

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型 证券投资基金(原东方红睿阳灵活配置混 合型证券投资基金(LOF))2019年半年度 报告

2019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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2019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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

自 2019 年 1 月 16 日起，《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》同时失效，东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）正式转型为东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，同时将基金名称由“东方红睿阳沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”变更为“东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金”，基金合同当事人将按照《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

基金转型前：报告期 2019 年 1 月 1 日-2019 年 1 月 15 日

基金转型后：报告期 2019 年 1 月 16 日-2019 年 6 月 30 日。

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（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	7
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§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(转型后).....	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前).....	9
3.2 基金净值表现（转型后）	9
3.2 基金净值表现（转型前）	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	46
6.1 资产负债表	46

6.2 利润表	47
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	48
6.4 报表附注	50
§7 投资组合报告（转型后）	71
7.1 期末基金资产组合情况	71
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	72
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	73
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
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	75
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	75
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	75
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	75
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
7.12 投资组合报告附注	76
§7 投资组合报告（转型前）	77
7.1 期末基金资产组合情况	77
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	77
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	78
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	80
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	80
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	81
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	81
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	81
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	81
7.12 投资组合报告附注	81
§8 基金份额持有人信息（转型后）	82
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
8.2 期末上市基金前十名持有人	82
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	83
§8 基金份额持有人信息（转型前）	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
8.2 期末上市基金前十名持有人	83
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	84
§9 开放式基金份额变动（转型后）	84
§9 开放式基金份额变动（转型前）	84

§10 重大事件揭示	85
10.1 基金份额持有人大会决议	85
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.....	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
10.4 基金投资策略的改变	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
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.....	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	86
10.8 其他重大事件(转型后)	87
10.8 其他重大事件(转型前)	88
§11 影响投资者决策的其他重要信息	88
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	88
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§12 备查文件目录	89
12.1 备查文件目录	89
12.2 存放地点	89
12.3 查阅方式	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	东方红睿阳三年定开
场内简称	东证睿阳
基金主代码	169102
前端交易代码	169102
基金运作方式	契约型，本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。
基金合同生效日	2019 年 1 月 16 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	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,115,519,706.08 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 31 日

注：东方红睿阳沪港深灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 于 2019 年 1 月 16 日变更注册为东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	东方红睿阳混合
场内简称	东证睿阳
基金主代码	169102
前端交易代码	169102
基金运作方式	契约型，本基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式。
基金合同生效日	2015 年 1 月 19 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	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,130,881,034.91 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 31 日

注：东方红睿阳沪港深灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 于 2019 年 1 月 16 日变更注册为东方红

睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金在严格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	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，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。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.2 基金产品说明（转型前）

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	本基金在封闭期内的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率(税后)； 本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。
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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李云亮	石立平
	联系电话	021-63325888	010-63639180
	电子邮箱	service@dfham.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4009200808	95595

传真	021-63326981	010-63639132
注册地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	200010	100033
法定代表人	潘鑫军	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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 中国光大银行股份有限公司 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

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(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月16日(基金合同生效日) - 2019年6月30日)
本期已实现收益	45,350,080.63
本期利润	123,232,258.89
加权平均基金份额本期利润	0.1105
本期加权平均净值利润率	9.83%
本期基金份额净值增长率	11.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	125,677,423.43
期末可供分配基金份额利润	0.1127
期末基金资产净值	1,241,197,129.51
期末基金份额净值	1.1127
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	11.05%

注:1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、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）。

4、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2019 年 6 月 30 日；“本期”指 2019 年 1 月 16 日-2019 年 6 月 30 日。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年1月15日)
本期已实现收益	-418,164.29
本期利润	17,901,616.73
加权平均基金份额本期利润	0.0237
本期加权平均净值利润率	2.39%
本期基金份额净值增长率	1.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年1月15日)
期末可供分配利润	2,475,887.18
期末可供分配基金份额利润	0.0022
期末基金资产净值	1,133,356,922.09
期末基金份额净值	1.002
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年1月15日)
基金份额累计净值增长率	73.79%

注:1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、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）。

4、表中的“期末”指 2019 年 1 月 15 日；“本期”指 2019 年 1 月 1 日-2019 年 1 月 15 日。

3.2 基金净值表现（转型后）

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	5.88%	1.26%	4.56%	0.85%	1.32%	0.41%
过去三个月	-8.03%	1.69%	-1.03%	1.05%	-7.00%	0.64%
自基金合同生效起至今	11.05%	1.59%	14.43%	1.08%	-3.38%	0.51%

注:1、自基金合同生效日起至今指 2019 年 1 月 16 日-2019 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中国债券总指数收益率×20%。

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 (benchmarkt) 按下列公式计算:

$$\text{benchmarkt} = 60\% \times [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 20\% \times [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1 日恒生指数}) - 1] + 20\% \times [\text{t 日中国债券总指数} / (\text{t-1 日中国债券总指数}) - 1];$$

其中, t=1, 2, 3, . . . T, T 表示时间截至日;

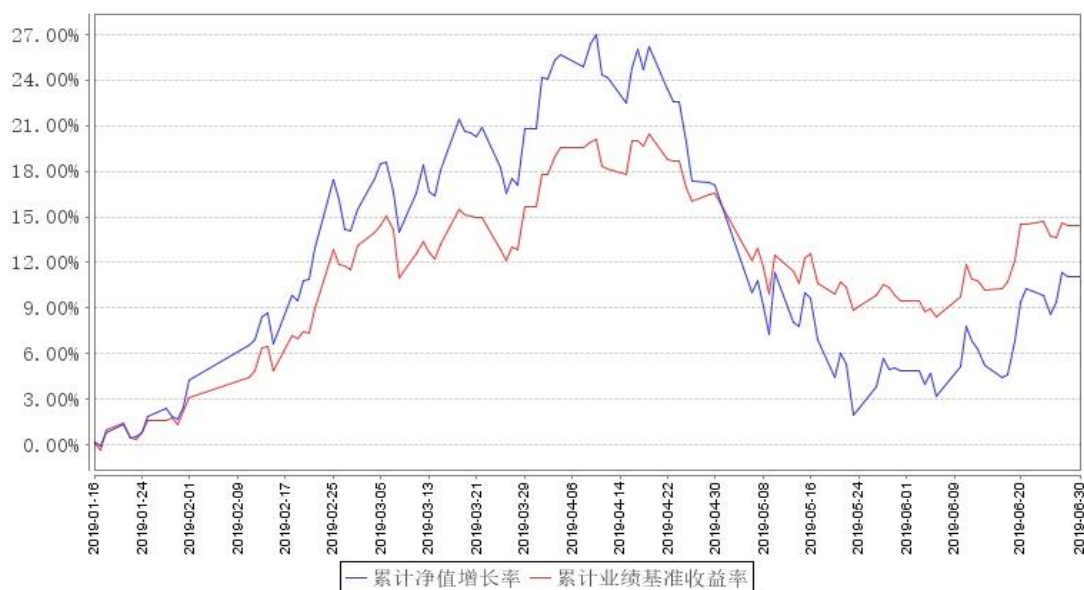
t 日至 T 日的期间收益率 (benchmarkTt) 按下列公式计算:

