
东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型 发起式证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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 2017 年 8 月 24 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。

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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
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.....	8
§4 管理人报告	11
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 备查文件目录.....	52

11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	东方红睿元混合
基金主代码	000970
前端交易代码	000970
基金运作方式	契约型，本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式
基金合同生效日	2015 年 1 月 21 日
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	672,005,921.82 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金在中国经济增长模式转型的大背景下，寻找符合经济发展趋势的行业，积极把握由新型城镇化、人口结构调整、资源环境约束、产业升级、商业模式创新等大趋势带来的投资机会，挖掘重点行业中的优势个股，自下而上精选具有核心竞争优势的企业，分享转型期中国经济增长的成果，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为三年期银行定期存款利率（税后）。每个封闭期的业绩比较基准为该封闭期起始日前最近一个开放期最后一个开放日的三年期银行定期存款利率，第一个封闭期的业绩比较基准为认购期间最后一个认购日的三年期银行定期存款利率，封闭期内业绩比较基准不因央行基准利率的调整做调整；每个开放期的业绩比较基准同前一个封闭期的业绩比较基准，开放期内业绩比较基准不因央行基准利率的调整做调整。
风险收益特征	本基金是一只特殊的开放式基金，以定期开放方式运作，每个封闭期的期限为三年，在封闭期内不办理申购与赎回业务，相对于一般的开放式基金其流动性较差。 本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高

	预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐涵颖	张燕
	联系电话	021-63325888	0755-83199084
	电子邮箱	service@dfham.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	95555
传真		021-63326981	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路318号31层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区中山南路318号2号楼31层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040
法定代表人		陈光明	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	中国证券报，证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金半年度报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路318号2号楼31层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	116,301,672.65
本期利润	303,855,885.01
加权平均基金份额本期利润	0.4522
本期加权平均净值利润率	26.28%
本期基金份额净值增长率	29.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	389,924,242.79
期末可供分配基金份额利润	0.5802
期末基金资产净值	1,333,744,739.09
期末基金份额净值	1.985
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	98.50%

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

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.59%	0.99%	0.21%	0.01%	8.38%	0.98%
过去三个月	14.61%	0.86%	0.64%	0.01%	13.97%	0.85%
过去六个月	29.48%	0.75%	1.29%	0.01%	28.19%	0.74%
过去一年	43.74%	0.72%	2.63%	0.01%	41.11%	0.71%
自基金合同生效起至今	98.50%	1.52%	7.27%	0.01%	91.23%	1.51%

注：1、自基金合同生效日起至今指 2015 年 1 月 21 日-2017 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后），其中，三年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构三年期人民币存款基准利率。本基金以定期开放方式运作，每个封闭期的期限为三年。第一个封闭期的业绩比较基准为认购期间最后一个认购日的三年期银行定期存款利率，封闭期内业绩比较基准不因央行基准利率的调整做调整；每个开放期的业绩比较基准同前一个封闭期的业绩比较基准，开放期内业绩比较基准不因央行基准利率的调整做调整。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（ benchmark_t ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 100\% * [\text{三年期银行定期存款利率（税后）} / 365]$$

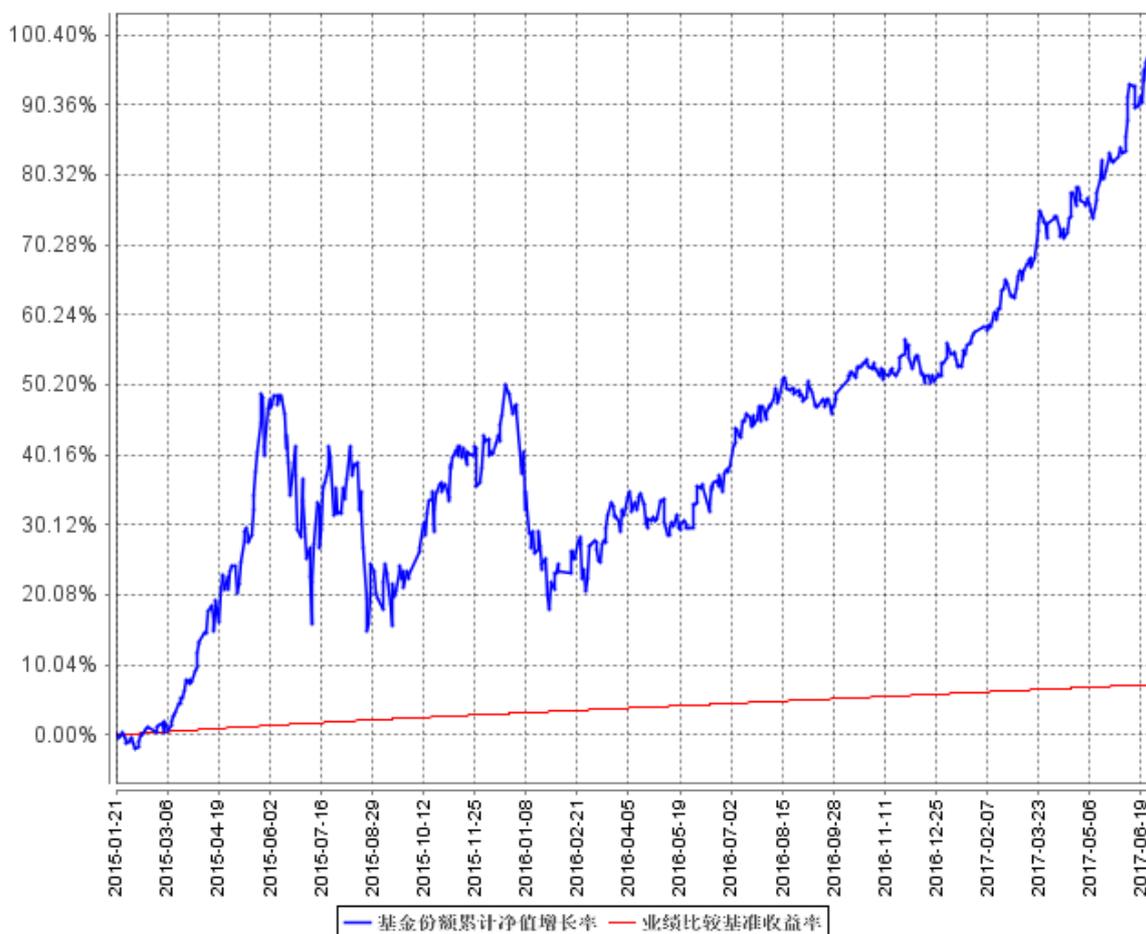
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ，T 表示时间截至日；

t 日至 T 日的期间收益率（ benchmark_t^T ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t^T = \left[\prod_{i=t}^T (1 + \text{benchmark}_i) \right] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{i=t}^T (1 + \text{benchmark}_i)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmark}_i)$ 数学连乘。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2017 年 6 月 30 日。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2015 年 1 月 21 日至 2015 年 7 月 20 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金二十七只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林鹏	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募权益投资部总经理、兼任东方红睿丰灵活配置混合型证券	2015 年 1 月 23 日	-	19 年	硕士，曾任东方证券研究所研究员、资产管理业务总部投资经理，上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理、专户投资

	投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。				部资深投资经理、执行董事；现任上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募权益投资部总经理兼任东方红睿丰混合、东方红睿阳混合、东方红睿元混合、东方红中国优势混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红沪港深混合、东方红睿华沪港深混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
韩冬	东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金经理。	2017年1月10日	-	8年	硕士，曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员，上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、权益研究部高级研究员；现任东方红睿元混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
刚登峰	东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。	2015年7月3日	2017年4月12日	8年	硕士，曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资经理助理、资深研究员、投资主办人；现任东方红优势精选混合、东方红睿轩沪港深混合、东方红优享红利混合、东方红智逸沪港深定期混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、根据 2017 年 4 月 12 日《上海东方证券资产管理有限公司关于东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》，自 2017 年 4 月 12 日起，刚登峰先生不再担

任本基金的基金经理。

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，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

持有优质资产，做时间的朋友，是我们坚持的投资理念。我们也对估值收缩到合理水平、成长性显著的中小公司保持关注，经济转型过程中，一定有代表未来方向的行业和企业能够脱颖而出。我们看好消费升级、制造业产业转移、环保管控、新技术新市场等方向，希望寻找有竞争壁垒、能够长期成长的公司。

