东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

2018年第二季度报告

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
报告送出日期:2018年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

东方红纯债债券型证券投资基金于2018年06月07日变更注册为东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金。基金托管人及基金注册登记机构不变,基金代码分别为不变。纯型目基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等均属(东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同)相关规定进行运作。就前述修改变更事项,本基金管理人已按照相关法律法规及(基金合同)的约定履行了相关手续。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。其中,2018年6月01日起,"东方红纯债债券型证券投资基金"转型为"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6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金合同及托管协议即日生效。

§2 基金产品概况

转型前:

基金简称	东方红6个月定开纯债
基金主代码	001906
交易代码	001906
基金运作方式	契约型开放式,发起式
基金合同生效日	2018年6月01日
报告期末基金份额总额	1,025,348,858.11份
投资目标	本基金为纯债债券,主要通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期,期限结构、类属品种进行有效配置,追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法,在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上,对市场基本利率、债券类产品收益率、货币类产品收益率等关键产品收益率水平变化进行评估,并结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,针对不同行业、不同投资品种选择投资策略,以此确出最佳的资产配置及风险控制。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率*20%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

转型前:

基金简称	东方红纯债债券
基金主代码	001906
交易代码	001906
基金运作方式	契约型开放式,发起式
基金合同生效日	2015年10月26日
报告期末基金份额总额	60,123,593.77份
投资目标	本基金为纯债债券,主要通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期,期限结构、类属品种进行有效配置,追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法,在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上,对市场基本利率、债券类产品收益率、货币类产品收益率等关键产品收益率水平变化进行评估,并结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,针对不同行业、不同投资品种选择投资策略,以此确出最佳的资产配置及风险控制。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款税后收益率*1.2%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年6月8日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	2,354,042.25
2.本期利润	6,351,518.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0075
4.期末基金资产净值	1,068,583,801.67
5.期末基金份额净值	1.042

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月7日)
1.本期已实现收益	360,064.21
2.本期利润	506,612.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084
4.期末基金资产净值	62,258,908.85
5.期末基金份额净值	1.036

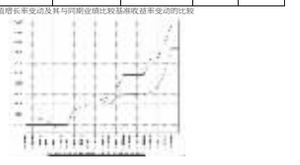
注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

3.2 基金净值表现(转型前)

阶段	净值增长率①	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
自2018-06-08至2018-06-30	0.58%	0.05%	0.45%	0.05%	0.13%	0.00%

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



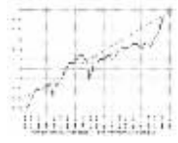
注:截止日期为2018年6月30日。

3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
自2018-04-01至2018-06-07	0.88%	0.08%	0.47%	0.01%	0.41%	0.07%

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



注:截止日期为2018年6月7日。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介(转型前)

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
纪文静	上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部总经理、兼任东方红新先锋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、东方红收益增强债券型发起式证券投资基金、东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债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、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型证券投资基金、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、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型证券投资基金、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、东方红信用债债券