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

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

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

东方红睿阳三年定开累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:1、截止日期为 2019 年 06 月 30 日。

2、本基金于 2019 年 1 月 16 日转型为“东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金”

金”，新基金合同生效日至今不满一年。

3.2 基金净值表现（转型前）

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	-3.75%	0.80%	0.03%	0.80%	-3.78%	0.00%
过去三个月	-4.84%	1.59%	1.60%	1.02%	-6.44%	0.57%
过去六个月	-24.89%	1.63%	-5.77%	1.03%	-19.12%	0.60%
过去一年	-28.58%	1.55%	-17.07%	0.95%	-11.51%	0.60%
过去三年	36.52%	1.19%	-12.65%	0.55%	49.17%	0.64%
自基金合同生效起至今	73.79%	1.45%	-9.78%	0.48%	83.57%	0.97%

注：1、自基金合同生效日起至今指 2015 年 1 月 19 日-2019 年 1 月 15 日。

2、根据基金合同有关规定，本基金合同生效后三年内（含三年）为封闭期，本基金在封闭期内的业绩比较基准为：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；本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

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：

$$\text{benchmark}_t = 70\% * [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 30\% * [\text{t 日中国债券总指数} / (\text{t-1 日中国债券总指数}) - 1]$$

其中，t=1, 2, 3, . . . T, T 表示时间截至日；

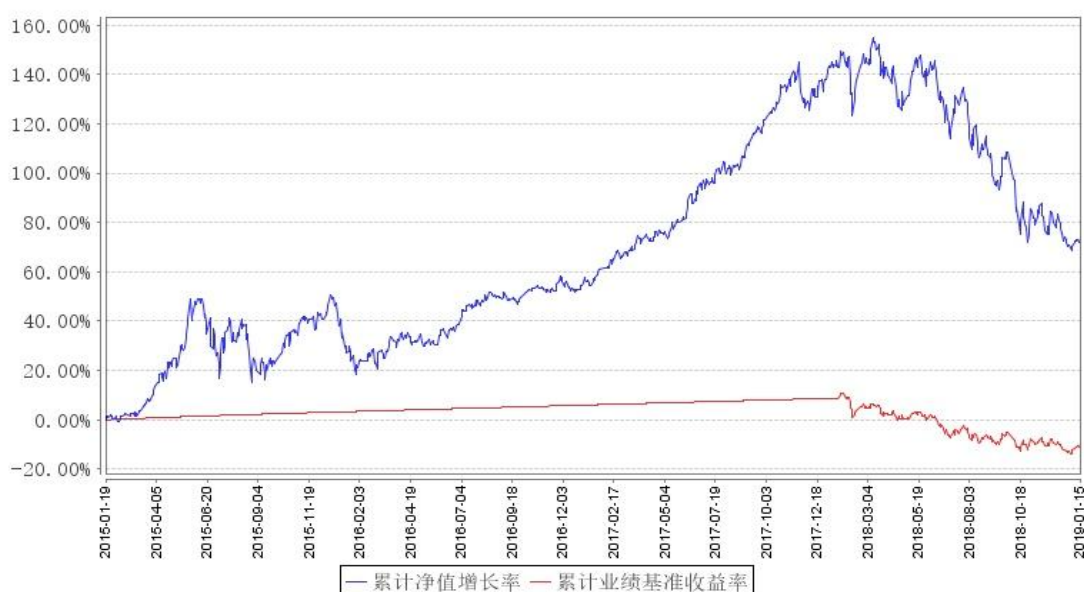
t 日至 T 日的期间收益率（benchmark_{Tt}）按下列公式计算：

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

其中，T=2, 3, 4, . . . ； $\prod_{t=T}^t (1 + \text{benchmark}_t)$ 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

东方红睿阳混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:截止日期为 2019 年 01 月 15 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 2019 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)、东方红睿阳三年定期开放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 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、东方红睿轩三年定期开放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（LOF）、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、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金三十五只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
秦绪文	上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿阳三年定期开放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基金经理。	2017年1月10日	-	12	硕士，曾任平安证券有限公司证券研究所分析师，东方证券股份有限公司证券研究所董事、汽车行业分析师，上海东方证券资产管理有限公司研究部资深研究员、权益研究部资深研究员；现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿阳三年定开混合、东方红沪港深混合基金经理。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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
秦绪文	上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿阳三年定期开放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基金经理。	2017年1月10日	-	12	硕士，曾任平安证券有限公司证券研究所分析师，东方证券股份有限公司证券研究所董事、汽车行业分析师，上海东方证券资产管理有限公司研究部资深研究员、权益研究部资深研究员；现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿阳三年定开混合、东方红沪港深混合基金经理。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。

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》的规定。

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

由于中国全社会杠杆率在 2019 年 1 季度再度显著上升，4 月份的中央经济工作会议再度强调经济去杠杆。市场预期流动性将再度趋紧；5 月初，中美贸易摩擦再度升温；包商银行事件，导致国内金融机构信用等级出现显著分层。上述因素，导致市场的风险偏好大幅度下降。同时，经过 1 季度的大幅度反弹，各个板块的估值水平较 2018 年年底显著提升。

从 4 月中下旬开始，市场开始震荡下行，并且这种走势几乎贯穿整个 2 季度。

2019 年 2 季度，上证综指下跌 3.6%，深证综指下跌 7.2%，沪深 300 下跌 1.2%，中证 1000 下跌 10.0%。板块方面，食品饮料板块涨幅 12.1%，家电行业板块涨幅 2.5%，银行板块涨幅 1.3%。2 季度，食品饮料行业板块超额收益非常明显。

对贸易战的担忧，叠加对宏观经济走势的迷茫，投资者对风险的厌恶程度不断提升，对确定性的追求达到空前的高度，表现在股票市场走势上就是资金对业绩增长确定性高的股票的追捧，大量资金向这类股票上抱团。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型前：截至 2019 年 1 月 15 日（报告期 2019.1.1-2019.1.15），原东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）份额净值为 1.002 元，份额累计净值为 1.728 元，报告期内份额净值增长率为 1.73%，同期业绩比较基准增长率为 3.15%。