市场是复杂而难以预测的，我们恪守价值投资的理念，重视公司的竞争壁垒和安全边际，强调估值和公司质地的匹配，希望能够给持有人创造稳定的长期回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.985 元，份额累计净值为 1.985 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 29.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年，世界经济都在低位徘徊，低增长、低通胀、低货币扩张的背景下，全球的权益市场配置都偏向优质标的的精选，这和我们一贯坚持的自下而上、精选个股的策略不谋而合。

自去年以来，国内外市场都呈现核心资产物以稀为贵、龙头公司驱动指数上涨的趋势，优质的蓝筹白马公司已经走出了一波漂亮 50 行情，这也和大的经济背景下，资产配置追求确定性、看重稳定回报有关。目前，这些标的从估值上看已趋合理，但从企业的竞争壁垒、发展空间等角度，仍具有性价比。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%；
- 3、若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 4、本基金收益分配方式仅现金分红一种方式；
- 5、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	152,413,014.32	21,173,778.88
结算备付金		7,158,877.30	7,602,662.73
存出保证金		227,725.78	183,926.04
交易性金融资产	6.4.7.2	1,176,934,098.97	903,236,191.62
其中：股票投资		1,176,934,098.97	903,236,191.62
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	120,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	32,114.31	90,334.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,336,765,830.68	1,052,286,894.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	20,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,055,214.65	868,173.82
应付托管费		263,803.64	217,043.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,563,224.58	1,132,822.67
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	138,848.72	180,000.00
负债合计		3,021,091.59	22,398,039.94
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	672,005,921.82	672,005,921.82
未分配利润	6.4.7.10	661,738,817.27	357,882,932.26
所有者权益合计		1,333,744,739.09	1,029,888,854.08
负债和所有者权益总计		1,336,765,830.68	1,052,286,894.02

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.985 元，基金份额总额 672,005,921.82 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		312,597,675.62	-48,857,770.35
1.利息收入		705,830.64	593,890.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	538,578.65	593,890.64
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		167,251.99	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		124,337,632.62	-6,134,551.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	110,630,108.57	-14,489,949.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-213,600.00
股利收益	6.4.7.16	13,707,524.05	8,568,998.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	187,554,212.36	-43,317,109.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		8,741,790.61	6,875,456.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,714,007.10	4,351,454.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,428,501.80	1,087,863.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	1, 445, 463. 61	1, 291, 588. 84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	153, 818. 10	144, 548. 47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		303, 855, 885. 01	-55, 733, 226. 35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		303, 855, 885. 01	-55, 733, 226. 35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	672, 005, 921. 82	357, 882, 932. 26	1, 029, 888, 854. 08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	303, 855, 885. 01	303, 855, 885. 01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	672, 005, 921. 82	661, 738, 817. 27	1, 333, 744, 739. 09
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	672,005,921.82	311,526,430.27	983,532,352.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-55,733,226.35	-55,733,226.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	672,005,921.82	255,793,203.92	927,799,125.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 陈光明 任莉 詹朋
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方红睿元三年定期开放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”）《关于核准东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的批复》（证监许可[2014]740号文）核准，由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年1月21日生效。本基金为契约型定期开放混合型证券投资基金，存续期限不定期。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金于2015年1月8日至2015年1月15日向社会公开募集，扣除认购费后的有效认购资金671,874,327.16元，利息结转份额131,594.66元，募集规模为672,005,921.82份。上述募集资金已由立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红睿元三年定期开放灵活配

置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券（含中小企业私募债）、中期票据、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。开放期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，封闭期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%；权证投资比例为基金资产的 0%—3%；开放期每个交易日日终，在扣除股指期货和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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

本基金业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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补充政策的通知》，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

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

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

6.4.7 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 2017年6月30日
活期存款	152,413,014.32
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	152,413,014.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	905,119,524.49	1,176,934,098.97	271,814,574.48
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	905,119,524.49	1,176,934,098.97	271,814,574.48

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	30,311.32
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,700.59
应收债券利息	-
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	102.40
合计	32,114.31

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,563,224.58
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,563,224.58

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	138,848.72
合计	138,848.72

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	672,005,921.82	672,005,921.82
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	672,005,921.82	672,005,921.82

