东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019年半年度报告（摘要）

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2019年8月27日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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 2019 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红睿满沪港深混合
场内简称	东证睿满
基金主代码	169104
前端交易代码	169104
基金运作方式	契约型基金，本基金合同生效后，前三年封闭运作，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）。
基金合同生效日	2016 年 6 月 28 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	1,144,691,974.43 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	2017 年 2 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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	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，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。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。

2.3 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	姓名	李云亮	张燕

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

负责人	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

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	15,592,069.70
本期利润	297,894,201.48
加权平均基金份额本期利润	0.2602
本期基金份额净值增长率	25.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.2388
期末基金资产净值	1,451,039,529.83
期末基金份额净值	1.268

注:1、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 1 日-2019 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

过去一个月	4.45%	1.13%	4.56%	0.85%	-0.11%	0.28%
过去三个月	-1.86%	1.58%	-1.03%	1.05%	-0.83%	0.53%
过去六个月	25.60%	1.48%	18.03%	1.07%	7.57%	0.41%
过去一年	1.73%	1.54%	6.17%	1.09%	-4.44%	0.45%
过去三年	64.16%	1.13%	20.87%	0.81%	43.29%	0.32%
自基金合同生效起至今	64.32%	1.13%	22.35%	0.81%	41.97%	0.32%

注:1、自基金合同生效日起至今指 2016 年 6 月 28 日-2019 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同中的有关规定，本基金的业绩比较基准为：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：

benchmarkt=60%*[t 日沪深 300 指数/(t-1 日沪深 300 指数)-1]+20%*[t 日恒生指数/(t-1 日恒生指数)-1]+20%*[t 日中国债券总指数/(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：

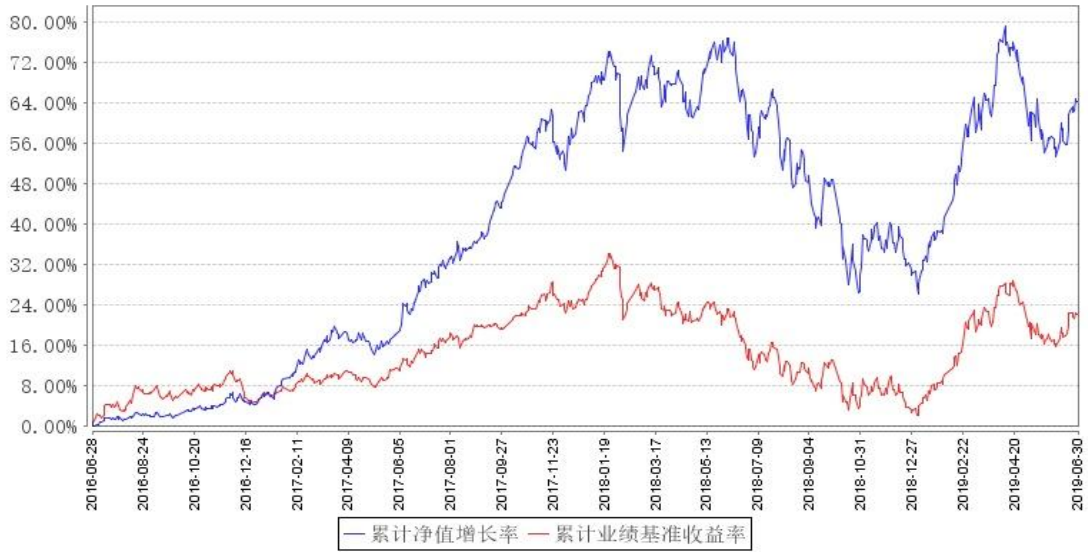
benchmarkTt=[∏Tt(1+benchmarkt)]-1

其中，T=2,3,4,．．．；∏Tt(1+benchmarkt)表示 t 日至 T 日的(1+benchmarkt)数学连乘。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

东方红睿满沪港深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 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 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

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		
孙伟	东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017年1月10日	-	9	硕士，曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员，上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、权益研究部高级研究员，现任东方红睿满沪港深混合(LOF)、东方红睿泽三年定开混合基金经理。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遵规守信情况的说明

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

2019 年一季度，随着经济数据的出炉和中美局势的缓和，悲观情绪得到很大程度的抑制，A 股市场迎来反弹，二季度随着美国对国内科技领域制裁的加码，市场有所反复。上半年沪深 300 指数上涨 27.07%，创业板指上涨 20.87%，分行业看，食品饮料、农林牧渔、家用电器等行业表现较好，钢铁、建筑装饰、传媒等行业排名靠后，本产品坚持自下而上选股为主的投资策略，上半年份额净值有一定上涨