转型后：截至 2019 年 6 月 30 日（报告期 2019.1.16-2019.6.30），东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 1.1127 元，份额累计净值为 1.8387 元，报告期内份额净值增长率为 11.05%，同期业绩比较基准增长率为 14.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年，大部分行业板块都出现了明显的回撤，资金都向食品饮料板块等盈利确定性高的行业集中。这本质上源于投资者对没有强刺激的中国经济增长方式的迷茫。

我们依然对中国经济的未来充满信心：中国有稳定的政局，庞大的内需，已经到来的工程师红利，已经开始多年的供给侧改革。不同于过去放水刺激经济，新的经济增长动能需要培育，这需要时间。

我们组合内的重仓公司，在各自的领域里竞争优势明显。虽然各个行业的需求会周期性波动，但是我们坚信我们的重仓公司能穿越周期，业绩再度创出新高，并且这些公司目前的估值水平也非常有吸引力。我们坚信这些公司会给我们的组合贡献不错的回报。

我们将紧密跟踪持仓标的所在行业的基本面的周期位置、相关标的的风险收益比，严守估值纪律，动态调整组合配置，将组合的风险收益比控制在相对较好的水平。继续坚持价值投资的理念，努力为基金持有人创造价值。

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》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。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员由投资、研究、运营、合规、风控等相关业务分管领导组成，运营业务分管领导为估值委员会主任委员，运营部是估值委员会的日常办事机构，运营部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。对于基金特殊估值调整事项，由估值委员会下设的估值业务工作小组提出调整方案并提交估值委员会审议，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，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 3、本基金收益分配方式仅现金分红一种方式；
- 4、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；
- 5、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。

本基金的收益分配符合相关法律法规及《基金合同》约定。

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

本基金报告期内，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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	86,713,639.40
结算备付金		438,276.14
存出保证金		577,992.25
交易性金融资产	6.4.7.2	1,157,690,474.37
其中：股票投资		1,157,690,474.37
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	17,156.66
应收股利		1,512,676.00
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,246,950,214.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 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		3,188.27
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,469,934.06
应付托管费		244,989.01
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	3,913,423.71
应交税费		75.56
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	121,474.70
负债合计		5,753,085.31
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,115,519,706.08
未分配利润	6.4.7.10	125,677,423.43
所有者权益合计		1,241,197,129.51
负债和所有者权益总计		1,246,950,214.82

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1127 元，基金份额总额 1,115,519,706.08 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		134,759,738.58
1. 利息收入		779,516.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	447,246.08
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		332,270.46
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		56,092,860.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	43,138,687.24
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	-
股利收益	6.4.7.16	12,954,173.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	77,882,178.26
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	5,183.49
减：二、费用		11,527,479.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,532,384.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,422,064.24
3. 销售服务费		-

4. 交易费用	6. 4. 7. 19	1, 455, 706. 30
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	117, 324. 20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		123, 232, 258. 89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		123, 232, 258. 89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 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）	1, 130, 881, 034. 91	2, 475, 887. 18	1, 133, 356, 922. 09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	123, 232, 258. 89	123, 232, 258. 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）	-15, 361, 328. 83	-30, 722. 64	-15, 392, 051. 47
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-15, 361, 328. 83	-30, 722. 64	-15, 392, 051. 47
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, 115, 519, 706. 08	125, 677, 423. 43	1, 241, 197, 129. 51

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：

<u>潘鑫军</u>	<u>任莉</u>	<u>詹朋</u>
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

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)转型而来。东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)是由原东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。东方红睿阳灵活配置混合型证券投资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[2014]1293号《关于准予东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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》和《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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人民币 530,335,748.32 元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)信会师报字(2015)第 130011 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 530,480,573.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 144,825.06 份基金份额。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]363 号核准,原基金 16,114,191.00 份基金份额于 2015 年 7 月 31 日在深交所挂牌交易。对于托管在场外的基金份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内即可上市流通。

根据《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,原基金封闭期自基金合同生效之日起至三年后对应日前一个工作日止。原基金在封闭期内不开放申购、赎回业务,但投资人可在原基金上市交易后通过深交所转让基金份额。封闭期届满后,原基金转换为上市开放式基金(LOF),继续在深交所上市交易。

根据《关于东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金转为上市开放式基金(LOF)并变更基金名称的公告》,原基金自 2018 年 1 月 19 日起正式转型为上市开放式基金(LOF)。

东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会自 2018 年 11 月 20 日至 2018 年 12 月 13 日止以通讯方式召开,会议审议通过了《关于东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)转型及修改基金合同有关事项的议案》,决议生效并经中国证监会备案。《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2019 年 1 月 16 日起生效,同时《东

方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》失效，东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）正式变更为东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为基金合同生效日所对应的第三年年度对应日前的倒数第一个工作日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日，结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第三年年度对应日前的倒数第一个工作日，依此类推。本基金自封闭期结束之后的第一个工作日起（即每个封闭期起始之日的第三年年度对应日的第一个工作日，包括该日）进入开放期，期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上不少于 5 个工作日且最长不超过 20 个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型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）、港股通标的股票、债券（包括国债、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、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券）、债券回购、同业存单、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，本基金的基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。在开放期内，股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%—50%），封闭期内股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%—50%）；权证投资比例为基金资产净值的 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。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×60%+恒生指数收益率×20%+中国债券总指数收益率×20%。

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》、《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、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于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2019 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金合同于 2019 年 1 月 16 日生效。本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 16 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件, 应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项, 根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分, 将本金部分冲减资产支持证券投资成本, 并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于2017年10月23日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股

票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票
的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一
部分确认为估值增值。自 2017 年 10 月 23 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开
发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据
中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试
行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），
按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提
供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证
监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交
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)，按照中证指
数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按
照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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6月30日
活期存款	86,713,639.40
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	86,713,639.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,158,909,796.00	1,157,690,474.37	-1,219,321.63
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	1,158,909,796.00	1,157,690,474.37	-1,219,321.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因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 6 月 30 日
应收活期存款利息	16,770.92
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	151.65
应收债券利息	-
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	234.09
合计	17,156.66

6.4.7.6 其他资产

注：本基金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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,913,423.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,913,423.71

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	121,474.70
合计	121,474.70

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月16日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,130,881,034.91	1,130,881,034.91
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-15,361,328.83	-15,361,328.83
本期末	1,115,519,706.08	1,115,519,706.08

注：截至 2019 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 55,937,619.00 份（2018 年 12 月 31 日：54,678,457.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 1,059,582,087.08 份（2018 年 12 月 31 日：295,727,406.13 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申

