.35
12	002563	森马服饰	6,636,812	72,259,140.72	4.19
13	H02899	紫金矿业	10,000	27,885.22	0.00
13	601899	紫金矿业	15,424,189	58,149,192.53	3.37
14	000002	万 科 A	2,038,656	56,695,023.36	3.29
15	002745	木林森	4,189,437	48,271,430.34	2.80
16	002146	荣盛发展	4,725,968	44,376,839.52	2.57
17	600114	东睦股份	6,674,471	41,982,422.59	2.43
18	002661	克明面业	2,714,347	37,865,140.65	2.20
19	002299	圣农发展	1,424,100	36,058,212.00	2.09
20	000902	新洋丰	2,816,210	30,217,933.30	1.75
21	300144	宋城演艺	942,580	21,811,301.20	1.26
22	001979	招商蛇口	1,023,622	21,393,699.80	1.24
23	002607	中公教育	1,547,200	21,243,056.00	1.23
24	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.02
25	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
26	002955	鸿合科技	1,108	65,194.72	0.00
27	300773	拉卡拉	1,250	64,725.00	0.00
28	603697	有友食品	3,383	64,006.36	0.00
29	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
30	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
31	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
32	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00

33	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
34	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

注：所用证券代码采用当地市场代码。

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	601021	春秋航空	101,513,074.44	9.60
2	002127	南极电商	94,264,532.44	8.92
3	000858	五 粮 液	77,483,918.48	7.33
4	600519	贵州茅台	60,317,069.70	5.71
5	002142	宁波银行	57,833,167.94	5.47
6	002867	周大生	57,693,861.62	5.46
7	000001	平安银行	51,114,755.58	4.84
8	000568	泸州老窖	50,852,516.37	4.81
9	600031	三一重工	47,692,543.00	4.51
10	002563	森马服饰	46,692,920.26	4.42
11	601877	正泰电器	44,651,727.90	4.22
12	002661	克明面业	40,978,775.22	3.88
13	002299	圣农发展	36,915,225.04	3.49
14	000902	新洋丰	29,491,178.57	2.79
15	600114	东睦股份	20,168,286.88	1.91
16	H00753	中国国航	17,415,274.72	1.65
17	600029	南方航空	16,336,127.00	1.55
18	603985	恒润股份	15,892,903.00	1.50
19	300755	华致酒行	12,285,986.74	1.16
20	300182	捷成股份	12,110,537.00	1.15

注：（1）买入包括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，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

（2）所用证券代码采用当地市场代码。

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	002640	跨境通	86,033,594.30	8.14
2	300182	捷成股份	66,597,832.45	6.30
3	300059	东方财富	62,212,419.17	5.89
4	000568	泸州老窖	52,579,712.88	4.97
5	002202	金风科技	30,327,108.99	2.87
6	300760	迈瑞医疗	30,255,253.50	2.86
7	000910	大亚圣象	25,296,646.93	2.39
8	603985	恒润股份	20,142,832.63	1.91
9	600702	舍得酒业	17,465,959.82	1.65
10	603043	广州酒家	14,976,290.00	1.42
11	600029	南方航空	14,570,958.57	1.38
12	H00753	中国国航	13,259,400.31	1.25
13	000069	华侨城 A	12,837,848.40	1.21
14	600588	用友网络	11,191,226.34	1.06
15	300755	华致酒行	10,486,096.26	0.99
16	002563	森马服饰	10,463,898.00	0.99
17	601111	中国国航	8,767,337.36	0.83
18	600031	三一重工	8,484,853.88	0.80
19	002737	葵花药业	8,099,364.40	0.77
20	603686	龙马环卫	6,781,398.00	0.64

注：（1）卖出包括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，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。
（2）所用证券代码采用当地市场代码。

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	937,005,321.14
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	531,283,569.27
--------------	----------------

注：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	86,964,900.40	5.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	86,964,900.40	5.04

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	019611	19国债01	740,000	73,940,800.00	4.29
2	019556	17国债02	130,000	13,022,100.00	0.75
3	019544	16国债16	20	2,000.40	0.00

注：截止至报告期末，本基金仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的，通过套期保值策略，对冲系统性风险，应对组合构建与调整中的流动性风险，力求风险收益的优化。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

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，本期没有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 本基金投资的前十名股票没有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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	129,693.44
4	应收利息	935,330.22
5	应收申购款	4,182,328.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	—
9	合计	5,247,352.46

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002867	周大生	32,600,000.00	1.89	大宗交易买入限售
2	601021	春秋航空	25,014,099.88	1.45	大宗交易买入限售
3	002127	南极电商	20,820,000.00	1.21	大宗交易买入限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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
东方阿尔法精选混合A	4,055	238,837.69	594,054,213.18	61.34%	374,432,616.75	38.66%
东方阿	5,171	139,133.46	491,979,164.42	68.38%	227,479,972.12	31.62%

尔法精选混合C						
合计	9,226	182,955.34	1,086,033,377.60	64.34%	601,912,588.87	35.66%

注:本基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属不同类别的基金,比例的分母采用各自级别的份额;对合计数,比例的分母采用期末基金份额总额。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	东方阿尔法精选混合A	10,366,737.23	1.07%
	东方阿尔法精选混合C	1,219,356.32	0.17%
	合计	11,586,093.55	0.69%

注:基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属不同类别基金,比例的分母采用各自级别的份额;对合计数,比例的分母采用期末基金份额总额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方阿尔法精选混合A	>100
	东方阿尔法精选混合C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	东方阿尔法精选混合A	>100
	东方阿尔法精选混合C	-
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
----	--------	--------------	--------	--------------	------------

基金管理人固有资金	10,005,850.58	0.59%	10,005,850.58	0.59%	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
合计	10,005,850.58	0.59%	10,005,850.58	0.59%	自合同生效之日起不少于三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东方阿尔法精选混合A	东方阿尔法精选混合C
基金合同生效日(2018年02月08日)基金份额总额	651,144,745.16	512,890,338.09
本报告期期初基金份额总额	740,049,384.12	549,622,992.80
本报告期基金总申购份额	550,804,616.94	852,132,179.31
减：本报告期基金总赎回份额	322,367,171.13	682,296,035.57
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	968,486,829.93	719,459,136.54

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

经东方阿尔法基金管理有限公司第一届董事会第十四次会议审议通过《关于聘请曹渊先生为公司首席信息官的议案》，曹渊先生自2019年6月14日起担任基金管理人首席信息官职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

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、基金托管人及其高级管理人员未受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	
中信证券（山东）	2	1,457,569,650.61	100.00%	1,304,351.07	100.00%	-

注：1、本基金使用券商结算模式，本报告期内本基金选择中信证券（山东）有限责任公司作为证券经纪商，本基金与证券经纪商中信证券（山东）不存在关联方关系。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商结算模式进行证券交易和结算的需要；
 - 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持；
 - 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足券商结算模式下T+0估值的时效性要求。
- 3、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定证券经营机构，然后基金管理人、基金托管人和证券经纪商签订证券经纪服务协议。
- 4、佣金支付情况：
- 1) 股票交易佣金费率为0.1%（大宗交易费率为0.05%），债券交易佣金费率为0.01%，债券回购交易不计佣金，交易佣金包含已由证券经纪商扣收的一级交易费用（包括经手费、证管费、风险金），但不包括印花税、上海市场过户费、港股通交易相关费用等税费。
 - 2) 每季度佣金经基金托管人、证券经纪商核对无误后于季度结束后第10个交易日在本基金的证券资金账户中扣收，本基金本报告期合计应支付佣金为1,304,351.07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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券(山东)	149,237,677.14	100.00%	3,949,300,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：该表格中的债券成交金额是按全价计算的金额。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年第四季度报告	上海证券报、基金管理人的官方网站	2019-01-19

2	《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）》（2019年第1号）及摘要	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-25
3	东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年年度报告及摘要	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-26
4	东方阿尔法基金管理有限公司更正公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-03-30
5	东方阿尔法基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构并参与其费率优惠的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-04-02
6	东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年第一季度报告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-04-20
7	东方阿尔法基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-06-15
8	关于东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金可投资于科创板股票的公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-06-21
9	东方阿尔法基金管理有限公司旗下基金2019年半年度最后一个交易日基金资产净值、基金份额净值及份额累计净值公告	证券时报、基金管理人的官方网站	2019-06-29

§ 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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别		达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	2019年1月1日-2019年6月30日	503,605,085.23	-	-	503,605,085.23	29.84%
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括： （1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险； （2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险； （3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险； （4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准的东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 5、东方阿尔法精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年半年度报告原文
- 6、基金管理人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

地点为管理人地址：广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦西区23楼BC单元

12.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人东方阿尔法基金管理有限公司，客户服务电话：400-930-6677（免长途话费）。
- 3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：<http://www.dfa66.com>

东方阿尔法基金管理有限公司
二〇一九年八月二十四日