

## 东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告日期: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、监事会对本基金所载资料不承担虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性和及时性个别承担责任的法律责任。本半年度报告由董事长签发。

基金管理人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年6月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、账户信息等，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本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。投资人投资于基金前应仔细阅读基金合同。

本基金的招募说明书及定期报告。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

本年度报告摘要须阅读半年度报告全文，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

基金名称 东方红睿玺三年定期开放混合  
场内简称 东证睿玺

基金代码 601049  
前缀交易代码 601049

基金运作方式 约定封闭式，本基金以定期开放式运作，即采用封闭运作和开放申购与赎回的方式。

基金合同生效日 2017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 中国工商银行股份有限公司

报告期末基金总资产 1,079,629,341.34份

基金合同的存续期间 不定期

基金上市的证券交易所 上海证券交易所

上市日期 2018年6月1日

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在严格控制投资风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增长。

本基金在经济周期长模式转换的大背景下，寻找符合中国经济转型升级方向的行业，精选具有核心竞争力的公司，通过深入研究，挖掘出具有长期持续盈利能力的优质企业，从而实现基金资产的保值增值。

投资策略 本基金将根据宏观经济、政策、市场环境、行业趋势、公司基本面等多方面的因素，综合分析判断，适时调整投资组合，把握市场投资机会，力争在风险控制的前提下，追求基金资产的长期稳健增长。

业绩比较基准 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%+中债总收益指数收益率×20%

6.1.1 负债类基金

基金名称 上东方睿玺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	上年年末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	141,133,416.99	204,709,476.96
结算备付金	1,697,722.88	41,309,298.63
保证金	297,817.99	970,067.01
交易性金融资产	1,794,089,632.29	1,093,069,360.40
其中：股票投资	1,794,089,632.29	1,093,069,360.40
债券投资	-	4,008,400.00
贵金属投资	-	10,000.00
买入返售金融资产	-	700,000,000.00
应收证券清算款	-	15,777,121.00
应收利息	1,203,779.14	1,147,578.27
应收申购款	-	10,000.00
应付赎回款	-	10,000.00
应付交易费用	1,720,003.52	932,775.95
应付税款	-	16,700.00
应付利润	-	100,000.00
应付股利	-	100,000.00
应付申购款	-	100,000.00
其他负债	153,726.11	10,000.00
负债合计	4,793,994.35	104,000,236.47
所有者权益：		
实收基金	1,978,629,341.34	1,978,629,341.34
未分配利润	-44,979,084.37	65,059,910.57
实收资本	1,933,660,264.97	2,044,269,260.47
盈余公积	1,044,889.07	1,248,149.93
未分配利润	1,038,444,261.30	2,148,269,496.04
资产总计	1,938,444,261.30	2,148,269,496.04
负债和所有者权益总计	1,938,444,261.30	2,148,269,496.04

注1. 基金份额净值自起至2017年11月15日至2018年6月30日。

2. 根据基金合同的有关规定，本基金的业经比较基准 $\times 1.03$ 沪深300指数收益率 $\times 60\% +$ 恒生指数收益率 $\times 20\% +$ 中债总收益指数收益率 $\times 20\%$ 。

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 利润和收入、费用

报告期2018年1月1日 - 2018年6月30日

本期 1,033,660,264.97

上一年度 1,033,660,264.97

加权平均基金份额本期利润 -0.0669

本期基金份额净值增长率为 -5.41%

3.1.2 利润和收入、费用

报告期(2018年4月30日) -0.0227

期初未分配基金份额利润 1,033,660,264.97

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 份额增长 增长率 (%) 份额增长 增长率 (%) 业绩比较基准收益率 (1) - (3) 业绩比较基准收益率 (2) - (4)

