

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:2019年4月22日

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2019年4月18日复核了本基金报告中的财务指标、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。

本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当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

§ 2.基金产品概况

基金基本情况

基金名称 东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

基金代码 001906

份额分级 东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金A类

基金合同生效日 2010年6月8日

报告期末基金份额总额 1,996,840,160.00份

投资目标 本基金通过定期开放的运作模式,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金通过定期开放的运作模式,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 中债企业债指数收益率*80%+中债国债指数收益率*20%

风险收益特征 本基金为债券型基金,其风险收益特征与业绩比较基准的风险收益特征相似。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年1月1日-2019年3月31日)

1.本期三四季收益 20,700,411.23

2.本期利润 36,652,210.03

3.加权平均基金份额本期利润 0.0187

4.期末基金份额净值 2,143,524,697.49

5.期末基金资产净值 10,990

注:1.所述本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示。

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.基金净值的表现

3.2.1 本基金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 业绩比较基 准收益率② 业绩比较基 准收益率准 则③ ①-③ ②-④

过去三个月 1.75% 0.06% 0.62% 0.04% 1.23% 0.02%

注:过去三个月为2019年1月1日-2019年3月31日。

3.2.2 本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:截至日期为2019年3月31日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

基金名称 东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

基金经理姓名 ①

基金经理任期 ②

基金经理离职日期 ③

基金经理辞职日期 ④

基金经理评价 ⑤

注:1.基金经理辞职日期,指基金经理辞职后未到任日期;2.基金经理评价,指基金经理对基金经理的评价。

4.2 管理人对报告期内基金运作的评价与展望

报告期内,本基金通过定期开放的运作模式,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。

展望未来,本基金将通过定期开放的运作模式,在严格控制风险的前提下,追求资产的长期稳定增值。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.4 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.5 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.6 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.7 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.8 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.9 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.10 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.11 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.12 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.13 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.14 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.15 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.16 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.17 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.18 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.19 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.20 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.21 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.22 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.23 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.24 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.25 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.26 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.27 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.28 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.29 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.30 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.31 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.32 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.33 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.34 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.35 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.36 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.37 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.38 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.39 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.40 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.41 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.42 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.43 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.44 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.45 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.46 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.47 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.48 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.49 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.50 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.51 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.52 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.53 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.54 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.55 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.56 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金不存在不公平交易行为。

4.3.57 公平交易制度的执行情况