购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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
基金合同生效日	307,418,292.02	-304,942,404.84	2,475,887.18
本期利润	45,350,080.63	77,882,178.26	123,232,258.89
本期基金份额交易产生的变动数	-4,172,126.90	4,141,404.26	-30,722.64
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-4,172,126.90	4,141,404.26	-30,722.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	348,596,245.75	-222,918,822.32	125,677,423.43

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月16日（基金合同生效日）至2019年6月30日
活期存款利息收入	404,806.47
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	36,492.61
其他	5,947.00
合计	447,246.08

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
	2019年1月16日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出股票成交总额	344,644,162.48
减：卖出股票成本总额	301,505,475.24
买卖股票差价收入	43,138,687.24

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

注：本基金在本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注:本基金在本报告期内无债券买卖差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注:本基金在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

注:本基金在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

注:本基金在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

注:本基金在本报告期内未进行贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注:本基金在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

注:本基金在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

注:本基金在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

注：本基金在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

注：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
	2019年1月16日（基金合同生效日）至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,954,173.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,954,173.05

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月16日（基金合同生效日）至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	77,882,178.26
股票投资	77,882,178.26
债券投资	-
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	77,882,178.26

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月16日（基金合同生效日）至2019年6月30日

基金赎回费收入	5,183.49
合计	5,183.49

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,455,706.30
银行间市场交易费用	-
合计	1,455,706.30

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	27,287.08
信息披露费	53,750.04
账户维护费	9,000.00
上市费	27,287.08
合计	117,324.20

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的资产负债日后事项。

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
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、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、基金销售机构

上海东证期货有限公司（“东证期货”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
--------------------	---------------------

注：以下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

本基金合同生效日为 2019 年 1 月 16 日，无上年度可比期间。

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 2019 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
东方证券	687,287,498.75	57.20

6.4.10.1.2 债券交易

注：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 2019 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东方证券	1,742,700,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：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 2019 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2019 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	513,350.13	58.39	3,782,407.87	96.65

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取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
	2019年1月16日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,532,384.95
其中:支付销售机构的客户维护费	3,580,060.87

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
	2019年1月16日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,422,064.24

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

注: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自有资金投资本基金的情况

注:报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

注:本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

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1月16日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
光大银行	86,713,639.40	404,806.47

注:本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管,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

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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2019年1月16日至6月30日,本基金当期无交易手续费支出。

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2019年6月30日,本基金的结算备付金余额为114,564.08元,无存出保证金余额。于2019年1月16日至6月30日,本基金当期结算备付金利息收入378.72。

6.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2019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
002027	分众传媒	2019年01月09日	2019年07月10日	大宗交易流通受限	5.14	5.23	3,000,000	15,420,000.00	15,690,000.00	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年07月05日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年07月05日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

注:1、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

注:本基金本报告期末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

注:本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行，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；在银行间同业市场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评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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上市公司发行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%。

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。

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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年1月15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	86,713,639.40	-	-	-	-	-	86,713,639.40
结算备付金	438,276.14	-	-	-	-	-	438,276.14
存出保证金	577,992.25	-	-	-	-	-	577,992.25
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,157,690,474.37	1,157,690,474.37
应收利息	-	-	-	-	-	17,156.66	17,156.66
应收股利	-	-	-	-	-	1,512,676.00	1,512,676.00
资产总计	87,729,907.79	-	-	-	-	-1,159,220,307.03	1,246,950,214.82
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,469,934.06	1,469,934.06
应付托管费	-	-	-	-	-	244,989.01	244,989.01
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,188.27	3,188.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,913,423.71	3,913,423.71
应交税费	-	-	-	-	-	75.56	75.56
其他负债	-	-	-	-	-	121,474.70	121,474.70
负债总计	-	-	-	-	-	5,753,085.31	5,753,085.31
利率敏感度缺口	87,729,907.79	-	-	-	-	-1,153,467,221.72	1,241,197,129.51

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

注:于 2019 年 6 月 30 日,本基金未持有交易性债券,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。本基金持有不以记账本位币计价的资产,因此存在相应的外汇风险。

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 6 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	-	77,349,382.80	-	77,349,382.80
资产合计	-	77,349,382.80	-	77,349,382.80
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	-	77,349,382.80	-	77,349,382.80

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	
	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6月30日)
分析	1、港币相对人民币升值 5%	3,867,469.14
	2、港币相对人民币贬值 5%	-3,867,469.14

6.4.13.4.3 其他价格风险

本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其他市场价格风险管理。

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 2019年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,157,690,474.37	93.27
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	1,157,690,474.37	93.27

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	
	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6月30日）
分析	1、沪深 300 指数上升 5%	64,543,756.26
	2、沪深 300 指数下降 5%	-64,543,756.26

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，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 (2019 年 6 月 30 日)
	1 天	30,857,251.02
	1 周	68,998,910.88

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 2019 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 1,141,943,497.83 元，第二层次的余额为 15,746,976.54 元，无属于第三层次的余额。(2018 年 12 月 31 日：第一层次 323,052,178.52 元，第二层次 50,145.80 元，无第三层次)

(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，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 2019 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(2018 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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 1 月 15 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 1 月 15 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	317,792,964.39	22,155,520.92
结算备付金		5,975,723.48	250,561.84
存出保证金		1,398,357.20	75,788.53
交易性金融资产	6.4.7.2	523,109,272.25	323,102,324.32
其中：股票投资		523,109,272.25	323,102,324.32
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	-	-
应收证券清算款		357,354,617.38	5,254,483.26
应收利息	6.4.7.5	72,933.73	5,243.97
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		1,205,703,868.43	350,843,922.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 1 月 15 日	上年度末 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		61,869,965.52	-
应付赎回款		6,251,724.11	1,621,532.12
应付管理人报酬		461,694.53	474,538.68
应付托管费		76,949.09	79,089.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,399,252.75	3,267,256.60
应交税费		75.56	75.56
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	287,284.78	274,000.00
负债合计		72,346,946.34	5,716,492.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,130,881,034.91	350,405,863.13
未分配利润	6.4.7.10	2,475,887.18	-5,278,433.00
所有者权益合计		1,133,356,922.09	345,127,430.13
负债和所有者权益总计		1,205,703,868.43	350,843,922.84

注：报告截止日 2019 年 1 月 15 日，基金份额净值 1.002 元，基金份额总额 1,130,881,034.91 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 15 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 15 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		18,619,460.49	-12,170,589.29
1. 利息收入		227,879.28	326,009.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	67,689.76	296,733.90
债券利息收入		-	2,244.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		160,189.52	27,031.17
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		55,904.50	136,206,908.26

