# 东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2018年8月27日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2018年1月31日(基金合同生效日)起至06月30日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 东方红睿泽三年定开混合 |
| 场内简称 | 东证睿泽 |
| 基金主代码 | 501054 |
| 前端交易代码 | 501054 |
| 基金运作方式 | 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 | 2018年1月31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 | 7,105,789,899.82份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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 | 本基金在中国经济发展进入新常态,从总量增长转向结构调整,从短期增长转向长期可持续发展,同时人口面临部结构老化和空间分布失衡等众多挑战的大背景下,将贯彻长期价值投资的理念,发挥在封闭期封闭运作的优势,抓住供给侧改革的机遇,配合"一带一路"的发展战略,布局与中国经济转型、产业升级、人口转变等密切相关的发展领域,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,分享转型期增长的成果,在控制风险前提下,追求基金资产的长期稳健增值。<br>基于本基金每满三年开放一次,除开放期外封闭运作的特点,基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力,分散投资,做好流动性管理以应对开放期投资人的赎回需求。 |
| 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。<br>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 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 任莉 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-63325888 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | service@dfham.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 4009200808 | 95555 |
| 传真 | | 021-63326981 | 0755-83195201 |

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<br>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(2018年1月31日 - 2018年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 55,950,205.89 |
| 本期利润 | -282,595,565.80 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0398 |
| 本期基金份额净值增长率 | -3.98% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0398 |
| 期末基金资产净值 | 6,823,194,334.02 |
| 期末基金份额净值 | 0.9602 |

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2018年6月30日;"本期"指2018年1月31日 - 2018年6月30日。

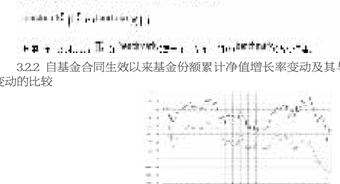
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

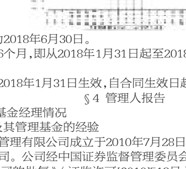
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -4.54% | 1.28% | -5.44% | 0.97% | 0.90% | 0.31% |
| 过去三个月 | -2.99% | 1.06% | -6.40% | 0.86% | 3.41% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.98% | 0.94% | -12.28% | 0.93% | 8.30% | 0.01% |

注:1、自基金合同生效日起至今指2018年1月31日-2018年6月30日。

2、根据基金合同有关规定,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%。



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



注:(1)截止日期为2018年6月30日。

(2)本基金建仓期6个月,即从2018年1月31日起至2018年7月30日,至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

(3)本基金合同于2018年1月31日生效,自合同生效日起至本报告期末不满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海东方证券资产管理有限公司成立于2010年7月28日,是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》(证监许可[2010]518号)批准,由东方证券股份有限公司出资3亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013年8月,公司成为首家获得"公开募集证券投资基金管理业务资格"的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金三十三只证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 周云 | 上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资部副总经理兼任东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、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。 | 2018年1月31日 | - | 10年 | 博士,曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员、上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资主办人,权益研究部高级研究员、投资主办人。现任上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资部副总经理兼东方红新动力混合、东方红京东大数据混合、东方红睿满沪港深混合、东方红智逸沪港深定开混合、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。 |
| 孙伟 | 东方红睿满沪港深灵活配置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基金经理。 | 2018年2月14日 | - | 8年 | 硕士,曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员,上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、权益研究部高级研究员,现任东方红睿满沪港深混合、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

1季度,A股市场震荡为主,沪深300指数和创业板指呈现明显的跷跷板关系,整体上创业板指表现较好;

