

---

东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资  
基金  
2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 27 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 2018 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

---

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>21</b>
6.1 资产负债表.....	21
6.2 利润表.....	22
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23

---

6.4 报表附注.....	24
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>49</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>59</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>

---

11.1 备查文件目录.....	64
11.2 存放地点.....	64
11.3 查阅方式.....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	东方红睿逸定期开放混合
基金主代码	001309
前端交易代码	001309
基金运作方式	契约型、开放式、发起式，本基金以定期开放式运作，即以运作周期和到期开放期相结合的方式运作。
基金合同生效日	2015年6月3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	846,787,405.30份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人获取稳定的投资收益，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以36个月为一个运作周期，以长期投资的理念进行大类资产的配置和个券选择，运用封闭期无流动性需求的优势，同时，充分考虑每个运作周期中期间开放期的安排，在股票的配置上，以时间换空间，采用低风险投资策略，为本基金获得更高的低风险收益；在债券配置上，合理配置久期匹配债券的结构，做好流动性管理，以期获得更高的投资收益。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，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	任莉	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		潘鑫军（授权代表）	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，上海证券报
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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	28,572,003.53
本期利润	9,973,696.82
加权平均基金份额本期利润	0.0143
本期加权平均净值利润率	1.07%
本期基金份额净值增长率	1.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	175,371,437.85
期末可供分配基金份额利润	0.2071
期末基金资产净值	1,129,321,328.62
期末基金份额净值	1.334
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	33.40%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日；“本期”指2018年1月1日-2018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	-2.06%	0.50%	0.31%	0.01%	-2.37%	0.49%
过去三个月	-0.52%	0.50%	0.94%	0.01%	-1.46%	0.49%



过去六个月	1.60%	0.55%	1.90%	0.01%	-0.30%	0.54%
过去一年	11.17%	0.50%	3.90%	0.01%	7.27%	0.49%
过去三年	35.16%	0.43%	12.83%	0.01%	22.33%	0.42%
自基金合同生效起至今	33.40%	0.44%	13.26%	0.01%	20.14%	0.43%

注：1、自基金合同生效日起至今指 2015 年 06 月 03 日-2018 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同中的有关规定，本基金以定期开放方式运作，即以运作周期和到期开放期相结合的方式运作，业绩比较基准为同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。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（ $\text{benchmark}_t$ ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 100\% * [ (t \text{ 日三年期银行定期存款税后收益率} + 1.5\%) / 365 ]$$

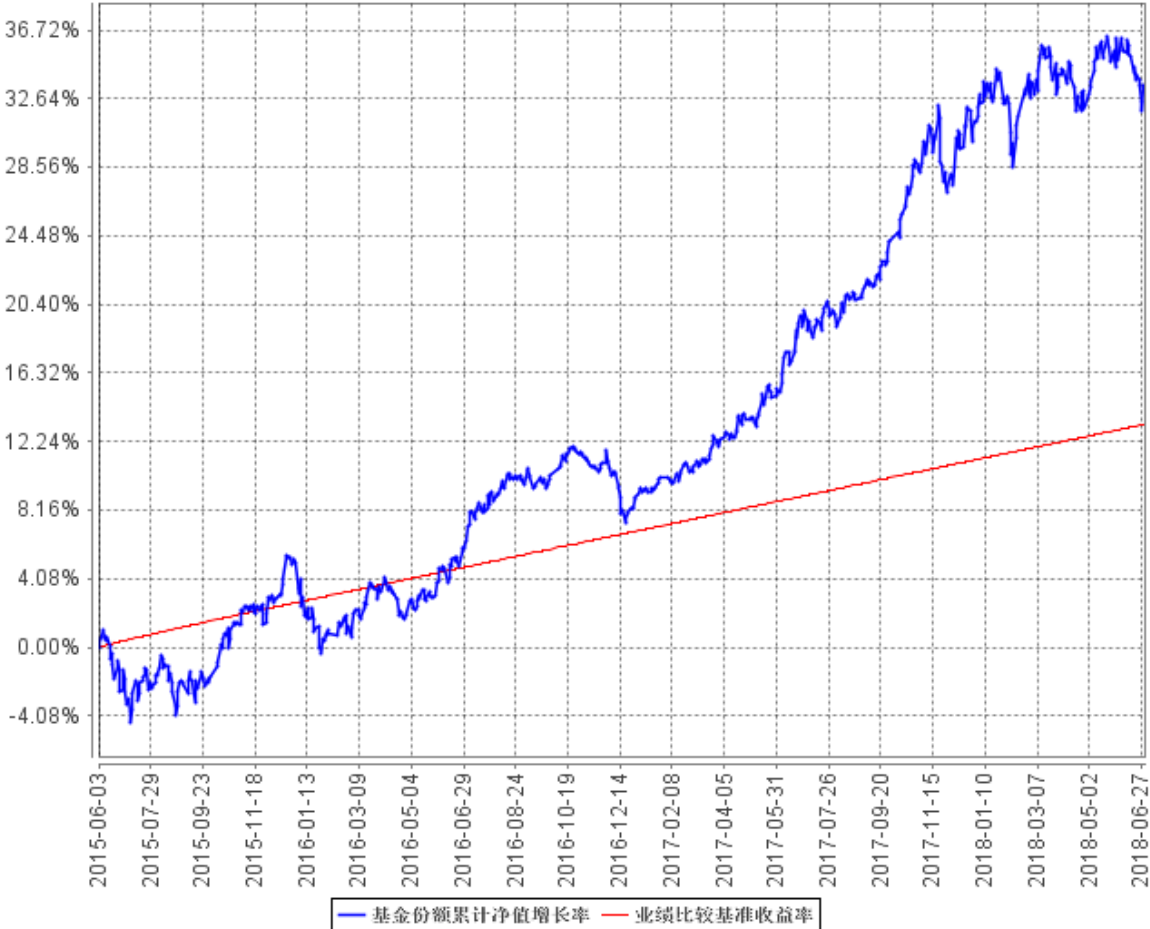
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ，T 表示时间截至日；

t 日至 T 日的期间收益率（ $\text{benchmark}_t^T$ ）按下列公式计算：

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

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示 t 日至 T 日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  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：截止日期为 2018 年 6 月 30 日。

---

## § 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 2018 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（LOF）、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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 6 个月定期开放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、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金三十三只证券投资基金。

#### 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副总经理、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投资基金（LOF）、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红中国优势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	2015年6月3日	2018年6月1日	20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、专户投资部资深投资经理、基金投资部基金经理、执行董事、董事总经理；现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理、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、东方红中国优势混合、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。

	活配置 混合型 证券投资 基金 基金经 理。				
纪文静	上海东 方证券 资产管 理有限 公司公 募固定 收益投 资部副 总经理、 兼任东 方红领 先精选 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 6个月 定期开 放纯债 债券型 发起式 证券投 资基金、 东方红 收益增 强债券 型证	2015年7月14 日	-	11年	硕士，曾任东海证券股份 有限公司固定收益部投资 研究经理、销售交易经理， 德邦证券股份有限公司债 券投资与交易部总经理， 上海东方证券资产管理有 限公司固定收益部副总 监；现任上海东方证券资 产管理有限公司公募固定 收益投资部副总经理兼任 东方红领先精选混合、东 方红稳健精选混合、东 方红睿逸定期开放混合、 东方红6个月定开纯债、 东方红收益增强债券、东 方红信用债债券、东方红 稳添利纯债、东方红战略 精选混合、东方红价值精 选混合、东方红益鑫纯债 债券、东方红智逸沪港深 定开混合、东方红货币基 金经理。具有基金从业资格， 中国国籍。

	券投资基金、东方红信用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、东方红货币市场基金基金经理。				
孔令超	东方红策略精	2018年6月1日	-	7年	硕士，曾任平安证券有限责任公司总部综合研究所

	<p>选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放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、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理。</p>			<p>策略研究员、国信证券股份有限公司经济研究所策略研究员，现任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红目标优选定开混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红创新优选定开混合、东方红配置精选混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。</p>
--	--	--	--	--

---

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 2018 年 6 月 1 日《上海东方证券资产管理有限公司关于东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变更的公告》，自 2018 年 6 月 1 日起，林鹏先生不再担任本基金的基金经理，增聘孔令超为本基金基金经理。