其中：股票投资收益	6.4.7.12	65,710.65	130,144,815.35
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	417,123.93
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	-9,806.15	5,644,968.98
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.17	18,319,781.02	-148,703,852.32
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	15,895.69	344.79
减：二、费用		717,843.76	7,832,303.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	461,694.53	4,904,429.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	76,949.09	817,404.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	166,049.64	1,698,880.68
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	8.09
7. 其他费用	6.4.7.20	13,150.50	411,580.70
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		17,901,616.73	-20,002,893.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		17,901,616.73	-20,002,893.13

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2019年1月1日至2019年1月15日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年1月15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)	350,405,863.13	-5,278,433.00	345,127,430.13
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期 利润)	-	17,901,616.73	17,901,616.73

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）	780,475,171.78	-10,147,296.55	770,327,875.23
其中：1. 基金申购款	814,395,937.97	-10,550,403.66	803,845,534.31
2. 基金赎回款	-33,920,766.19	403,107.11	-33,517,659.08
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）	1,130,881,034.91	2,475,887.18	1,133,356,922.09
项目	上年度可比期间 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）	530,480,573.38	375,543,436.49	906,024,009.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-20,002,893.13	-20,002,893.13
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）	-96,517,547.89	-38,724,185.24	-135,241,733.13
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-96,517,547.89	-38,724,185.24	-135,241,733.13
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）	-	-181,954,838.50	-181,954,838.50
五、期末所有者权益（基金净值）	433,963,025.49	134,861,519.62	568,824,545.11

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：

<u>潘鑫军</u>	<u>任莉</u>	<u>詹朋</u>
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

东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(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[2014]1293号《关于准予东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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》和《东方红睿阳灵活配置混合型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人民币 530,335,748.32 元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)信会师报字(2015)第 130011 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 530,480,573.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 144,825.06 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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金封闭期自基金合同生效之日起至三年后对应日前一个工作日止。本基金在封闭期内不开放申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF),继续在深圳证券交易所上市交易。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]363 号核准,本基金 16,114,191.00 份基金份额于 2015 年 7 月 31 日在深交所挂牌交易。对于托管在场外的基金份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红睿阳灵活配置混合型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,本基金的基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。在本

基金转换为上市开放式基金 (LOF) 后股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%，封闭期内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净值的 0%—3%；本基金转换为上市开放式基金 (LOF) 后，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，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。本基金的业绩比较基准为：封闭期内：三年期银行定期存款利率 (税后)；本基金转换为上市开放式基金 (LOF) 后：沪深 300 指数收益率×70%+中国债券总指数收益率×30%。

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》、《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和其他中国证监会、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于 2019 年 1 月 15 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 15 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 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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1月15日
活期存款	317,792,964.39
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	317,792,964.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 1 月 15 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	602,210,772.14	523,109,272.25	-79,101,499.89
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	602,210,772.14	523,109,272.25	-79,101,499.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：本基金于本报告期末，未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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 2019 年 1 月 15 日
应收活期存款利息	71,627.11
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	1,094.75
应收债券利息	-
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	115.46
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	96.41
合计	72,933.73

6.4.7.6 其他资产

注: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 2019年1月15日
交易所市场应付交易费用	3,399,252.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,399,252.75

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2019年1月15日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	134.28
预提费用	287,150.50
合计	287,284.78

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年1月15日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	350,405,863.13	350,405,863.13
本期申购	814,395,937.97	814,395,937.97
本期赎回(以“-”号填列)	-33,920,766.19	-33,920,766.19
本期末	1,130,881,034.91	1,130,881,034.91

注:截至2019年1月15日止,本基金于深交所上市的基金份额为54,283,810.00份(2018年12月31日:54,678,457.00份),托管在场外未上市交易的基金份额为1,076,597,224.91份(2018年12月31日:295,727,406.13份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申

购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	95,423,330.63	-100,701,763.63	-5,278,433.00
本期利润	-418,164.29	18,319,781.02	17,901,616.73
本期基金份额交易产生的变动数	212,413,125.68	-222,560,422.23	-10,147,296.55
其中：基金申购款	221,645,231.93	-232,195,635.59	-10,550,403.66
基金赎回款	-9,232,106.25	9,635,213.36	403,107.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	307,418,292.02	-304,942,404.84	2,475,887.18

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年1月15日
活期存款利息收入	67,340.36
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	171.63
其他	177.77
合计	67,689.76

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
	2019年1月1日至2019年1月15日
卖出股票成交总额	161,720.95
减：卖出股票成本总额	96,010.30
买卖股票差价收入	65,710.65

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

注：本基金本报告期内无债券投资。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：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

注：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

注：本基金在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

注：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

注：本基金在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

注：本基金在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

注：本基金在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

注：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

注：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
	2019年1月1日至2019年1月15日
股票投资产生的股利收益	-9,806.15
基金投资产生的股利收益	-
合计	-9,806.15

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年1月15日
1. 交易性金融资产	18,319,781.02
股票投资	18,319,781.02
债券投资	-
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	18,319,781.02

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年1月15日
基金赎回费收入	15,895.69
合计	15,895.69

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 15 日
交易所市场交易费用	166,049.64
银行间市场交易费用	-
合计	166,049.64

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 15 日
审计费用	2,465.70
信息披露费	8,219.10
上市费	2,465.70
合计	13,150.50

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

自 2019 年 1 月 16 日起，本基金名称变更为“东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金”，本基金转换完成后，由《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》修订而成的《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

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
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、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、基金销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构

注：以下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 2019年1月1日至2019年1月15日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	69,762,674.68	38.43	691,434,633.38	58.57

6.4.10.1.2 债券交易

注：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 2019年1月1日至2019年1月15日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
东方证券	1,755,200,000.00	100.00	54,800,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：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 2019年1月1日至2019年1月15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	52,177.77	39.53	3,269,057.74	96.17

关联方名称	上年度可比期间 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	505,643.95	59.22	3,107,778.63	96.56

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取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
	2019年1月1日至2019年1月15日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	461,694.53	4,904,429.46
其中:支付销售机构的客户维护费	192,503.81	1,353,578.98

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
	2019年1月1日至2019年1月15日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	76,949.09	817,404.91

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

注: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

注:报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

注:本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

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1月1日至2019年1月15日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
光大银行	317,792,964.39	67,340.36	63,730,737.33	264,818.52

注:本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，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

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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。于2019年1月15日，本基金无应付交易手续费余额(2018年12月31日:同)。于2019年1月1日至2019年1月15日，本基金当期无交易手续费支出(2018年1月1日至2018年6月30日:同)。

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2019年1月15日，本基金存放于东证期货的结

算备付金余额为 113,311.16 元, 无存出保证金余额(2018 年 12 月 31 日: 结算备付金 113,311.16 元, 无存出保证金余额)。于 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 15 日, 本基金当期结算备付金利息收入 34.05 元(2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日: 21,990.37 元)。