2季度,受去杠杆、贸易战等因素影响,A股市场表现惨烈,单边下跌趋势延续至今,市场情绪跌至冰点,大部分股票已跌至2016年年初熔断时的低点。

上半年沪深300指数下跌12.9%,创业板指下跌8.33%,分行业看,食品饮料、休闲服务、医药生物等稳定类的行业表现较好,传媒、通讯、电气设备、国防军工等行业下跌幅度较大,本产品坚持自下而上选股为主的投资策略,增加了超跌个股的配置,上半年未能实现绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,本基金份额净值为0.9602元,份额累计净值为0.9602元;报告期内,基金份额净值增长率为-3.98%,同期业绩比较基准收益率为-12.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在这个艰难的时刻,市场将内忧外患的悲观情绪充分演绎,很多资金夺路而逃,市场的整体估值跌至历史低点附近。虽然未来充满了不确定性,但是在投资上,我们觉得越是在艰难的时候我们越是要乐观的看待未来,宏观上我们要相信中国的国运,相信政府处理各种复杂问题的能力,微观上我们要相信优秀的企业家能够带领他们的企业渡过难关,行业洗牌后会迎来更好的未来。价值投资规律告诉我们,越低的估值意味着未来更高的回报,我们将用积极心态去看待未来的市场,在合适的时候用剩余的仓位去积极布局跌下来的优秀公司,努力为客户创造超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会于2017年9月5日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(2017年9月5日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》和《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止)等相关规定和基金合同的约定,对基金所持有的投资品种进行估值,本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,确定本基金管理人采用的估值政策。基金管理人对投资品种的估值程序及技术保持一致性原则,为确保估值程序和技术的持续使用性,基金管理人建立了定期复核和审阅机制。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有基金从业人员资格,同时,公司设估值决策小组负责研究、指导和审议基金估值业务,成员包括:公司总经理、合规总监(督察长)、交易总监、运营总监、基金会计主管等。基金经理不参与基金日常估值业务,对于属于东证资管估值政策范围内的特殊估值变更可参与讨论,但最终决策由估值决策小组讨论决策并联名审批,保证基金估值的公平合理,保持估值政策和程序的一贯性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金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。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

本基金本报告期未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2018年6月30日 |
|---|---|
| 资 产: | |
| 银行存款 | 253,101,651.49 |
| 结算备付金 | 97,978,424.92 |
| 存出保证金 | 1,275,780.97 |
| 交易性金融资产 | 5,278,618,607.95 |
| 其中:股票投资 | 5,278,618,607.95 |
| 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 | 1,100,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | 100,964,615.86 |
| 应收利息 | -160,784.55 |
| 应收股利 | 4,694,488.21 |
| 应收申购款 | - |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | - |
| 资产总计 | 6,836,472,784.85 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年6月30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 | 109.75 |
| 应付赎回款 | - |
| 应付管理人报酬 | 8,713,205.04 |
| 应付托管费 | 1,452,200.82 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应付交易费用 | 2,966,894.06 |
| 应交税费 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 146,041.16 |
| 负债合计 | 13,278,450.83 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 7,105,789,899.82 |
| 未分配利润 | -282,595,565.80 |
| 所有者权益合计 | 6,823,194,334.02 |
| 负债和所有者权益总计 | 6,836,472,784.85 |

注:1.本基金于2018年1月31日成立,无上年度末可比数据。

2、报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9602元,基金份额总额7,105,789,899.82份。

6.2 利润表

会计主体:东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月31日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2018年1月31日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|
| 一、收入 | -225,893,608.40 |
| 1.利息收入 | 36,217,232.33 |
| 其中:存款利息收入 | 4,986,715.17 |
| 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 | 31,230,517.16 |
| 其他利息收入 | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 76,434,930.96 |
| 其中:股票投资收益 | 12,042,616.27 |
| 基金投资收益 | - |
| 债券投资收益 | - |
| 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 | 64,392,314.69 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -338,545,771.69 |
| 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 | 56,701,957.40 |
| 1. 管理人报酬 | 43,439,255.96 |
| 2. 托管费 | 7,239,875.95 |
| 3. 销售服务费 | - |
| 4. 交易费用 | 5,860,572.45 |
| 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 | 162,253.04 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -282,595,565.80 |
| 减:所得税费用 | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -282,595,565.80 |

注:本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月31日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月31日(基金合同生效日)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) | 7,105,789,899.82 | - | 7,105,789,899.82 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -282,595,565.80 | -282,595,565.80 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 其中:1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 7,105,789,899.82 | -282,595,565.80 | 6,823,194,334.02 |

注:本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度可比期间数据。

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

东方红睿泽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")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[2017]2252号《关于准予东方红睿泽三年定期开放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《东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,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7,105,521,668.09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(2018)第0064号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》 于2018年1月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为7,105,789,899.82 份基金份额, 其中认购资金利息折合268,231.73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。

根据《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,依次类推。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《东方红睿泽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、短期融资券等)、债券回购、同业存单等货币市场工具、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。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%);封闭期内,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股指期货和国债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:沪深 300 指数收益率x60% +恒生指数收益率x20% +中国债券总指数收益x20%。

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》、《东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金》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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月31日至2018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2018年1月31日生效。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

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公允价值变动计入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(主要为股指期货投资/权证投资)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

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。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

本基金本报告期未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目, 于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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央国债登记结算有限责任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[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日前取得的基金、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基金份额净值、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。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 上海东方证券资产管理有限公司("东证资管") | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司("招商银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 东方证券股份有限公司("东方证券") | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

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。

6.4.9 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2018年1月31日,无上年度可比期间。

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月31日(基金合同生效日)至2018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 | 3,177,208,480.14 | 51.88% |

注:本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度同期对比数据。

6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度同期对比数据。

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月31日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 东方证券 | 146,604,600,000.00 | 100.00% |

注:本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度同期对比数据。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度同期对比数据。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月31日(基金合同生效日)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 | 2,347,367.30 | 52.49% | 2,347,367.30 | 79.12% |

注:1、本基金合同生效日为2018年1月31 日,无上年度可比期间数据。

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

3、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。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月31日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 43,439,255.96 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 15,827,889.75 |

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×1.5%÷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。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。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。

3、本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度同期对比数据。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月31日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 7,239,875.95 |

注:1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式,于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度同期对比数据。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度同期对比数据。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度对比期间数据。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度对比期间数据。

6.4.9.5 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 2018年1月31日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 253,101,651.49 | 3,830,517.53 |

注:1、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。

2、本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度可比期间数据。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。本基金合同生效日为2018年1月31日,无上年度同期对比数据。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

6.4.10 期末( 2018年6月30日 )本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 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

| 6.4.10.1.1 受限证券类别:股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 603693 | 江苏新能 | 2018年6月25日 | 2018年7月3日 | 新股流通受限 | 9.00 | 9.00 | 5,384 | 48,456.00 | 48,456.00 | - |
| 603706 | 东方环宇 | 2018年6月29日 | 2018年7月9日 | 新股流通受限 | 13.09 | 13.09 | 1,765 | 23,103.85 | 23,103.85 | - |
| 603105 | 芯能科技 | 2018年6月29日 | 2018年7月9日 | 新股流通受限 | 4.83 | 4.83 | 3,410 | 16,470.30 | 16,470.30 | - |
| 002027 | 分众传媒 | 2018年4月26日 | 2018年10月26日 | 大宗交易流通受限 | 10.15 | 9.04 | 21,600,000 | 182,700,000.00 | 195,264,000.00 | - |
| 300124 | 汇川技术 | 2018年5月17日 | 2018年11月19日 | 大宗交易流通受限 | 30.30 | 30.95 | 7,000,000 | 212,100,000.00 | 216,650,000.00 | - |

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,不得转让所受让的股份。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至本报告期末2018年6月30日止未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为5,278,530,577.80元,第二层次的余额为88,030.15元,无属于第三层次的余额。本基金于2018年1月31日成立,无上期末数据。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。本基金于2018年1月31日成立,无上期末数据。

(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 | 5,278,618,607.95 | 77.21 |
| | 其中:股票 | 5,278,618,607.95 | 77.21 |
| 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 | 1,100,000,000.00 | 16.09 |
| | 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 | 351,080,076.41 | 5.14 |
| 8 | 其他各项资产 | 106,774,100.49 | 1.56 |
| 9 | 合计 | 6,836,472,784.85 | 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519,548,805.00元人民币,占期末基金资产净值比例7.61%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 186,846,007.58 | 2.74 |
| C | 制造业 | 3,783,043,980.78 | 55.44 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 71,559.85 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 43,959,877.00 | 0.64 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 125,805,203.00 | 1.84 |
| K | 房地产业 | 339,864,950.40 | 4.98 |
| L | 租赁和商务服务业 | 279,396,998.20 | 4.09 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 81,226.14 | 0.00 |
| 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 | 4,759,069,802.95 | 69.75 |

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 | 49,750,160.00 | 0.73 |
| B 消费者非必需品 | 219,794,800.00 | 3.22 |
| C 消费者常用品 | 58,187,845.00 | 0.85 |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | 12,720,000.00 | 0.19 |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | 85,936,000.00 | 1.26 |
| H 信息技术 | 93,160,000.00 | 1.37 |
| I 电信服务 | - | - |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 519,548,805.00 | 7.61 |

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 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600887 | 伊利股份 | 21,073,437 | 587,948,892.30 | 8.62 |
| 2 | 300124 | 汇川技术 | 10,148,986 | 319,999,720.52 | 4.69 |
| 3 | 600104 | 上汽集团 | 8,215,520 | 287,461,044.80 | 4.21 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 12,461,989 | 280,893,232.06 | 4.12 |
| 5 | 600600 | 青岛啤酒 | 5,950,273 | 260,800,465.59 | 3.82 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 4,960,852 | 259,055,691.44 | 3.80 |
| 7 | 002027 | 分众传媒 | 25,019,640 | 227,989,954.80 | 3.34 |
| 8 | 600031 | 三一重工 | 25,327,892 | 227,191,191.24 | 3.33 |
| 9 | 600048 | 保利地产 | 15,000,000 | 183,000,000.00 | 2.68 |
| 10 | 000887 | 中鼎股份 | 11,031,370 | 158,962,041.70 | 2.33 |

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 | 600887 | 伊利股份 | 638,713,383.95 | 9.36 |
| 2 | 300124 | 汇川技术 | 365,593,400.40 | 5.36 |
| 3 | 000333 | 美的集团 | 289,683,777.02 | 4.25 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 280,988,371.34 | 4.12 |
| 5 | 600104 | 上汽集团 | 279,961,822.80 | 4.10 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 270,168,436.81 | 3.96 |
| 7 | 600600 | 青岛啤酒 | 240,131,025.22 | 3.52 |
| 8 | 600031 | 三一重工 | 218,675,622.65 | 3.20 |
| 9 | 002027 | 分众传媒 | 213,025,363.00 | 3.12 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 208,131,789.11 | 3.05 |
| 11 | 000887 | 中鼎股份 | 190,522,566.50 | 2.79 |
| 12 | 000002 | 万 科A | 172,452,966.24 | 2.53 |
| 13 | 002078 | 太阳纸业 | 154,874,056.36 | 2.27 |
| 14 | 600176 | 中国巨石 | 149,991,142.98 | 2.20 |
| 15 | 300145 | 中金环境 | 148,688,868.12 | 2.18 |
| 16 | 601699 | 潞安环能 | 146,250,839.74 | 2.14 |
| 17 | 000729 | 燕京啤酒 | 139,834,296.41 | 2.05 |
| 18 | 600183 | 生益科技 | 132,305,599.28 | 1.94 |
| 19 | 600741 | 华域汽车 | 132,297,480.94 | 1.94 |
| 20 | 000786 | 北新建材 | 113,830,068.52 | 1.67 |

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 | 000651 | 格力电器 | 111,528,089.59 | 1.63 |
| 2 | 300124 | 汇川技术 | 79,793,062.31 | 1.17 |
| 3 | 00868 | 信义玻璃 | 18,151,781.87 | 0.27 |
| 4 | 600600 | 青岛啤酒 | 15,370,686.56 | 0.23 |
| 5 | 601699 | 潞安环能 | 15,073,780.00 | 0.22 |
| 6 | 000729 | 燕京啤酒 | 14,358,574.84 | 0.21 |
| 7 | 600132 | 重庆啤酒 | 3,704,308.00 | 0.05 |
| 8 | 300750 | 宁德时代 | 673,736.63 | 0.01 |
| 9 | 603259 | 药明康德 | 588,412.10 | 0.01 |
| 10 | 300454 | 深信服 | 187,347.20 | 0.00 |
| 11 | 603486 | 科沃斯 | 123,187.24 | 0.00 |
| 12 | 603876 | 鼎胜新材 | 113,094.38 | 0.00 |
| 13 | 601990 | 南京证券 | 101,277.00 | 0.00 |
| 14 | 603013 | 亚普股份 | 98,545.90 | 0.00 |
| 15 | 603348 | 文灿股份 | 97,573.72 | 0.00 |
| 16 | 300746 | 汉嘉设计 | 79,393.72 | 0.00 |
| 17 | 300745 | 欣锐科技 | 74,719.20 | 0.00 |
| 18 | 603045 | 福达合金 | 49,322.94 | 0.00 |

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 | 5,865,288,656.57 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 260,166,893.20 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

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 | 1,275,780.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | 100,964,615.86 |
| 3 | 应收股利 | 4,694,488.21 |
| 4 | 应收利息 | -160,784.55 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 106,774,100.49 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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 | 300124 | 汇川技术 | 216,650,000.00 | 3.18 | 大宗交易取得并带有限售期 |
| 2 | 002027 | 分众传媒 | 195,264,000.00 | 2.86 | 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

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 |
| 760,981 | 9,337.67 | 1,071,327.97 | 0.02% | 7,104,718,571.85 | 99.98% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

截至本报告期末,本基金尚未在上交所上市。

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 | 684,759.66 | 0.0096% |

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 | 0~10 |
| 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(2018年1月31日)基金份额总额 | 7,105,789,899.82 |
| 本报告期期初基金份额总额 | - |
| 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 | - |
| 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 | 7,105,789,899.82 |

注:本基金合同生效日为2018年1月31日。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

本报告期内本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

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东方证券 | 2 | 3,177,208,480.14 | 51.88% | 2,347,367.30 | 52.49% | - |
| 招商证券 | 1 | 1,378,290,022.60 | 22.50% | 980,378.70 | 21.92% | - |
| 兴业证券 | 1 | 1,340,594,909.44 | 21.89% | 961,703.59 | 21.50% | - |
| 广发证券 | 1 | 228,486,533.96 | 3.73% | 182,789.37 | 4.09% | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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

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

3、本基金合同于2018 年1月31日生效,上表所列示券商交易单元均为本报告期内新增。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | - | - | 146,604,600,000.00 | 100.00% | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |

上海东方证券资产管理有限公司

2018年8月27日