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	273,622,570.14	84,260,362.12	357,882,932.26
本期利润	116,301,672.65	187,554,212.36	303,855,885.01
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	389,924,242.79	271,814,574.48	661,738,817.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	502,532.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	34,297.85
其他	1,747.86
合计	538,578.65

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	559,851,501.12
减：卖出股票成本总额	449,221,392.55

买卖股票差价收入	110,630,108.57
----------	----------------

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末进行贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,707,524.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,707,524.05

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	187,554,212.36
——股票投资	187,554,212.36
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	187,554,212.36

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无基金赎回费、转出补偿费等其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,445,463.61
银行间市场交易费用	-
合计	1,445,463.61

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	99,177.14
银行费用	5,969.38
帐户维护费	9,000.00
合计	153,818.10

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的日后事项。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	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”）	托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券	557,160,995.66	50.97%	524,321,517.65	54.53%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
东方证券	655,700,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券	407,442.86	51.66%	1,386,656.71	88.70%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东方证券	383,436.37	55.22%	740,882.94	70.43%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

2、截止报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

6.4.10.2 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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,714,007.10	4,351,454.95
其中：支付销售机构的客户维护费	3,089,060.70	2,348,108.95

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

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金基本管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金基本管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、基金管理人的附加管理费

1) 基金管理人提取附加管理费的条件

① 符合基金收益分配条件

②每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，管理人才能收取附加管理费，附加管理费按照下述公式计算并收取。

③同时满足上述条件时，管理人方可提取超额收益的 15%作为附加管理费。

④提取评价日：每次基金封闭期的最后一个工作日 本基金本报告期末及上年度可比期间，未提取附加管理费。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,428,501.80	1,087,863.74

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 1 月 21 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	9,854,466.75	9,854,466.75
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,854,466.75	9,854,466.75
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.47%	1.47%

注：本基金管理人运用固有资金于本基金认购期内认购本基金 9,854,466.75 份（其中募集期间利息转增份额 2250 份）。本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	152,413,014.32	502,532.94	156,987,363.06	536,149.94

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

本基金支付给东证期货的交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。本基金本报告期末无应付交易手续费余额。于 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金交易手续费支出 0 元（2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日：交易手续费支出 23,844.29 元）。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，存出保证金不计息。于 2017 年 6 月 30 日，本基金的结算备付金余额为 6,077,376.71 元，无存出保证金余额（2016 年 12 月 31 日：结算备付金余额，6,055,318.59 元，无存出保证金余额）。于 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金当期结算备付金利息收入 21,941.34 元（2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日：结算备付金利息收入 47,496.78 元）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 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	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-

		日	3 日							
300672	国科 微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流 通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达 精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满 电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾 股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流 通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至 2017 年 6 月 30 日止未持有暂时停牌的股票。

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 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责在董事会授权范围内的重大经营项目和创新业务的风险评估；在业务操作层面风险管理职责主要由合规与风险管理部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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，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建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持全部证券在证券交易所上市，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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。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。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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6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	152,413,014.32	-	-	-	-	-	152,413,014.32
结算备付金	7,158,877.30	-	-	-	-	-	7,158,877.30
存出保证金	227,725.78	-	-	-	-	-	227,725.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,176,934,098.97	1,176,934,098.97
应收利息	-	-	-	-	-	32,114.31	32,114.31
资产总计	159,799,617.40	-	-	-	-	1,176,966,213.28	1,336,765,830.68
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,055,214.65	1,055,214.65
应付托管费	-	-	-	-	-	263,803.64	263,803.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,563,224.58	1,563,224.58
其他负债	-	-	-	-	-	138,848.72	138,848.72
负债总计	-	-	-	-	-	3,021,091.59	3,021,091.59
利率敏感度缺口	159,799,617.40	-	-	-	-	1,173,945,121.69	1,333,744,739.09
上年度末 2016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	21,173,778.88	-	-	-	-	-	21,173,778.88
结算备付金	7,602,662.73	-	-	-	-	-	7,602,662.73
存出保证金	183,926.04	-	-	-	-	-	183,926.04
交易性金融资产	-	-	-	-	-	903,236,191.62	903,236,191.62
买入返售金融资产	120,000,000.00	-	-	-	-	-	120,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	90,334.75	90,334.75
资产总计	148,960,367.65	-	-	-	-	903,326,526.37	1,052,286,894.02
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	20,000,000.00	20,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	868,173.82	868,173.82
应付托管费	-	-	-	-	-	217,043.45	217,043.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,132,822.67	1,132,822.67
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00