6.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末(2019 年 1 月 15 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
002027	分众传媒	2019 年 1 月 9 日	2019 年 07 月 09 日	大宗交易流通受限	5.14	5.07	3,000,000	15,420,000.00	15,210,000.00	-
002945	华林证券	2019 年 1 月 10 日	2019 年 1 月 17 日	新股流通受限	3.62	3.62	13,488	48,826.56	48,826.56	-
002948	青岛银行	2019 年 1 月 8 日	2019 年 1 月 16 日	新股流通受限	4.52	4.52	20,912	94,522.24	94,522.24	-
601298	青岛港	2019 年 1 月 11 日	2019 年 1 月 21 日	新股流通受限	4.61	4.61	23,750	109,487.50	109,487.50	-
601615	明阳智能	2019 年 1 月 15 日	2019 年 1 月 23 日	新股流通受限	4.75	4.75	13,431	63,797.25	63,797.25	-
603332	苏州龙杰	2019 年 1 月 8 日	2019 年 1 月 17 日	新股流通受限	19.44	19.44	1,479	28,751.76	28,751.76	-
603700	宁波水表	2019 年 1 月 14 日	2019 年 1 月 22 日	新股流通受限	16.63	16.63	1,662	27,639.06	27,639.06	-
603739	蔚蓝生物	2019 年 1 月 7 日	2019 年 1 月 16 日	新股流通受限	10.19	10.19	1,786	18,199.34	18,199.34	-

注:1、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

注:本基金本报告期末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

注:本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国光大银行，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；在银行间同业市场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评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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 2019 年 1 月 15 日，本基金所承担的全部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%。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%。

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。

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、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1月15 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	317,792,964.39	-	-	-	-	-	317,792,964.39
结算备付金	5,975,723.48	-	-	-	-	-	5,975,723.48
存出保证金	1,398,357.20	-	-	-	-	-	1,398,357.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	523,109,272.25	523,109,272.25
应收利息	-	-	-	-	-	72,933.73	72,933.73
应收证券清算款	-	-	-	-	-	357,354,617.38	357,354,617.38
资产总计	325,167,045.07	-	-	-	-	880,536,823.36	1,205,703,868.43

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,251,724.11	6,251,724.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	461,694.53	461,694.53
应付托管费	-	-	-	-	-	76,949.09	76,949.09
应付证券清算款	-	-	-	-	-	61,869,965.52	61,869,965.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,399,252.75	3,399,252.75
应交税费	-	-	-	-	-	75.56	75.56
其他负债	-	-	-	-	-	287,284.78	287,284.78
负债总计	-	-	-	-	-	72,346,946.34	72,346,946.34
利率敏感度缺口	325,167,045.07	-	-	-	-	-808,189,877.02	1,133,356,922.09
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	22,155,520.92						22,155,520.92
结算备付金	250,561.84						250,561.84
存出保证金	75,788.53						75,788.53
交易性金融资产						323,102,324.32	323,102,324.32
应收利息	-	-	-	-	-	5,243.97	5,243.97
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,254,483.26	5,254,483.26
资产总计	22,481,871.29					328,362,051.55	350,843,922.84
负债							
应付赎回款	-					1,621,532.12	1,621,532.12
应付管理人报酬						474,538.68	474,538.68
应付托管费						79,089.75	79,089.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,267,256.60	3,267,256.60
应交税费	-	-	-	-	-	75.56	75.56
其他负债	-	-	-	-	-	274,000.00	274,000.00
负债总计	-					5,716,492.71	5,716,492.71
利率敏感度缺口	22,481,871.29					322,645,558.84	345,127,430.13

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

注：于 2019 年 1 月 15 日，本基金未持有交易性债券，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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

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 1 月 15 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	-	17,024,206.30	-	17,024,206.30
资产合计	-	17,024,206.30	-	17,024,206.30
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	-	17,024,206.30	-	17,024,206.30
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	-	-	-	-

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		
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 1 月 15 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）	
分析	1、港币相对人民币升值 5%	851,210.32	-

	2、港币相对人民币贬值 5%	-851, 210. 32	-
--	----------------	---------------	---

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 2019 年 1 月 15 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	523, 109, 272. 25	46. 16	323, 102, 324. 32	93. 62
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	523, 109, 272. 25	46. 16	323, 102, 324. 32	93. 62

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		
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 1 月 15 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）	
分析	1、沪深 300 指数上升 5%	29, 894, 174. 32	19, 050, 821. 28
	2、沪深 300 指数下	-29, 894, 174. 32	-19, 050, 821. 28

	降 5%		
--	------	--	--

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，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 (2019 年 1 月 15 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	1 天	13,828,177.43	8,325,252.87
	1 周	30,920,744.75	18,615,831.35

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 2019 年 1 月 15 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 507,508,048.54 元，第二层次的余额为 15,601,223.71 元，无属于第三层次的余额。(2018 年 12 月 31 日：第一层次 323,052,178.52 元，第二层次 50,145.80 元，无第三层次)

(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，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 2019 年 1 月 15 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 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（转型后）

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	1,157,690,474.37	92.84
	其中：股票	1,157,690,474.37	92.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	87,151,915.54	6.99
8	其他各项资产	2,107,824.91	0.17
9	合计	1,246,950,214.82	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 77,349,382.80 元人民币，占期末基金资产净值比例 6.23%。

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

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	363,431.25	0.03
C	制造业	679,475,640.44	54.74
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	63,770,533.96	5.14
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	59,974,361.40	4.83
J	金融业	67,264,137.75	5.42
K	房地产业	150,450,019.17	12.12
L	租赁和商务服务业	59,019,861.00	4.76
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,080,341,091.57	87.04

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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	45,839,023.80	3.69
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	31,510,359.00	2.54
H 信息科技	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	77,349,382.80	6.23

注：以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, 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	002475	立讯精密	5,043,188	125,020,630.52	10.07
2	002415	海康威视	4,189,742	115,553,084.36	9.31
3	000002	万科A	2,748,141	76,425,801.21	6.16
4	600048	保利地产	5,801,271	74,024,217.96	5.96
5	600887	伊利股份	2,155,669	72,020,901.29	5.80
6	601318	中国平安	758,721	67,230,267.81	5.42
7	600297	广汇汽车	14,298,326	63,770,533.96	5.14
8	600741	华域汽车	2,813,662	60,775,099.20	4.90
9	002027	分众传媒	11,190,900	59,019,861.00	4.76
10	000333	美的集团	1,048,213	54,360,326.18	4.38
11	300349	金卡智能	2,962,438	52,672,147.64	4.24
12	300450	先导智能	1,472,079	49,461,854.40	3.99
13	600104	上汽集团	1,797,400	45,833,700.00	3.69
14	02238	广汽集团	5,354,000	39,279,085.60	3.16
15	603228	景旺电子	918,955	36,767,389.55	2.96
16	002466	天齐锂业	1,315,860	33,264,940.80	2.68
17	03898	中车时代电气	870,500	31,510,359.00	2.54
18	002470	金正大	5,075,426	18,474,550.64	1.49
19	002568	百润股份	863,100	15,432,228.00	1.24
20	600566	济川药业	372,821	11,225,640.31	0.90
21	600066	宇通客车	861,900	11,221,938.00	0.90
22	603799	华友钴业	488,852	10,417,436.12	0.84
23	002353	杰瑞股份	357,487	8,257,949.70	0.67
24	002065	东华软件	1,039,000	7,262,610.00	0.59
25	600426	华鲁恒升	452,469	6,723,689.34	0.54
26	02020	安踏体育	139,000	6,559,938.20	0.53
27	002078	太阳纸业	593,712	4,043,178.72	0.33
28	600835	上海机电	35,500	589,300.00	0.05
29	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.03
30	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	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	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	104,504,333.00	8.42
2	601318	中国平安	60,046,657.53	4.84
3	000333	美的集团	54,033,531.30	4.35
4	600048	保利地产	53,394,594.53	4.30
5	600104	上汽集团	52,882,970.00	4.26
6	600297	广汇汽车	50,668,881.59	4.08
7	600004	白云机场	44,299,274.95	3.57
8	600741	华域汽车	41,338,830.13	3.33
9	300349	金卡智能	34,202,306.31	2.76
10	03898	中车时代电气	34,029,210.87	2.74
11	002475	立讯精密	32,744,898.25	2.64
12	02238	广汽集团	31,366,463.01	2.53
13	603228	景旺电子	30,831,087.04	2.48
14	002470	金正大	27,746,162.99	2.24
15	002466	天齐锂业	25,493,571.60	2.05
16	002353	杰瑞股份	24,241,409.00	1.95
17	000002	万科A	23,171,216.00	1.87
18	002027	分众传媒	22,413,863.00	1.81
19	03808	中国重汽	18,929,017.26	1.53
20	00581	中国东方集团	11,723,069.49	0.94

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600004	白云机场	64,524,538.07	5.20
2	002353	杰瑞股份	32,627,441.98	2.63
3	300498	温氏股份	31,888,055.01	2.57
4	603228	景旺电子	31,246,264.24	2.52
5	600600	青岛啤酒	23,254,966.53	1.87
6	03808	中国重汽	22,237,810.02	1.79
7	002475	立讯精密	13,538,199.58	1.09
8	600887	伊利股份	12,828,411.36	1.03
9	002460	赣锋锂业	12,024,894.90	0.97
10	00581	中国东方集团	11,818,593.66	0.95
11	601318	中国平安	11,662,590.40	0.94
12	600030	中信证券	11,340,395.00	0.91

13	000625	长安汽车	10,141,770.32	0.82
14	002153	石基信息	9,666,069.00	0.78
15	002470	金正大	8,329,956.20	0.67
16	002078	太阳纸业	7,027,675.42	0.57
17	03669	永达汽车	6,854,768.26	0.55
18	03898	中车时代电气	6,766,384.06	0.55
19	300450	先导智能	4,235,955.36	0.34
20	000338	潍柴动力	3,144,470.50	0.25

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	858,204,499.10
卖出股票收入（成交）总额	344,644,162.48

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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。基金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

注：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	577,992.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,512,676.00
4	应收利息	17,156.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,107,824.91

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

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	002027	分众传媒	15,690,000.00	1.26	大宗交易取得并带有限售期

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。

§ 7 投资组合报告（转型前）

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	523,109,272.25	43.39
	其中：股票	523,109,272.25	43.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	323,768,687.87	26.85
8	其他各项资产	358,825,908.31	29.76
9	合计	1,205,703,868.43	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 17,024,206.30 元人民币，占期末基金资产净值比例 1.50%。

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

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	10,578,423.24	0.93
B	采矿业	-	-
C	制造业	330,386,425.23	29.15
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	18,381,654.72	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	109,487.50	0.01
H	住宿和餐饮业		-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,777,826.50	3.16
J	金融业	143,348.80	0.01
K	房地产业	68,861,457.96	6.08
L	租赁和商务服务业	41,846,442.00	3.69
M	科学研究和技术服务业		-
N	水利、环境和公共设施管理业		-
O	居民服务、修理和其他服务业		-
P	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	506,085,065.95	44.65

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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	11,353,150.80	1.00
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	5,671,055.50	0.50
H 信息科技	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	17,024,206.30	1.50

注：以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, 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	600887	伊利股份	2,577,158	62,109,507.80	5.48
2	002475	立讯精密	3,508,350	52,765,584.00	4.66
3	000002	万科A	1,944,141	48,914,587.56	4.32

4	002027	分众传媒	7,834,200	41,846,442.00	3.69
5	300450	先导智能	1,226,300	34,299,611.00	3.03
6	603228	景旺电子	517,712	24,705,216.64	2.18
7	002470	金正大	3,214,756	22,728,324.92	2.01
8	300349	金卡智能	1,168,950	20,772,241.50	1.83
9	600048	保利地产	1,707,780	19,946,870.40	1.76
10	002415	海康威视	643,355	18,933,937.65	1.67
11	600297	广汇汽车	4,418,667	18,381,654.72	1.62
12	600600	青岛啤酒	485,157	17,659,714.80	1.56
13	002466	天齐锂业	569,060	16,929,535.00	1.49
14	600741	华域汽车	804,123	15,278,337.00	1.35
15	002460	赣锋锂业	567,755	12,888,038.50	1.14
16	02238	广汽集团	1,598,000	11,353,150.80	1.00
17	603799	华友钴业	376,040	11,269,918.80	0.99
18	002353	杰瑞股份	644,700	10,631,103.00	0.94
19	300498	温氏股份	381,617	10,578,423.24	0.93
20	000625	长安汽车	1,360,500	10,230,960.00	0.90
21	002078	太阳纸业	1,417,625	8,420,692.50	0.74
22	002153	石基信息	284,500	7,701,415.00	0.68
23	002065	东华软件	1,039,000	7,304,170.00	0.64
24	03898	中车时代电气	144,100	5,671,055.50	0.50
25	600066	宇通客车	435,600	5,301,252.00	0.47
26	000338	潍柴动力	365,350	2,966,642.00	0.26
27	600486	扬农化工	58,200	2,245,938.00	0.20
28	600690	海尔智家	57,496	842,891.36	0.07
29	601298	青岛港	23,750	109,487.50	0.01
29	002948	青岛银行	20,912	94,522.24	0.01
29	601615	明阳智能	13,431	63,797.25	0.01
29	002945	华林证券	13,488	48,826.56	0.00
29	603121	华培动力	1,987	40,832.85	0.00
29	603332	苏州龙杰	1,479	28,751.76	0.00
29	603700	宁波水表	1,662	27,639.06	0.00
29	603739	蔚蓝生物	1,786	18,199.34	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	000002	万科A	33,905,723.16	9.82
2	600887	伊利股份	31,833,937.49	9.22
3	300450	先导智能	28,472,494.31	8.25

