东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金 2019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:2019年8月27日

§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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红智逸沪港深定开混合
基金主代码	004278
基金运作方式	契约型、开放式、发起式。本基金以定期开放方式运作,即以运作周期和到期开放期相结合的方式运作。
基金合同生效日	2017年4月14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	1,992,960,833.75份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期安全的基础上,为基金份额持有人获取稳定的投资收益,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金以36个月为一个运作周期,以长期投资的理念进行大类资产的配置和个券选择。运用封闭期无流动性需求的优势,同时,充分考虑每个运作周期中期间开放期的安排。在股票的配置上,以时间换空间,采用低风险投资策略,为本基金获得更高的低风险收益;在债券配置上,合理配置久期沉配债券的结构,做好流动性管理,以期获得更高的投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%。
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。除了需要承担与国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,本基金还面临跟投机制下因投资环境、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	李云亮	张燕
	联系电话	021-63325888	0755-83198094
	电子邮箱	service@dfham.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400820808	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	10,965,339.77
本期利润	148,994,778.80
加权平均基金份额本期利润	0.0910
本期基金份额净值增长率	10.36%
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	0.1250
期末基金资产净值	2,393,357,440.30
期末基金份额净值	1.2009

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
过去一个月	1.75%	0.39%	1.89%	0.30%	-0.14%	0.09%
过去三个月	-1.18%	0.55%	-0.46%	0.36%	-0.72%	0.19%
过去六个月	10.36%	0.59%	6.41%	0.27%	3.95%	0.22%
过去一年	5.34%	0.63%	4.16%	0.29%	1.18%	0.24%
自基金合同生效起至今	20.09%	0.54%	6.32%	0.32%	13.77%	0.22%

注:1、自基金合同生效日起至今指2017年4月14日-2019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:中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,封闭期内t日收益率(benchmark t)按下列公式计算:

benchmark t=70%*[t日中债综合指数/(t-1日中债综合指数)-1]+20%*[t日沪深300指数/(t-1日沪深300指数)-1]+10%*[t日恒生指数/(t-1日恒生指数)-1]

其中,t=1,2,3,...,T,T表示封闭期末日;

t日至T日的期间收益率(benchmark T t)按下列公式计算:

benchmark T t=[∏Tt(1+benchmark t)]-1

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

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: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		
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副总经理,兼任东方红领先精选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、东方红中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。	2017年4月28日	-	12	硕士,曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、纳斯达克经理、德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理。上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理兼任东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红收益增强债券、东方红信用债债券、东方红睿添利纯债债券、东方红汇利债券、东方红沪港深灵活配置混合、东方红睿华沪港深灵活配置混合、东方红战略精选沪港深混合、东方红价值精选混合、东方红益鑫纯债债券、东方红智逸沪港深定期开放混合、东方红睿玺三年定期开放混合、东方红睿泽三年定期开放混合、东方红创新优选三年定期开放混合、东方红配置精选混合、东方红恒元五年定期开放混合、东方红核心优选一年定期开放混合、东方红目标优选三年定期开放混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
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、东方红睿阳三年定期开放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、东方红睿丰灵活配置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、东方红优势精选灵活配置混合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基金经理。	2017年4月14日	-	11	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任东方红新动力灵活配置混合、东方红京东大数据混合、东方红睿逸三年定期开放灵活配置混合、东方红睿丰灵活配置混合、东方红策略精选灵活配置混合、东方红优势精选灵活配置混合、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基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。
刚登峰	上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资部总经理助理兼任东方红优势精选灵活配置混合型证券投资基金、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、东方红优享红利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、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017年4月28日	-	10	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公募权益投资部副总经理助理兼任东方红优势精选混合、东方红睿轩三年定期开放混合、东方红智逸沪港深定期开放混合、东方红沪港深灵活配置混合基金经理。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