负债总计	-	-	-	-	22,398,039.94	22,398,039.94
利率敏感度缺口	148,960,367.65	-	-	-	880,928,486.43	1,029,888,854.08

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金未持有交易性债券投资，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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

基金承受的其他市场价格风险，主要是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。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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 2017年6月30日		上年度末 2016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	1,176,934,098.97	88.24	903,236,191.62	87.70
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	1,176,934,098.97	88.24	903,236,191.62	87.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；		
	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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	上升 5%	57,093,084.34	45,021,209.52
	下降 5%	-57,093,084.34	-45,021,209.52

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准对应的股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 百分之九十五		
	2. 观察期 统计日之前的 250 个交易日		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1 天	14,820,119.53	18,804,943.05
	1 周	33,138,794.71	42,049,130.98

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,176,810,415.87 元，属于第二层次的余额为 123,683.10 元，无属于第三层次的余额；于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产中属于第一层次的余额为 903,184,424.52 元,属于第二层次的余额为 51,767.10 元,无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本基金采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值,并将相关债券的公允价值确定为第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定:(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益),不征收增值税;(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期,不属于金融商品转让;(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外,根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管

理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,176,934,098.97	88.04
	其中：股票	1,176,934,098.97	88.04
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	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	159,571,891.62	11.94
7	其他各项资产	259,840.09	0.02
8	合计	1,336,765,830.68	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	18,795,522.50	1.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,008,097,661.84	75.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,270,320.00	0.40
E	建筑业	38,778.24	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	72,266,312.49	5.42
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	48,338,990.00	3.62
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	24,118,874.28	1.81
S	综合	-	-
	合计	1,176,934,098.97	88.24

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	2,860,042	123,096,207.68	9.23
2	600887	伊利股份	4,916,854	106,154,877.86	7.96
3	002415	海康威视	3,223,099	104,106,097.70	7.81
4	300408	三环集团	3,764,414	79,015,049.86	5.92
5	002475	立讯精密	2,578,900	75,407,036.00	5.65
6	601318	中国平安	1,452,900	72,078,369.00	5.40
7	600660	福耀玻璃	2,428,662	63,242,358.48	4.74
8	600486	扬农化工	1,493,200	63,027,972.00	4.73
9	600566	济川药业	1,460,196	55,531,253.88	4.16
10	002202	金风科技	3,470,658	53,691,079.26	4.03
11	600196	复星医药	1,455,471	45,105,046.29	3.38
12	600276	恒瑞医药	873,152	44,172,759.68	3.31
13	002311	海大集团	2,302,192	42,061,047.84	3.15
14	600557	康缘药业	2,502,312	41,563,402.32	3.12
15	600426	华鲁恒升	2,887,791	33,902,666.34	2.54
16	300058	蓝色光标	3,459,600	27,054,072.00	2.03
17	600066	宇通客车	1,223,564	26,881,701.08	2.02
18	000681	视觉中国	1,540,158	24,118,874.28	1.81
19	002041	登海种业	1,418,530	18,795,522.50	1.41
20	600138	中青旅	691,900	14,571,414.00	1.09
21	601012	隆基股份	811,833	13,882,344.30	1.04
22	002470	金正大	1,668,708	12,565,371.24	0.94
23	300223	北京君正	460,507	11,213,345.45	0.84
24	002027	分众传媒	487,900	6,713,504.00	0.50
25	300616	尚品宅配	48,400	6,561,104.00	0.49

26	002841	视源股份	86,705	6,435,245.10	0.48
27	601991	大唐发电	1,166,000	5,270,320.00	0.40
28	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
29	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.01
30	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
31	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
32	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
33	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
34	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
35	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
36	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
37	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
38	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
39	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
40	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
41	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
42	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
43	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
44	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
45	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
46	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
47	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
48	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
49	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	300408	三环集团	67,089,236.30	6.51
2	002202	金风科技	60,610,720.53	5.89
3	601318	中国平安	56,452,804.36	5.48
4	600566	济川药业	49,978,687.11	4.85
5	000681	视觉中国	25,859,604.52	2.51
6	002041	登海种业	19,818,979.68	1.92
7	600486	扬农化工	19,292,998.00	1.87