4	002475	立讯精密	28,235,871.17	8.18
5	002027	分众传媒	15,420,000.00	4.47
6	600741	华域汽车	15,130,017.68	4.38
7	02238	广汽集团	11,249,237.80	3.26
8	300349	金卡智能	5,733,484.40	1.66
9	603228	景旺电子	5,733,229.00	1.66
10	03898	中车时代电气	5,654,531.76	1.64
11	601298	青岛港	109,487.50	0.03
12	002948	青岛银行	94,522.24	0.03
13	601615	明阳智能	63,797.25	0.02
14	002945	华林证券	48,826.56	0.01
15	603332	苏州龙杰	28,751.76	0.01
16	603700	宁波水表	27,639.06	0.01
17	603121	华培动力	23,426.73	0.01
18	603739	蔚蓝生物	18,199.34	0.01

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	601860	紫金银行	87,355.90	0.03
2	603185	上机数控	74,365.05	0.02

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	181,783,177.21
卖出股票收入（成交）总额	161,720.95

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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。基金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

注：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	1,398,357.20
2	应收证券清算款	357,354,617.38
3	应收股利	-
4	应收利息	72,933.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	358,825,908.31

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

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	002027	分众传媒	15,210,000.00	1.34	大宗交易取得并带有限售期

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 (转型后)

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 (%)
13,739	81,193.66	3,144,615.00	0.28	1,112,375,091.08	99.72

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	韩香莲	4,532,400.00	8.10
2	招商银行股份有限公司-兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)	1,297,018.00	2.32

3	袁慕樵	995,070.00	1.78
4	蒋金玉	994,395.00	1.78
5	泰康人寿保险有 限公司一分红一 团体分红-019L- FH001 深	988,600.00	1.77
6	肖岸文	926,744.00	1.66
7	黄兰	920,250.00	1.65
8	苗延国	731,900.00	1.31
9	张迪扬	650,000.00	1.16
10	郭军武	523,682.00	0.94

注：上述持有人为本基金本报告期末场内份额持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,289,929.64	0.1156

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

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（%）
13,900	81,358.35	1,359,697.00	0.12	1,129,521,337.91	99.88

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	韩香莲	4,532,400.00	8.35
2	蒋金玉	994,395.00	1.83
3	泰康人寿保险有 限公司一分红一 团体分红-019L- FH001 深	988,600.00	1.82
4	黄兰	934,350.00	1.72
5	肖岸文	926,744.00	1.71
6	李红云	769,500.00	1.42

7	苗延国	731,900.00	1.35
8	李健成	670,149.00	1.23
9	郭军武	523,682.00	0.96
10	方向	500,000.00	0.92

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,493,021.44	0.1320

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2019年1月16日） 基金份额总额	1,130,881,034.91
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	15,361,328.83
基金合同生效日起至报告期期末基金 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	1,115,519,706.08

注：根据《关于东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型及修改基金合同有关事项的议案》经基金份额持有人大会决议生效后，本基金已安排 20 个工作日的集中选择期为基金份额持有人办理赎回业务，集中选择期期间为 2018 年 12 月 17 日至 2019 年 1 月 15 日。集中选择期最后一日（即 2019 年 1 月 15 日）发起的赎回申请 15,361,328.83 份，赎回确认日为本基金转型后的第一日（即 2019 年 1 月 16 日）。自 2019 年 1 月 16 日起，本基金管理人根据持有人大会决议执行基金的正式转型，将原基金份额变更为东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金份额。自 2019 年 1 月 16 日起，本基金进入第一个封闭期，封闭期结束之日为第三年年度对日前的倒数第一日。

§ 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2015年1月19日）	530,480,573.38
---------------------	----------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	350,405,863.13
本报告期基金总申购份额	814,395,937.97
减：本报告期基金总赎回份额	33,920,766.19
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	1,130,881,034.91

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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，卢强同志自 2019 年 5 月 21 日起辞去基金管理人副总经理职务；李云亮同志自 2019 年 5 月 29 日起兼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

报告期内基金投资策略无改变。

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(转型后)

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	687,287,498.75	57.20%	513,350.13	58.39%	-
申万宏源	1	514,273,192.12	42.80%	365,803.41	41.61%	-
西部证券	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、报告期内本公司已取得上海证券交易所租用其他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，后续将陆续切换租用的其他券商交易单元；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、本报告期内本基金无新增交易单元。

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	-	-	1,742,700,000.00	100.00%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

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	
申万宏源	1	111,767,573.04	61.57%	79,818.38	60.47%	-
东方证券	2	69,762,674.68	38.43%	52,177.77	39.53%	-
西部证券	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、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、本报告期内本基金新增交易单元：西部证券 1 个。

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
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	1,755,200,000.00	100.00%	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方红睿阳灵活配置混合型证券投资	中国证券报、上海证券	2019 年 1 月 16 日

	基金（LOF）正式转型为东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的公告	报和公司网站	
2	东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018 年第 4 季度报告	证券日报和公司网站	2019 年 1 月 22 日
3	关于上海东方证券资产管理有限公司旗下部分证券投资基金 2019 年非港股通交易日暂停开放的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2019 年 1 月 28 日
4	东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018 年年度报告	公司网站	2019 年 3 月 27 日
5	东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018 年年度报告摘要	证券日报和公司网站	2019 年 3 月 27 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分开放式基金在网上直销开通银联通支付方式并开展费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2019 年 4 月 8 日
7	东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年第 1 季度报告	证券日报和公司网站	2019 年 4 月 22 日
8	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2019 年 5 月 22 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报和公司网站	2019 年 5 月 30 日
10	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2019 年 6 月 21 日

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）恢复申购并即将进入封闭期的提示性公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2019 年 1 月 2 日
2	上海东方证券资产管理有限公司旗下基金 2018 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	2019 年 1 月 2 日

§ 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

注:本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、中国证监会批准设立东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型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。

12.2 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。

12.3 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

2019 年 8 月 27 日