#### **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

权益方面，2018年上半年市场出现了一定幅度的调整，上证综指上半年下跌13.9%，沪深300下跌12.9%，创业板指下跌8.33%。从行业表现来看，休闲服务、医药生物、食品饮料等几个防御性行业出现了正收益。通信、电气设备、机械设备、有色金属等部分行业出现比较大的跌幅。调整的原因来自多个方面：海外方面，伴随开年各个主要经济体经济数据的相对疲软，全球共振复苏的预期开始受到挑战，而贸易战的升温也给经济环境带来的更多的不确定性，对国内权益市场也产生了一定程度的负面影响；国内方面，信用收缩的环境带来了经济预期的下调，违约事件的增多也抑制了市场的风险偏好。本产品在个股选择上以业绩稳健增长且估值合理的优质龙头企业为主，包括消费品行业龙头、竞争优势突出的制造业龙头以及一些受益供给侧收缩的周期性行业龙头等。同时根据宏观环境变化对仓位和配置方向进行适度调整，以起到降低组合波动、提升夏普比例的组合优化作用。

债券方面，2018年上半年经济下行压力逐步体现，中美贸易摩擦持续、信用违约事件不断。“宽货币、紧信用”的政策组合使得债券市场走出了结构性牛市行情：一方面宽松的资金面、基本面下滑的预期以及信用事件下投资者风险偏好的下降都促使利率债及高等级信用债收益率大幅下行；另一方面企业再融资难度加大、投资者结构的变化都使得中低评级信用债信用利差大幅拉升。上半年10年国债收益率下行超50BP，回落至3.5%以下，10年国开收益率下行超100BP，回落至4.1%以下。本产品债券配置上精选个券，有效防范信用风险，调整组合久期和杠杆，力争获取稳定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.334元，份额累计净值为1.334元，本报告期基金份额净值增长率为1.60%，业绩比较基准收益率为1.90%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年基建投资大幅下滑、社融数据大幅回落，叠加贸易战持续发酵，紧信用格局下经济下行压力显现。展望下半年，紧信用政策逐步有边际放松的迹象，社融及基建投资数据有望企稳，制造业投资预计仍能继续低位抬升，地产投资逐步下行。通胀方面，CPI低位平稳，PPI重回下行通道，整体通胀压力有限。

权益方面，展望下半年，我们仍然判断今年股票投资的不确定性仍然要高于去年，但一些积极的因素也在陆续出现。一方面经过上半年的调整，股票的估值水平更具吸引力；另一方面也要

---

关注货币政策的边际变化，对权益市场开始有所支撑。我们仍然坚持价值投资理念，注重自下而上精选个股。主要关注估值合理、基本面稳健的消费类价值股；业绩高增长、估值合理的细分子行业的成长龙头；一些行业处于底部，有望出现反转的优质行业龙头公司；以及一些估值处于历史较低位置，业绩仍有保障的周期类优质龙头。

债券方面，我们认为下半年基本面及货币政策环境均较为有利，宽松的资金面以及较低的回购利率使得债券票息收益更为确定，因此下半年杠杆息差策略将可能为组合提供丰厚的回报。而长端利率债短期或因财政政策加码后经济数据回落不及预期出现小幅波动。虽信用紧缩环境有所放松，但监管趋势未变，操作上仍需精选个券，有效防范信用风险。

#### **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》以及中国证监会于 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《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》和《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等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。基金管理人对外投资品种的估值程序及技术保持一致性原则，为确保估值程序和技术的持续使用性，基金管理人建立了定期复核和审阅机制。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业资格，同时，公司设估值决策小组负责研究、指导和审议基金估值业务，成员包括：公司总经理、合规总监（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，保证基金估值的公平合理，保持估值政策和程序的一贯性。

#### **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，每份基金份额每次收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额截至收益分配基准日可供分配利润的 10%；
  - 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**

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

---

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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：东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	676,273.91	1,174,028.08
结算备付金		16,081,849.23	22,135,091.33
存出保证金		34,746.09	48,084.22
交易性金融资产	6.4.7.2	1,451,153,067.12	1,107,815,047.36
其中：股票投资		287,633,515.94	312,319,835.16
基金投资		-	-
债券投资		1,163,519,551.18	795,495,212.20
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	19,982,149.97	-
应收证券清算款		32,330,445.07	22,006,933.54
应收利息	6.4.7.5	17,768,185.20	12,374,686.39
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		1,538,026,716.59	1,165,553,870.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		406,000,000.00	260,380,000.00
应付证券清算款		-	21,851,671.47
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,365,667.17	1,109,656.77
应付托管费		182,088.96	147,954.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	892,671.47	865,805.80

应交税费		82,218.35	-
应付利息		40,421.72	-43,170.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	142,320.30	280,000.00
负债合计		408,705,387.97	284,591,917.92
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	846,787,405.30	671,118,996.40
未分配利润	6.4.7.10	282,533,923.32	209,842,956.60
所有者权益合计		1,129,321,328.62	880,961,953.00
负债和所有者权益总计		1,538,026,716.59	1,165,553,870.92

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.334 元，基金份额总额 846,787,405.3 份。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		22,073,068.90	97,092,788.85
1.利息收入		16,406,150.59	15,230,478.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	245,777.42	443,891.70
债券利息收入		16,125,598.76	14,785,184.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		34,774.41	1,401.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,188,209.07	15,780,250.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	23,492,540.96	20,277,860.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,947,960.29	-8,249,440.64
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,643,628.40	3,751,830.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-18,598,306.71	65,530,171.61
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	77,015.95	551,888.28
<b>减：二、费用</b>		12,099,372.08	11,035,490.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,923,421.24	6,771,196.11

2. 托管费	6.4.10.2.2	923,122.84	902,826.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	121,563.80	213,631.97
5. 利息支出		3,915,982.45	2,979,546.54
其中：卖出回购金融资产支出		3,915,982.45	2,979,546.54
6. 税金及附加		45,801.23	-
7. 其他费用	6.4.7.20	169,480.52	168,290.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>9,973,696.82</b>	<b>86,057,297.89</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>9,973,696.82</b>	<b>86,057,297.89</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	671,118,996.40	209,842,956.60	880,961,953.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,973,696.82	9,973,696.82
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）	175,668,408.90	62,717,269.90	238,385,678.80
其中：1.基金申购款	381,167,642.92	136,038,648.27	517,206,291.19
2.基金赎回款	-205,499,234.02	-73,321,378.37	-278,820,612.39
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）	846,787,405.30	282,533,923.32	1,129,321,328.62

项目	上年度可比期间 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)	826,753,482.17	73,235,549.17	899,989,031.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	86,057,297.89	86,057,297.89
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)	-155,634,485.77	-25,181,782.11	-180,816,267.88
其中：1.基金申购款	29,722,256.98	5,010,169.70	34,732,426.68
2.基金赎回款	-185,356,742.75	-30,191,951.81	-215,548,694.56
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)	671,118,996.40	134,111,064.95	805,230,061.35

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：

_____ 潘鑫军	_____ 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

东方红睿逸定期开放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[2015]783号《关于准予东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,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》和《东方红睿逸定期开放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人民币1,054,169,974.64元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)信会师报字[2015]第130533号验



---

资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,054,594,202.29 份,其中认购资金利息折合 424,227.65 份基金份额。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。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,004,850.00 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《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以 36 个月为一个运作周期,每个运作周期为自基金合同生效日(包括基金合同生效日)或每个到期开放期结束之日次日起(包括该日)至 36 个月后的月度对日的前一日止。每个运作周期共包含 3 个封闭期和 2 个期间开放期,第一个期间开放期的首日为该运作周期首日的 12 个月后的月度对日,第二个期间开放期的首日为该运作周期首日的 24 个月后的月度对日。在每个运作周期内,除期间开放期以外,均为封闭期。每个运作周期结束后第一个工作日起进入到期开放期,本基金的每个开放期为 5 至 10 个工作日,期间投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红睿逸定期开放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,包括国内依法发行上市的股票(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(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 50%,但在每个期间开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、到期开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期期间,基金投资不受前述比例限制;本基金投资于股票的比例不高于基金资产的 50%。在开放期,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,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,在封闭期,本基金不受前述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日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[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。

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2018年1月1日起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 2018年6月30日
活期存款	676,273.91

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	-
合计：	676, 273. 91

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	193, 130, 188. 03	287, 633, 515. 94	94, 503, 327. 91
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	809, 819, 780. 07	805, 278, 551. 18
	银行间市场	357, 979, 857. 63	358, 241, 000. 00
	合计	1, 167, 799, 637. 70	1, 163, 519, 551. 18
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1, 360, 929, 825. 73	1, 451, 153, 067. 12	90, 223, 241. 39

#### 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 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	19, 982, 149. 97	-
合计	19, 982, 149. 97	-

#### 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从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 2018年6月30日
应收活期存款利息	737.26
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	12,478.04
应收债券利息	17,720,926.68
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	33,890.30
应收申购款利息	137.22
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	15.70
合计	17,768,185.20

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	889,996.50
银行间市场应付交易费用	2,674.97
合计	892,671.47

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	142,320.30
合计	142,320.30

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	671,118,996.40	671,118,996.40
本期申购	381,167,642.92	381,167,642.92
本期赎回(以“-”号填列)	-205,499,234.02	-205,499,234.02
本期末	846,787,405.30	846,787,405.30

### 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	111,148,190.56	98,694,766.04	209,842,956.60
本期利润	28,572,003.53	-18,598,306.71	9,973,696.82
本期基金份额交易产生的变动数	35,651,243.76	27,066,026.14	62,717,269.90
其中：基金申购款	77,392,530.02	58,646,118.25	136,038,648.27
基金赎回款	-41,741,286.26	-31,580,092.11	-73,321,378.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	175,371,437.85	107,162,485.47	282,533,923.32

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	91,104.49
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	154,221.12
其他	451.81
合计	245,777.42

### 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
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	49,241,916.12
减：卖出股票成本总额	25,749,375.16
买卖股票差价收入	23,492,540.96

### 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

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6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	-1,947,960.29
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	-1,947,960.29

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	515,652,956.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	505,969,103.80
减：应收利息总额	11,631,813.24
买卖债券差价收入	-1,947,960.29

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,643,628.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,643,628.40

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-18,598,306.71
——股票投资	-30,803,651.31
——债券投资	12,205,344.60
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-18,598,306.71

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	77,015.95
合计	77,015.95

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	117,976.30
银行间市场交易费用	3,587.50
合计	121,563.80

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	43,143.16
信息披露费	99,177.14
其他	600.00
银行费用	8,560.22
帐户维护费	18,000.00
合计	169,480.52

## 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

截至财务报表报出日，本基金并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
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”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	73,257,688.59	92.97%	65,431,589.51	50.06%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	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 成交总额的比例
东方证券	663,963,095.71	81.44%	555,207,962.21	88.75%

#### 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	19,210,800,000.00	97.57%	19,554,500,000.00	99.98%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 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 2018年1月1日至2018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	53,571.06	93.15%	886,058.03	99.56%
关联方名称	上年度可比期间 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	47,846.87	50.75%	810,279.92	96.42%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

## 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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,923,421.24	6,771,196.11
其中：支付销售机构的客户维护费	3,462,646.02	3,319,779.43

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

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，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、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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	923,122.84	902,826.11

注：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：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

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

#### 6.4.10.4 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
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日（2015年6月3日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,004,850.00	10,004,850.00
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	10,004,850.00	10,004,850.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.1800%	1.4900%

注：基金管理人运用固有资金于2015年5月18日认购东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金，按照招募说明书规定，认购费1000元。

##### 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

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以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	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017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	676,273.91	91,104.49	15,191,672.17	297,170.16

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

本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 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期货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。本基金本报告期末及上年度末无应付交易手续费余额。本报告期及上年可比期间本基金无交易手续费支出。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金的结算备付金余额为 1,136.34 元，无存出保证金余额(2017 年 12 月 31 日：结算备付金 1,132.21 元，无存出保证金余额)。于 2018 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金结算备付金利息收入 4.11 元(上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日，本基金结算备付金利息收入 4.08 元)。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018 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
603693	江苏新能	2018 年 6 月 25 日	2018 年 7 月 3 日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018 年 6 月 29 日	2018 年 7 月 9 日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受

---

让的股份。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末股票中不存在暂时停牌等流通受限的情况。

#### **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 2018 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 2018 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 406,000,000.00 元，于 2018 年 07 月 02 日、07 月 04 日、07 月 18 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### **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，负责督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案等。

##### **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，

且通过分散化投资以分散信用风险。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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	9,995,000.00	-
合计	9,995,000.00	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为期限在一年以内的国债、政策性金融、央票及未有第三方机构评级的其它债券。

3、本期末未评级债券中，包含国债、政策性金融债及央票 0.00 元，其他未评级债券 9,995,000.00 元。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	551,467,404.70	325,867,606.00
AAA 以下	497,187,146.48	411,729,606.20
未评级	104,870,000.00	57,898,000.00
合计	1,153,524,551.18	795,495,212.20

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级中包含期限在一年以上的国债、政策性金融债、央票以及未有第三方机构评级的其他债券。

3、本期末未评级债券中，包含政策性金融债 104,870,000.00 元。



---

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金在本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金在本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### **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于开放日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于每个开放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。

于 2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 406,000,000.00 元将在 1 个月内以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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，因此账面余额约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，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，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该比例限制)。

---

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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%。

于开放期内，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。

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会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。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### **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。

本基金可以投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。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、债券投资及资产支持证券投资等。

### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	676,273.91	-	-	-	-	-	676,273.91
结算备付金	16,081,849.23	-	-	-	-	-	16,081,849.23
存出保证金	34,746.09	-	-	-	-	-	34,746.09
交易性金融资产	40,204,000.00	85,747,788.50	339,422,476.00	547,738,009.70	150,407,276.98	287,633,515.94	1,451,153,067.12
买入返售金融资产	19,982,149.97	-	-	-	-	-	19,982,149.97
应收证券清算款	-	-	-	-	-	32,330,445.07	32,330,445.07
应收利息	-	-	-	-	-	17,768,185.20	17,768,185.20
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	76,979,019.20	85,747,788.50	339,422,476.00	547,738,009.70	150,407,276.98	337,732,146.21	1,538,026,716.59
负债							
卖出回购金融资产款	406,000,000.00	-	-	-	-	-	406,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,365,667.17	1,365,667.17
应付托管费	-	-	-	-	-	182,088.96	182,088.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	892,671.47	892,671.47
应付利息	-	-	-	-	-	40,421.72	40,421.72
应交税费	-	-	-	-	-	82,218.35	82,218.35

其他负债	-	-	-	-	-	142,320.30	142,320.30
负债总计	406,000,000.00	-	-	-	-	2,705,387.97	408,705,387.97
利率敏感度缺口	-329,020,980.80	85,747,788.50	339,422,476.00	547,738,009.70	150,407,276.98	335,026,758.24	1,129,321,328.62
上年度末 2017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	1,174,028.08	-	-	-	-	-	1,174,028.08
结算备付金	22,135,091.33	-	-	-	-	-	22,135,091.33
存出保证金	48,084.22	-	-	-	-	-	48,084.22
交易性金融资产	5,974,200.00	30,509,150.00	278,611,143.20	415,711,119.00	64,689,600.00	312,319,835.16	1,107,815,047.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,006,933.54	22,006,933.54
应收利息	-	-	-	-	-	12,374,686.39	12,374,686.39
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	29,331,403.63	30,509,150.00	278,611,143.20	415,711,119.00	64,689,600.00	346,701,455.09	1,165,553,870.92
负债							
卖出回购金融资产款	260,380,000.00	-	-	-	-	-	260,380,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	21,851,671.47	21,851,671.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,109,656.77	1,109,656.77
应付托管费	-	-	-	-	-	147,954.26	147,954.26
应付交	-	-	-	-	-	865,805.80	865,805.80

易费用							
应付利息						-43,170.38	-43,170.38
其他负债						280,000.00	280,000.00
负债总计	260,380,000.00					24,211,917.92	284,591,917.92
利率敏感度缺口	-231,048,596.37	30,509,150.00	278,611,143.20	415,711,119.00	64,689,600.00	322,489,537.17	880,961,953.00

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金于本报告期末的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	上升 0.25%	-8,803,825.58	-5,098,747.84
	下降 0.25%	8,940,129.74	5,098,747.84

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 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

本基金承受的其他价格风险，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其他价格风险管理。

#### 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 2018年6月30日		上年度末 2017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	287,633,515.94	25.47	312,319,835.16	35.45
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	287,633,515.94	25.47	312,319,835.16	35.45

#### 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。		
	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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
分析	上升5%	16,717,733.75	19,409,236.81
	下降5%	-16,717,733.75	-19,409,236.81

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型(CAPM)对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他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		
	风险价值 (单位：人民币元)	本期末(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
分析	1天	12,614,438.15	6,261,717.68
	1周	33,351,155.56	14,001,626.39

---

#### 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 2018 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 344,630,066.97 元，属于第二层次的余额为 1,106,523,000.15 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 341,902,652.96 元，第二层次 765,912,394.40 元，无第三层次)。

##### (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，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 2018 年 6 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

---

(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	287,633,515.94	18.70
	其中：股票	287,633,515.94	18.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,163,519,551.18	75.65
	其中：债券	1,163,519,551.18	75.65
	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	19,982,149.97	1.30
	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	16,758,123.14	1.09
8	其他各项资产	50,133,376.36	3.26
9	合计	1,538,026,716.59	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	286,963,034.95	25.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-

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	67,537.05	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	450,157.95	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
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	287,633,515.94	25.47

### 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	002311	海大集团	1,877,196	39,608,835.60	3.51
2	000333	美的集团	705,970	36,865,753.40	3.26
3	600196	复星医药	834,082	34,522,653.98	3.06
4	002475	立讯精密	1,390,304	31,337,452.16	2.77
5	300616	尚品宅配	270,000	29,430,000.00	2.61
6	002415	海康威视	776,199	28,820,268.87	2.55
7	600741	华域汽车	1,078,798	25,589,088.56	2.27
8	600887	伊利股份	823,439	22,973,948.10	2.03
9	600426	华鲁恒升	1,299,884	22,864,959.56	2.02
10	600031	三一重工	1,000,000	8,970,000.00	0.79
11	600066	宇通客车	122,842	2,357,337.98	0.21
12	600104	上汽集团	57,800	2,022,422.00	0.18

13	002470	金正大	200,700	1,380,816.00	0.12
14	603259	药明康德	4,741	450,157.95	0.04
15	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.01
16	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
17	300166	东方国信	4,585	67,537.05	0.01
18	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.00
19	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.00
20	600019	宝钢股份	3,600	28,044.00	0.00
21	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
22	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	600741	华域汽车	27,783,312.65	3.15
2	600104	上汽集团	1,769,322.00	0.20
3	002926	华西证券	282,324.24	0.03
4	300750	宁德时代	257,961.54	0.03
5	600901	江苏租赁	155,843.75	0.02
6	601828	美凯龙	134,064.15	0.02
7	603259	药明康德	102,405.60	0.01
8	300741	华宝股份	101,325.00	0.01
9	601838	成都银行	89,465.01	0.01
10	002925	盈趣科技	68,670.00	0.01
11	603587	地素时尚	67,203.84	0.01
12	300737	科顺股份	61,023.35	0.01
13	300747	锐科激光	58,803.73	0.01
14	002929	润建通信	51,540.40	0.01
15	603693	江苏新能	48,456.00	0.01
16	300454	深信服	48,232.28	0.01
17	603680	今创集团	47,171.67	0.01
18	300504	天邑股份	39,989.72	0.00

19	300740	御家汇	39,615.18	0.00
20	601990	南京证券	38,771.70	0.00

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	600887	伊利股份	32,328,666.58	3.67
2	600196	复星医药	8,890,297.85	1.01
3	300166	东方国信	2,119,438.08	0.24
4	300750	宁德时代	672,095.50	0.08
5	002926	华西证券	471,236.76	0.05
6	601828	美凯龙	297,350.09	0.03
7	600901	江苏租赁	265,059.05	0.03
8	002925	盈趣科技	245,716.52	0.03
9	002920	德赛西威	200,579.10	0.02
10	601838	成都银行	194,288.82	0.02
11	300454	深信服	189,753.20	0.02
12	300741	华宝股份	146,475.00	0.02
13	603486	科沃斯	130,717.86	0.01
14	300737	科顺股份	129,013.91	0.01
15	300504	天邑股份	125,848.20	0.01
16	300634	彩讯股份	109,691.40	0.01
17	300735	光弘科技	109,156.00	0.01
18	603587	地素时尚	109,059.72	0.01
19	002929	润建通信	106,750.37	0.01
20	603712	七一二	105,510.70	0.01

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	31,866,707.25
卖出股票收入（成交）总额	49,241,916.12

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

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	346,025,000.00	30.64
	其中：政策性金融债	104,870,000.00	9.29
4	企业债券	491,026,770.00	43.48
5	企业短期融资券	9,995,000.00	0.89
6	中期票据	209,983,000.00	18.59
7	可转债（可交换债）	106,489,781.18	9.43
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,163,519,551.18	103.03

### 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	180205	18 国开 05	1,000,000	104,870,000.00	9.29
2	101800522	18 苏交通 MTN001	500,000	50,075,000.00	4.43
3	136501	16 天风 01	500,000	49,120,000.00	4.35
4	101553022	15 苏州高新 MTN001	400,000	40,328,000.00	3.57
5	136519	16 陆嘴 01	400,000	39,280,000.00	3.48

### 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	34,746.09
2	应收证券清算款	32,330,445.07
3	应收股利	-
4	应收利息	17,768,185.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,133,376.36

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132006	16 皖新 EB	8,945,100.00	0.79
2	120001	16 以岭 EB	6,424,600.00	0.57
3	128010	顺昌转债	3,903,600.00	0.35
4	123003	蓝思转债	3,698,800.00	0.33
5	110040	生益转债	2,986,800.00	0.26
6	128032	双环转债	2,892,667.14	0.26
7	113014	林洋转债	2,707,200.00	0.24
8	128027	崇达转债	2,297,800.00	0.20
9	128016	雨虹转债	2,076,400.00	0.18

---

#### **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
15,431	54,875.73	10,186,681.93	1.20%	836,600,723.37	98.80%

### 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	47,978.20	0.0100%

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 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	10,004,850.00	1.18	10,004,850.00	1.18	3年
基金管理人高 级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人 员	-	-	-	-	-
基金管理人股	-	-	-	-	-

---

东					
其他	-	-	-	-	-
合计	10,004,850.00	1.18	10,004,850.00	1.18	3年

注：截止本报告期末，本基金发起式份额持有期限已满3年（承诺持有期限为2015年6月3日至2018年6月3日）。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月3日）基金份额总额	1,054,594,202.29
本报告期期初基金份额总额	671,118,996.40
本报告期基金总申购份额	381,167,642.92
减：本报告期基金总赎回份额	205,499,234.02
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	846,787,405.30

## § 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

本基金管理人于 2018 年 3 月 8 日发布公告，陈光明同志自 2018 年 3 月 7 日起辞去公司董事长职务，由潘鑫军同志担任公司董事长职务；于 2018 年 5 月 11 日发布公告，林鹏同志自 2018 年 5 月 10 日起任职公司副总经理职务。

本报告披露日前，本基金管理人于 2018 年 7 月 21 日发布公告，唐涵颖同志自 2018 年 7 月 20 日起离任公司督察长职务，由任莉同志代为履行公司督察长职务。

本报告期内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为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自 2017 年度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	73,257,688.59	92.97%	53,571.06	93.15%	-
宏信证券	1	5,536,862.18	7.03%	3,938.47	6.85%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	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为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

### （2）选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本基金在本报告期新增租用交易席位情况：新增天风证券 1 个交易单元。

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	663,963,095.71	81.44%	19,210,800,000.00	97.57%	-	-
宏信证券	151,310,925.91	18.56%	478,500,000.00	2.43%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

## 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 2017 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	2018 年 1 月 2 日
2	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2018 年第 1 号）	公司网站	2018 年 1 月 11 日
3	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）（2018 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报和公司网站	2018 年 1 月 11 日
4	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2018 年 1 月 19 日
5	上海东方证券资产管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018 年 3 月 8 日
6	关于上海东方证券资产管理有限公司旗下部分基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018 年 3 月 23 日
7	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同	公司网站	2018 年 3 月 23 日
8	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议	公司网站	2018 年 3 月 23 日
9	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年年度报告	公司网站	2018 年 3 月 29 日
10	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报和公司网站	2018 年 3 月 29 日
11	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2018 年 4 月 23 日
12	上海东方证券资产管理有限公司关于新增基金高级管理人员的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2018 年 5 月 11 日
13	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务及暂停大额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2018 年 5 月 30 日
14	上海东方证券资产管理有限公司关于东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变	中国证券报、上海证券报和公司网站	2018 年 6 月 1 日

---

	更的公告		
15	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	2018年6月20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逸定期开放混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿逸定期开放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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2018 年 8 月 27 日