8	000651	格力电器	19,061,777.00	1.85
9	002475	立讯精密	17,750,123.80	1.72
10	000333	美的集团	16,379,878.14	1.59
11	600138	中青旅	15,391,858.00	1.49
12	300058	蓝色光标	14,172,055.00	1.38
13	600196	复星医药	12,902,923.29	1.25
14	002470	金正大	12,564,792.80	1.22
15	300223	北京君正	11,860,905.55	1.15
16	600612	老凤祥	11,305,243.71	1.10
17	600987	航民股份	10,662,470.50	1.04
18	002241	歌尔股份	10,286,706.00	1.00
19	601888	中国国旅	9,538,977.00	0.93
20	601012	隆基股份	8,810,538.02	0.86

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	99,662,048.75	9.68
2	002415	海康威视	78,636,945.31	7.64
3	600309	万华化学	50,389,375.47	4.89
4	600276	恒瑞医药	44,059,712.80	4.28
5	000538	云南白药	33,981,504.57	3.30
6	002073	软控股份	27,926,091.74	2.71
7	600066	宇通客车	26,072,811.26	2.53
8	002475	立讯精密	24,784,471.76	2.41
9	000651	格力电器	24,666,253.67	2.40
10	600108	亚盛集团	21,466,791.00	2.08
11	600196	复星医药	21,256,078.94	2.06
12	002241	歌尔股份	12,117,063.03	1.18
13	600612	老凤祥	12,106,299.94	1.18
14	600987	航民股份	11,604,665.00	1.13
15	600426	华鲁恒升	10,283,853.50	1.00
16	601888	中国国旅	10,116,890.29	0.98
17	601012	隆基股份	9,556,636.05	0.93

18	300257	开山股份	8,790,192.06	0.85
19	600566	济川药业	5,886,035.20	0.57
20	002202	金风科技	5,169,400.00	0.50

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	535,365,087.54
卖出股票收入（成交）总额	559,851,501.12

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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

本基金本报告期末进行股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要

与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金持有的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	227,725.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,114.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	259,840.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
4,656	144,331.17	9,854,466.75	1.47%	662,151,455.07	98.53%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,412,113.28	0.2106%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

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	9,854,466.75	1.47	9,854,466.75	1.47	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	985,491.67	0.15	985,491.67	0.15	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	49,261.08	0.01	49,261.08	0.01	3年
合计	10,889,219.50	1.62	10,889,219.50	1.62	3年

注：上述表格内“占基金总份额比例”计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五

入，故分项之和与合计项之间存在尾差。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 1 月 21 日 ）基金份额总额	672,005,921.82
本报告期期初基金份额总额	672,005,921.82
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
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	672,005,921.82

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是立信会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	557,160,995.66	50.97%	407,442.86	51.66%	-
中信证券	1	535,904,239.68	49.03%	381,189.50	48.34%	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序：（1）选择标准：券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。（2）选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、截至本报告期末，本公司因作为证券公司子公司尚未获得在上海交易所租用其他券商交易单元的资格；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

4、本报告期内本基金租用交易单元的变更情况：新增东吴证券 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
东方证券	-	-	655,700,000.00	100.00%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	上海东方证券资产管理有限公司旗下基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2017 年 1 月 3 日
2	上海东方证券资产管理有限公司	中国证券报、证券时	2017 年 1 月 10 日

	关于增聘东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理的公告	报和公司网站	
3	东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报和公司网站	2017 年 1 月 20 日
4	东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2017 年第 1 号）	中国证券报、证券时报和公司网站	2017 年 3 月 3 日
5	东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）	公司网站	2017 年 3 月 3 日
6	东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年年度报告	公司网站	2017 年 3 月 30 日
7	东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	中国证券报、证券时报和公司网站	2017 年 3 月 30 日
8	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、证券时报和公司网站	2017 年 4 月 12 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2017 年 4 月 20 日
10	东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报和公司网站	2017 年 4 月 21 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金合同》；
- 3、《东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：
www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2017 年 8 月 28 日