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 1.268 元，份额累计净值为 1.619 元；本报告期基金份额净值增长率为 25.60%，同期业绩比较基准收益率为 18.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

19 年上半年，是各类风险预期逐渐释放的半年，很多悲观的预期出现了明显的好转，国内的经济数据也开始企稳，中美关系继续恶化的可能性不大，而且科技上的脱钩短期来看对国内影响比较大，看长一些，对国内的某些产业意味着更大的机会。我们始终相信我们的政府在经济波动中有足够的能力来应对各种困难，无论是从投资人还是企业家的角度，只要怀抱信心，中国未来

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

的机会一定是多于海外的。从估值的角度，A 股年初的估值是历史最低点附近，虽有一定程度的反弹，但整体依然偏低，我们依然坚持用积极的心态来看待接下来的市场。

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、封闭期间，基金收益分配采用现金方式；本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，其基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择获取现金红利或将现金红利按再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金分红方式，不能选择红利再投资；

2、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，开放期内，本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 25%；封闭期内，本基金在符合有关基金分红条件的前提下每年分红不得少于一次，且每次基金收益分配比例不低于截至收益分配基准日可供分配利润的 90%；

4、若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

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；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金管理人于 2019 年 1 月 10 日发布《东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金分红公告》，收益分配基准日为 2018 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额派发红利 0.71 元；共计派发 2018 年度红利 81,273,131.30 元（均为现金形式发放），符合相关法律法规及本基金合同的约定。

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:

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

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

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

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

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	252,233,026.72	89,859,840.36
结算备付金	4,186,565.80	39,423.39
存出保证金	726,039.12	151,923.64
交易性金融资产	1,169,399,568.48	1,149,111,121.10
其中：股票投资	1,169,399,568.48	1,149,111,121.10
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	27,307,492.82	443.33
应收利息	35,994.07	20,082.59
应收股利	3,305,340.79	1,060,786.99
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,457,194,027.80	1,240,243,621.40
负债和所有者权益	**本期末 2019 年 6 月 30 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	81.08	-
应付管理人报酬	1,726,553.48	1,621,589.34
应付托管费	287,758.94	270,264.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,998,790.56	3,633,223.01
应交税费	3.42	3.42
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	141,310.49	300,000.00
负债合计	6,154,497.97	5,825,080.67
所有者权益：		
实收基金	1,144,691,974.43	1,144,692,038.17
未分配利润	306,347,555.40	89,726,502.56

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

所有者权益合计	1,451,039,529.83	1,234,418,540.73
负债和所有者权益总计	1,457,194,027.80	1,240,243,621.40

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.268 元，基金份额总额 1,144,691,974.43 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红睿满沪港深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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	311,443,854.19	6,816,834.03
1.利息收入	341,186.59	749,420.34
其中：存款利息收入	341,186.59	646,814.36
债券利息收入	-	100.41
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	102,505.57
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	28,800,535.82	313,032,150.65
其中：股票投资收益	15,207,718.45	301,118,625.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	201,913.47
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	13,592,817.37	11,711,611.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	282,302,131.78	-306,964,736.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	13,549,652.71	17,445,647.13
1．管理人报酬	10,326,924.41	12,000,685.16
2．托管费	1,721,154.12	2,000,114.14
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	1,263,852.92	2,959,080.43
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．税金及附加	-	0.36
7．其他费用	237,721.26	485,767.04

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	297,894,201.48	-10,628,813.10
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	297,894,201.48	-10,628,813.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红睿满沪港深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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 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)	1,144,692,038.17	89,726,502.56	1,234,418,540.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	297,894,201.48	297,894,201.48
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）	-63.74	-17.34	-81.08
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-63.74	-17.34	-81.08
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）	-	-81,273,131.30	-81,273,131.30
五、期末所有者权益(基金净值)	1,144,691,974.43	306,347,555.40	1,451,039,529.83
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)	1,144,692,038.17	677,190,616.83	1,821,882,655.00
二、本期经营活	-	-10,628,813.10	-10,628,813.10

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-287,317,695.33	-287,317,695.33
五、期末所有者权益(基金净值)	1,144,692,038.17	379,244,108.40	1,523,936,146.57