过去一个月 -7.08% 1.42% -5.44% 0.97% -16.4% 0.45%

过去二个月 -4.10% 1.20% -6.07% 0.96% 2.21% 0.40%

过去三个月 -5.41% 1.10% -7.83% 0.86% 2.42% 0.30%

同期业绩比较基准收益率 -2.02% 1.00% -2.02% 0.86% -0.0227 0.23%

注1. 报告截止日为2018年6月30日，基金份额净值为0.9733，份额净值涨跌为-0.0073；报告期末，本基金的业经比较基准 $\times 1.03$ 沪深300指数收益率 $\times 60\% +$ 恒生指数收益率 $\times 20\% +$ 中债总收益指数收益率 $\times 20\%$ 。

2. 根据基金合同的有关规定，本基金的业经比较基准 $\times 1.03$ 沪深300指数收益率 $\times 60\% +$ 恒生指数收益率 $\times 20\% +$ 中债总收益指数收益率 $\times 20\%$ 。

3. 本基金的业经比较基准 $\times 1.03$ 沪深300指数收益率 $\times 60\% +$ 恒生指数收益率 $\times 20\% +$ 中债总收益指数收益率 $\times 20\%$ 。

4.1 基金管理人和基金经理情况

4.1.1 基金管理人及基金经理的报酬

4.1.2 基金管理人和基金经理的费用

4.2 基金管理人和基金经理的报酬

4.3 基金管理人和基金经理的费用

4.4 基金管理人和基金经理的费用

4.5 基金管理人和基金经理的费用

4.6 基金管理人和基金经理的费用

4.7 基金管理人和基金经理的费用

4.8 基金管理人和基金经理的费用

4.9 基金管理人和基金经理的费用

4.10 基金管理人和基金经理的费用

4.11 基金管理人和基金经理的费用

4.12 基金管理人和基金经理的费用

4.13 基金管理人和基金经理的费用

4.14 基金管理人和基金经理的费用

4.15 基金管理人和基金经理的费用

4.16 基金管理人和基金经理的费用

4.17 基金管理人和基金经理的费用

4.18 基金管理人和基金经理的费用

4.19 基金管理人和基金经理的费用

4.20 基金管理人和基金经理的费用

4.21 基金管理人和基金经理的费用

4.22 基金管理人和基金经理的费用

4.23 基金管理人和基金经理的费用

4.24 基金管理人和基金经理的费用

4.25 基金管理人和基金经理的费用

4.26 基金管理人和基金经理的费用

4.27 基金管理人和基金经理的费用

4.28 基金管理人和基金经理的费用

4.29 基金管理人和基金经理的费用

4.30 基金管理人和基金经理的费用

4.31 基金管理人和基金经理的费用

4.32 基金管理人和基金经理的费用

4.33 基金管理人和基金经理的费用

4.34 基金管理人和基金经理的费用

4.35 基金管理人和基金经理的费用

4.36 基金管理人和基金经理的费用

4.37 基金管理人和基金经理的费用

4.38 基金管理人和基金经理的费用

4.39 基金管理人和基金经理的费用

4.40 基金管理人和基金经理的费用

4.41 基金管理人和基金经理的费用

4.42 基金管理人和基金经理的费用

4.43 基金管理人和基金经理的费用

4.44 基金管理人和基金经理的费用

4.45 基金管理人和基金经理的费用

4.46 基金管理人和基金经理的费用

4.47 基金管理人和基金经理的费用

4.48 基金管理人和基金经理的费用

4.49 基金管理人和基金经理的费用

4.50 基金管理人和基金经理的费用

4.51 基金管理人和基金经理的费用

4.52 基金管理人和基金经理的费用

4.53 基金管理人和基金经理的费用

4.54 基金管理人和基金经理的费用

4.55 基金管理人和基金经理的费用

4.56 基金管理人和基金经理的费用

4.57 基金管理人和基金经理的费用

4.58 基金管理人和基金经理的费用

4.59 基金管理人和基金经理的费用

4.60 基金管理人和基金经理的费用

4.61 基金管理人和基金经理的费用

4.62 基金管理人和基金经理的费用

4.63 基金管理人和基金经理的费用

4.64 基金管理人和基金经理的费用

4.65 基金管理人和基金经理的费用

4.66 基金管理人和基金经理的费用