权益方面,2019年上半年随着中美贸易争端缓和以及货币政策宽松一季度出现较大反弹,二季度随着贸易争端反复有所调整,上半年沪深300指数上涨27.07%,中小板指上涨20.75%,创业板指上涨20.87%。行业表现方面:食品饮料(61.0%)、非银(43.8%)、农林牧渔(42.0%)、家用电器(37.8%)、计算机(32.8%)等行业表现较好,建筑装饰(4.2%)、钢铁(5.0%)、传媒(7.8%)、纺织服装(9.3%)、汽车(10.0%)等行业反弹相对较少。本产品的股票资产有所上涨,给组合带来了良好的回报。

债券方面,年初宽信用政策开始发挥作用,金融数据企稳回升,市场对经济企稳的预期进一步增强;但中美贸易摩擦的反复、“包商事件”以及地产政策等的收紧,后续又引发了市场对宽信用效果持续性存疑、对经济继续下滑的担忧。债券市场上半年整体处于震荡走势,受益于宽松的货币政策环境,债券的息差收益仍然相对确定。上半年10年国债收益率持平在3.22%,10年国开收益率下行3BP至3.61%。本产品在债券配置上精选个券,有效防范信用风险,调整组合久期和杠杆,力争获取稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年06月30日,本基金份额净值为1.2009元,份额累计净值为1.2009元;本报告期间基金份额净值增长率为10.36%,业绩比较基准收益率为6.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面,展望下半年,中美名义经济周期背离情况有改善,全球再度进入竞争性宽松的环境;国内政策在稳增长、稳就业和结构性改革中做出取舍,外围环境是重要变量;贸易谈判几经反转,对市场的边际影响递减。重启贸易谈判是短期内的大概率事件,中长期的中美全方面竞争仍然难免。但时间站在我们这边,中国的工程师红利远非过去可比,美国只能改变中国赶超速度,不能扭转趋势。各维度长期的竞争逐力会是常态。中国拥有全球优质的消费市场、完善的制造业产业链和广大的工程师红利,这是中美乃至全球政经关系的基本盘。因此具有上述特征的优质资产都是中国未来的核心资产,长期都有巨大的投资价值。随着科创板的推出,支持高新技术产业的融资,使得资本市场被提升到一个新的高度,提升市场风险偏好。

继续看好稳定性强的大众消费龙头与可选消费龙头;看好住宅后市场包括装修、家居、社区服务等机会;看好高端精密制造的产业集群优势与生产的相对优势;看好创新医药的龙头与医药服务龙头;看好供给侧收缩有效带来的竞争结构大幅改善的部分周期行业龙头。

债券方面,我们认为整体环境对债市仍有支撑。在外部不确定因素未消除之前,货币政策难以转紧,而中美贸易问题尽管有所缓解,但由此出口的压力依然存在。从内部来看,地产销售和投资逐渐下行、三四线城市棚改效应消退、新开工增速下行以及因城施策的调控政策下,后期地产销售和投资增速将逐渐下行,经济依然承压。尽管积极的财政政策将起到一定的托底作用,但难以改变趋势。在宽松的货币政策及经济承压的环境下,收益率易下难上,机会成本较低。信用债方面,“包商事件”的潜在影响仍未消除,信用利差扩大是必然趋势,同时由于机构需求将更加集中于高等级债券,AAA品种的溢价未来将持续。因此操作上仍需维持个券精细化操作。

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、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%;

3、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权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;

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。

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

本基金为发起式基金,基金合同生效未满三年,不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§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,我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:东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

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	18,340,320.89	21,926,964.36
结算备付金	29,811,256.66	49,850,553.74
存出保证金	195,880.06	56,121.89
交易性金融资产	2,968,290,476.64	2,572,647,818.46
其中:股票投资	774,786,274.34	467,536,326.46
基金投资	-	-
债券投资	2,193,504,202.30	2,105,111,492.00
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	5,991,127.34	981,928.24
应收利息	35,246,234.01	37,924,066.86
应收股利	1,215,328.08	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,069,090,619.68	2,683,387,442.55
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	656,000,000.00	1,158,469,044.56
应付证券清算款	4,422,197.96	83,799.66
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,919,900.44	1,971,928.06
应付托管费	389,320.06	262,923.75
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	980,881.35	783,793.10
应交税费	209,574.39	192,880.32
应付利息	699,747.48	1,714,899.23
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	111,557.71	300,000.00
负债合计	665,733,179.38	1,163,769,268.68
所有者权益:		
实收基金	1,992,960,833.75	1,396,402,401.42
未分配利润	400,396,606.55	123,215,772.45
所有者权益合计	2,393,357,440.30	1,519,618,173.87
负债和所有者权益总计	3,069,090,619.68	2,683,387,442.55

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.2009元,基金份额总额1,992,960,833.75份。

6.2 利润表

会计主体:东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金
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	176,898,784.14	7,208,774.83
1.利息收入	44,315,842.19	34,467,553.74
其中:存款利息收入	418,496.43	413,484.04
债券利息收入	43,897,346.76	34,054,069.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-6,409,040.37	35,211,593.86
其中:股票投资收益	-30,218,971.77	31,322,341.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	13,328,068.72	-4,795,607.00
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	10,481,872.68	8,674,858.94
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	138,039,439.03	-63,589,663.03
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	952,543.29	1,119,290.26
减:二、费用	27,904,006.34	24,784,386.14
1. 管理人报酬	14,360,258.43	12,516,312.41
2. 托管费	1,914,701.15	1,668,841.70
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	434,211.96	468,925.44
5. 利息支出	10,937,564.94	9,874,436.63
其中:卖出回购金融资产支出	10,937,564.94	9,874,436.63
6. 税金及附加	118,027.80	96,072.16
7. 其他费用	139,251.06	170,798.80
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	148,994,778.80	-17,575,611.31
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	148,994,778.80	-17,575,611.31

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金
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)	1,396,402,401.42	123,215,772.45	1,519,618,173.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	148,994,778.80	148,994,778.80
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)	596,558,432.33	128,186,055.30	724,744,487.63
其中:1.基金申购款	889,579,794.96	188,942,764.95	1,078,522,559.91
2.基金赎回款	-293,021,362.63	-60,756,709.65	-353,778,072.28
四、本期内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)	1,992,960,833.75	400,396,606.55	2,393,357,440.30

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)	1,482,644,340.03	225,551,290.34	1,708,195,630.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,575,611.31	-17,575,611.31
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)	-86,241,938.61	-12,498,502.53	-98,740,441.14
其中:1.基金申购款	107,989,836.64	15,615,080.39	123,604,916.03
2.基金赎回款	-194,231,775.25	-28,113,582.92	-222,345,357.17
四、本期内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)	1,396,402,401.42	195,477,176.50	1,591,879,577.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告61	至64财务报表由下列负责人签署:
潘露军	

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

东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金(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]3116号《关于核准东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式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》及其配套规则和《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式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人民币1,482,513,396.24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(2017)第435号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于2017年4月14日生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,482,644,340.03份基金份额,其中认购资金利息折合130,943.79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。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,004,586.95基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以36个月为一个运作周期,每个运作周期以封闭期和期间开放期相交替的方式运作,其包含3个封闭期和2个期间开放期。在每个运作周期中,第一期间开放期的首日为该运作周期首日的12个月后的月度对日,第二个期间开放期的首日为该运作周期首日的24个月后的月度对日,本基金的每个期间开放期为5至10个工作日。在每个运作周期结束后第一个工作日起进入到期开放期。本基金每个到期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《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式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,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及经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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的50%,但在每个期间开放期的前10个工作日和后10个工作日、到期开放期的前3个月和后3个月以及开放期期间,基金投资不受前述比例限制;本基金投资于股票的比例不高于基金资产的50%(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0-50%,投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-50%)。在开放期,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期,本基金不受前述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货和股指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:中债综合指数收益率×70%+沪深300指数收益率×20%+恒生指数收益率×10%。

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》、《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式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