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

东方红睿满沪港深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[2016]1000号《关于准予东方红睿满沪港深灵活配置混合型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《东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,144,640,186.62元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第855号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,144,692,038.17份基金份额，其中认购资金利息折合51,851.55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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

根据《东方红睿满沪港深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[2017]103 号核准，本基金 7,966,097.00 份基金份额于 2017 年 2 月 21 日在深交所挂牌交易。未上市交易的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通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定以及本基金的基金管理人于 2019 年 6 月 21 日发布的《关于东方红睿满沪港深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》，本基金自 2019 年 6 月 28 日起转型为上市开放式基金(LOF)，基金名称变更为“东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”，并自转型之日起开始办理申购、赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红睿满沪港深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)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、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债券、短期融资券等)、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。

开放期内每个交易日日终，本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-50%)；封闭期内每个交易日日终，本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0-100%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-100%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-100%)；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，前述

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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》、《东方红睿满沪港深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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 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等有关信息。

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

本基金本报告期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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东方证券股份有限公司（“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、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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 6 月 30 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	324,952,121.25	42.06	1,033,802,957.60	53.24

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 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 6 月 30 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	-	-	340,000,000.00	100.00

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

关联方名称	本期 2019年1月1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	247,606.12	43.69	3,839,429.27	96.01
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	789,376.33	54.94	3,294,600.50	90.43

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	10,326,924.41	12,000,685.16
其中：支付销售机构的客户维护费	5,181,574.05	6,037,343.19

注:1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.50%÷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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	1,721,154.12	2,000,114.14

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×0.25%÷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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 6 月 30 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
招商银行	252,233,026.72	328,866.00	144,873,883.03	601,697.65

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
000961	中南建设	2019 年 4 月 10 日	2019 年 10 月 10 日	大宗交易取得并带有限售期	9.21	8.18	2,000,000	18,420,000.00	16,360,000.00	-
002027	分众传媒	2019 年 1 月 9 日	2019 年 7 月 10 日	大宗交易取得并带有限售期	5.14	5.23	750,000	3,855,000.00	3,922,500.00	-
002180	纳思达	2017 年 12 月 20 日	2019 年 12 月 23 日	非公开发行	27.74	21.08	308,219	8,549,995.06	6,497,256.52	-
002475	立讯精密	2019 年 3 月 4 日	2019 年 9 月 4 日	大宗交易取得并带有限售期	19.84	23.34	600,000	11,904,000.00	14,004,000.00	-

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.9.2 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受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 1,128,615,811.96 元，属于第二层次的余额为 40,783,756.52 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 1,142,739,403.61 元，第二层次 6,371,717.49 元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,169,399,568.48	80.25
	其中：股票	1,169,399,568.48	80.25
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	256,419,592.52	17.60
8	其他各项资产	31,374,866.80	2.15
9	合计	1,457,194,027.80	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 393,282,278.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 27.10%。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	5,470,000.00	0.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	570,200,880.82	39.30
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	15,665,500.00	1.08
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	28,155,052.49	1.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	114,694,504.11	7.90
L	租赁和商务服务业	41,931,353.06	2.89
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	776,117,290.48	53.49

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	78,057,180.00	5.38
B 消费者非必需品	59,165,088.00	4.08
C 消费者常用品	144,604,780.00	9.97
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	69,013,500.00	4.76
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	42,441,730.00	2.92

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

合计	393,282,278.00	27.10

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前十名股票投资明细

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	002568	百润股份	6,200,000	110,856,000.00	7.64
2	600887	伊利股份	2,319,955	77,509,696.55	5.34
3	01112	H＆H国际控股	1,964,000	76,615,640.00	5.28
4	002415	海康威视	2,300,000	63,434,000.00	4.37
5	01378	中国宏桥	12,798,000	62,070,300.00	4.28
6	000002	万　科A	2,230,071	62,018,274.51	4.27
7	000961	中南建设	6,193,560	52,676,229.60	3.63
8	00586	海螺创业	1,762,500	42,793,500.00	2.95
9	01999	敏华控股	13,367,600	40,503,828.00	2.79
10	00884	旭辉控股集团	8,000,000	36,240,000.00	2.50

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

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	002568	百润股份	48,797,583.27	3.95
2	002815	崇达技术	20,943,896.00	1.70
3	601600	中国铝业	19,859,994.54	1.61
4	000961	中南建设	18,420,000.00	1.49
5	00168	青岛啤酒股份	18,346,525.50	1.49
6	02600	中国铝业	15,484,298.64	1.25
7	002661	克明面业	14,670,475.88	1.19
8	00288	万洲国际	12,469,549.40	1.01
9	002475	立讯精密	11,904,000.00	0.96
10	01378	中国宏桥	10,957,981.75	0.89
11	00586	海螺创业	9,646,118.96	0.78
12	603711	香飘飘	9,285,802.00	0.75
13	600519	贵州茅台	8,477,311.00	0.69
14	001979	招商蛇口	7,576,535.61	0.61
15	603228	景旺电子	6,149,003.70	0.50

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

16	01999	敏华控股	5,120,789.02	0.41
17	00175	吉利汽车	3,906,753.43	0.32
18	002027	分众传媒	3,855,000.00	0.31
19	600882	妙可蓝多	674,197.00	0.05
20	300124	汇川技术	274,499.00	0.02

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	002157	正邦科技	88,160,171.17	7.14
2	002415	海康威视	43,156,471.10	3.50
3	600132	重庆啤酒	41,544,086.71	3.37
4	002568	百润股份	35,924,868.34	2.91
5	600600	青岛啤酒	34,680,653.04	2.81
6	300145	中金环境	31,130,518.20	2.52
7	002041	登海种业	20,330,590.00	1.65
8	300408	三环集团	17,467,963.42	1.42
9	000961	中南建设	17,076,378.00	1.38
10	01999	敏华控股	14,070,374.37	1.14
11	600066	宇通客车	12,888,472.28	1.04
12	000729	燕京啤酒	12,050,397.00	0.98
13	600887	伊利股份	11,474,780.00	0.93
14	000887	中鼎股份	9,973,498.00	0.81
15	002470	金正大	9,871,630.00	0.80
16	00884	旭辉控股集团	9,792,724.04	0.79
17	001979	招商蛇口	8,425,764.60	0.68
18	002311	海大集团	8,380,020.00	0.68
19	600031	三一重工	8,289,686.00	0.67
20	02018	瑞声科技	8,008,231.62	0.65

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	248,527,229.27
卖出股票收入（成交）总额	525,748,632.12

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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前十名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:本基金本报告期未进行股指期货投资。

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:本基金本报告期未进行国债期货投资。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未进行国债期货投资。

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	726,039.12
2	应收证券清算款	27,307,492.82
3	应收股利	3,305,340.79
4	应收利息	35,994.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,374,866.80

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	000961	中南建设	16,360,000.00	1.13	大宗交易取得并带有限售期

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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（%）
7,548	151,655.00	7,259,013.00	0.63	1,137,432,961.43	99.37

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	苏宁易购集团股份有限公司	1,782,100.00	4.85
2	上海铂绅投资中心（有限合伙）－铂绅六号证券投资私募基金	1,331,318.00	3.63
3	东方证券资管－平安银行－东方红丰和 1 号集合资产管理计划	1,301,908.00	3.55
4	王庆莲	900,000.00	2.45
5	温州嘉越投资管理有限公司－嘉越基石私募基金	835,800.00	2.28
6	万家基金－工商银行－上海证券有限责任公司	704,902.00	1.92
7	刘振波	700,013.00	1.91
8	李新孙	654,287.00	1.78
9	门鑫	610,600.00	1.66
10	郭曼	519,700.00	1.42

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	1,271,485.90	0.1111

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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 6 月 28 日）基金份额总额	1,144,692,038.17
本报告期期初基金份额总额	1,144,692,038.17
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	63.74
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	1,144,691,974.43

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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 日起兼任公司首席信息官职务。

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

本基金本报告期内投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	3	324,952,121.25	42.06%	247,606.12	43.69%	-
中泰证券	1	261,077,245.81	33.79%	186,029.93	32.83%	-
兴业证券	1	186,539,579.76	24.15%	133,065.60	23.48%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

宏信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	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、本报告期内新增交易单元情况：新增东方证券 1 个、中信证券 1 个、川财证券 1 个、汇丰前海 1 个、安信证券 1 个、高华证券 1 个、国金证券 1 个、华泰证券 1 个、申万宏源 1 个、民生证券 1 个、华菁证券 1 个、海通证券 2 个、广发证券 2 个、华创证券 1 个、西南证券 1 个、宏信证券 1 个、方正证券 1 个、招商证券 1 个、国盛证券 1 个、中信建投证券 2 个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

§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:本基金本报告期内无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。

上海东方证券资产管理有限公司

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

2019 年 8 月 27 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn