

东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资 基金 2016 年半年度报告 (摘要)

2016 年 6 月 30 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

送出日期：2016 年 8 月 29 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 2016 年 8 月 25 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红睿逸定期开放混合
基金主代码	001309
前端交易代码	001309
基金运作方式	契约型、开放式、发起式，本基金以定期开放式运作，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	2015 年 6 月 3 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	826,753,482.17 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求本金长期安全的基础上，力争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，合理配置久期匹配债券的结构，做好流动性管理，以期获得更高的投资收益。
业绩比较基准	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+1.5%
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。

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	唐涵颖	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 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	17,351,370.30
本期利润	7,766,421.84
加权平均基金份额本期利润	0.0076
本期基金份额净值增长率	0.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0412
期末基金资产净值	876,758,671.45
期末基金份额净值	1.060

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日；“本期”指 2016 年 1 月 1 日-2016 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	2.12%	0.39%	0.33%	0.01%	1.79%	0.38%
过去三个月	2.42%	0.35%	1.02%	0.01%	1.40%	0.34%
过去六个月	0.95%	0.46%	2.06%	0.01%	-1.11%	0.45%
过去一年	7.40%	0.47%	4.36%	0.01%	3.04%	0.46%
自基金合同生效起至今	6.00%	0.48%	4.76%	0.01%	1.24%	0.47%

注：1、自基金合同生效日起至今指 2015 年 06 月 03 日-2016 年 6 月 30 日。

2、根据基金合同中的有关规定，本基金以定期开放方式运作，即以运作周期和到期开放相结合的方式运作，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+1.5%。本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（ $benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$$benchmark_t = 100\% * [(t \text{ 日三年期银行定期存款税后收益率} + 1.5\%) / 365]$$

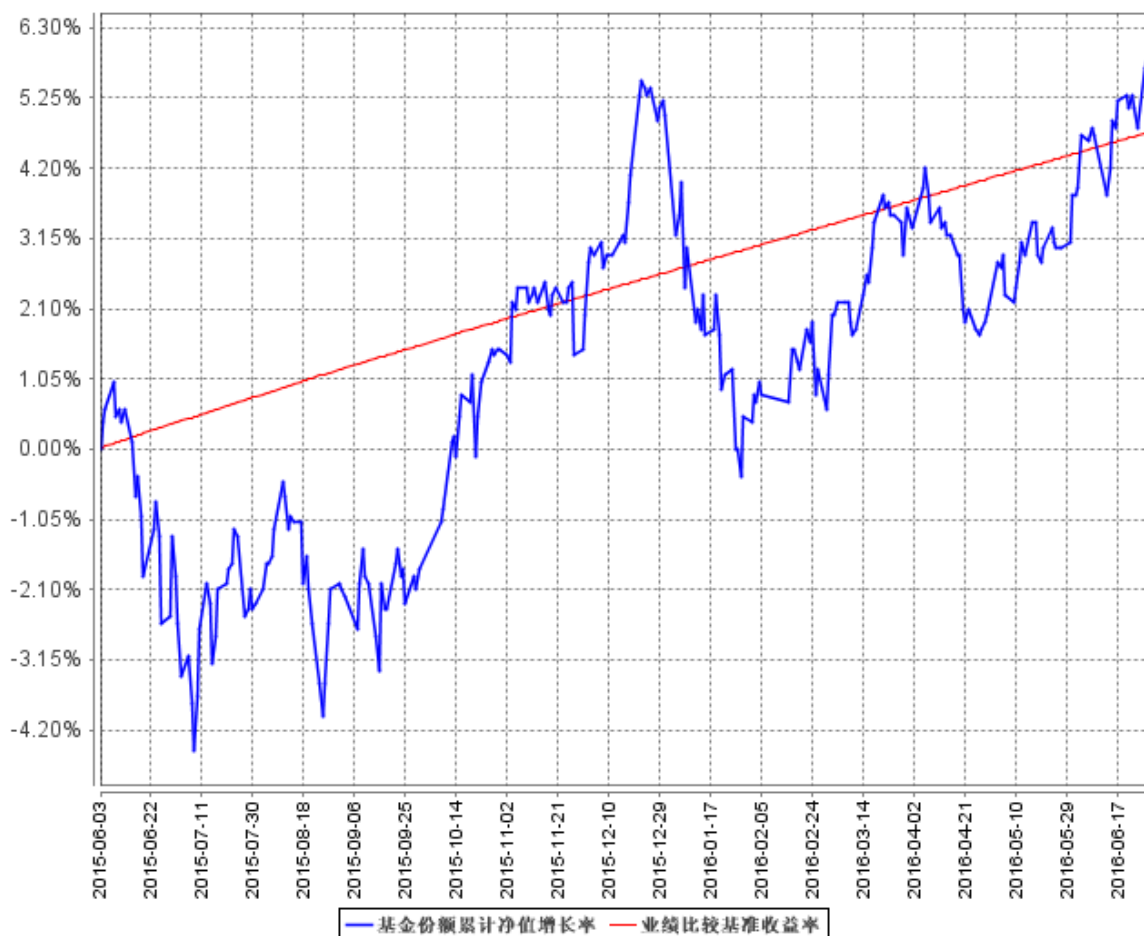
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日；

t 日至 T 日的期间收益率（ $benchmark_T^t$ ）按下列公式计算：

$$benchmark_T^t = [\prod_T^t (1 + benchmark_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_T^t (1 + benchmark_t)$ 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：（1）截止日期为 2016 年 6 月 30 日。

（2）本基金合同于 2015 年 6 月 3 日生效。

（3）本基金建仓期 6 个月，即从 2015 年 6 月 3 日至 2015 年 12 月 2 日，至本报告期末本基金已建仓完成，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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。截止 2016 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

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、东方红睿阳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二十只证券投资基金。

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		
林鹏	本基金基金经理，兼任上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募权益投资部总监、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿阳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	2015年6月3日	-	18年	硕士，曾任东方证券股份有限公司研究所研究员、资产管理业务总部投资经理、上海东方证券资产管理有限公司执行董事；现任上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募权益投资部总监兼任东方红睿丰混合、东方红睿阳混合、东方红睿元混合、东方红中国优势混合、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型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

	精选灵活配置混合型证券投资、东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理。				
纪文静	本基金基金经理，兼任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监、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、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红纯债债券型发起时证券投资基金、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、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金	2015年7月14日	-	9年	硕士，曾任东海证券股份有限公司固定收益部债券交易员、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固定收益部副总监；2014年10月加入上海东方证券资产管理有限公司，现任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监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、东方红策略精选混合、东方红纯债债券、东方红信用债债券、东方红收益增强债券、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红稳添利纯债债券基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

	基金经理				
--	------	--	--	--	--

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

2016 年上半年，权益市场出现了较大幅度的下跌，尤其以 1 月的下跌最为惨烈。上证综指下跌 17.22%，深证成指下跌 17.17%，沪深 300 下跌 15.47%，创业板下跌 17.92%，中小板下跌 17.88%。2016 年上半年债券市场也在经历了一季度的下行后市场出现了较大分歧，并最终在 4 月出现了较大幅度的回调，但在基本面数据回落，市场对利率长周期处于下行通道的一致预期下，最终于 5 月开始逐步修复前期调整，债券收益率回落，中债总财富指数上涨 1.35%。

本产品上半年积极参与股票和转债一级市场，以获取无风险收益为主；并适度参与股票二级市场，在个股选择上以蓝筹为主。同时在债券配置上更为重视，适时调仓，控制久期和杠杆，获取了稳定的收益。

在经济形势低迷、市场环境多变的背景下，我们认为质地优良的个股能够出现显著的超额收益。在一些细分领域，如大消费、新能源等行业，反映了经济结构调整的方向，也出现了一批具备核心竞争力和护城河的公司，这些重点行业可以精选个股、长期布局；我们相信他们代表产业方向、具备企业家精神、能够穿越经济周期。在人民币贬值的中长期趋势下，我们也相信会有一批国内企业走向全球，成为世界级的企业。市场情绪的短期波动难以预测，但我们相信与这些优秀企业为伴，能给投资者带来良好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 06 月 30 日，本基金份额净值为 1.060 元，份额累计净值为 1.060 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 0.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年上半年制造业投资仍然低迷；基建投资略有回升，起到托底作用；而房地产投资复苏明显，是推动此轮经济企稳的最主要动力。但地产销售拐点已现，地产投资存在一定的滞后性，因此下半年短期经济仍然保持稳定，但后期下滑风险已在临近。此外，“供给侧”改革仍然是主基调，产能出清仍将延续，政府仍更偏重于积极财政政策，货币政策则相对稳健、适度宽松。

从债券市场来看，中国经济增长长周期进入下行通道，利率长期也将下行，债券市场仍然有机会。但随着信用风险的加速暴露，信用利差分化较大，因此在信用债操作上，个券选择尤其重要。

从权益市场来看，短期内经济稳定、通胀回落、美联储加息风险缓解，都使得股票具备反弹的环境。此外，债券等固定收益资产收益率的下行以及信用风险的频发，也倒逼资金向高波动性的权益市场寻求超额收益。因此，高分红、业绩稳定、估值合理的个股仍然受青睐。

2016 年二季度，国内实体经济依然在底部徘徊，海外局势愈加复杂。英国“脱欧”给全球的经济局势增加了更多的不确定性，黄金等避险资产的上涨也表明了全球风险偏好的下降。国内经济结构的调整在艰难进行，需求侧的不景气倒逼供给侧的改革，然而复杂的外部环境、人民币汇率的贬值、人口红利的下降等因素也构成较大的压力，我们对短期的经济抱持谨慎的态度。而另一方面，短期美联储加息预期延后、国内通胀预期下降，给市场提供了相对宽松的货币环境。几轮调整之后，目前的指数水平已经释放了较大的市场风险，估值泡沫的消化较为充分。预计市场

的低位震荡还将持续一段时间，风险偏好缺乏大幅上升的理由。

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。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，成员包括：公司总经理、公司联席总经理、合规总监(督察长)、交易总监、运营总监、市场总监、投资经理、基金会计主管。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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议，由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

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，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：东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金
报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款		4,226,187.54	70,244,387.17
结算备付金		5,580,941.68	1,976,273.42
存出保证金		184,187.22	411,449.84
交易性金融资产		990,491,606.07	1,330,969,229.21
其中：股票投资		251,740,606.07	258,898,513.01
基金投资		-	-
债券投资		738,751,000.00	1,072,070,716.20
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		483,919.75	-
应收利息		10,851,078.25	13,105,117.27
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,011,817,920.51	1,416,706,456.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		132,999,870.00	296,199,310.90
应付证券清算款		-	11,106,719.37
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,144,087.41	1,394,095.68
应付托管费		152,544.98	185,879.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		625,889.52	333,351.65
应交税费		-	-
应付利息		2,595.75	45,248.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		134,261.40	180,000.00
负债合计		135,059,249.06	309,444,605.82
所有者权益:			
实收基金		826,753,482.17	1,054,594,202.29
未分配利润		50,005,189.28	52,667,648.80
所有者权益合计		876,758,671.45	1,107,261,851.09
负债和所有者权益总计		1,011,817,920.51	1,416,706,456.91

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.060 元，基金份额总额 826,753,482.17 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016	上年度可比期间 2015年6月3日(基
-----	-----	----------------------	------------------------

		年 6 月 30 日	金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		19,622,387.70	-11,321,632.00
1.利息收入		16,637,603.53	1,069,960.35
其中：存款利息收入		538,196.05	597,845.06
债券利息收入		16,057,842.83	237,282.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		41,564.65	234,833.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,258,237.45	-384,401.84
其中：股票投资收益		-294,261.92	-779,684.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益		7,969,256.51	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		3,583,242.86	395,282.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-9,584,948.46	-12,007,190.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,311,495.18	-
减：二、费用		11,855,965.86	1,914,498.74
1. 管理人报酬		7,866,161.86	1,162,924.75
2. 托管费		1,048,821.55	155,056.64
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		562,440.16	572,343.67
5. 利息支出		2,207,506.24	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,207,506.24	-
6. 其他费用		171,036.05	24,173.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,766,421.84	-13,236,130.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,766,421.84	-13,236,130.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,054,594,202.29	52,667,648.80	1,107,261,851.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	7,766,421.84	7,766,421.84
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）	-227,840,720.12	-10,428,881.36	-238,269,601.48
其中：1.基金申购款	23,039,657.64	989,253.85	24,028,911.49
2.基金赎回款	-250,880,377.76	-11,418,135.21	-262,298,512.97
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）	826,753,482.17	50,005,189.28	876,758,671.45
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-13,236,130.74	-13,236,130.74
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）	1,054,594,202.29	-	1,054,594,202.29
其中：1.基金申购款	1,054,594,202.29	-	1,054,594,202.29
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）	1,054,594,202.29	-13,236,130.74	1,041,358,071.55

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：

<u>陈光明</u>	<u>任莉</u>	<u>詹朋</u>
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

东方红睿逸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”)《关于准予东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可证监许可【2015】783 号文)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《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2015 年 6 月 3 日生效。本基金为契约型、开放式、发起式,本基金以定期开放式运作,存续期限不定期。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。

本基金于 2015 年 5 月 18 日至 2015 年 5 月 29 日向社会公开募集,扣除认购费后的有效认购资金 1,054,169,974.64 元,利息转份额 424,227.65 元,募集规模为 1,054,594,202.29 份。上述募集资金已由立信会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《东方红睿逸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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(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、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、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,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%。在开放期,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,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%,在封闭期,本基金不受前述 5%的限制。

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+1.5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 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 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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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[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、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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”）	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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 6 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东方证券	416,089,909.71	100.00%	440,561,718.62	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东方证券	228,474,593.98	100.00%	-	-

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2015 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	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东方证券	10,063,300,000.00	100.00%	690,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	304,284.34	100.00%	616,072.89	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015 年 6 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2015 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	401,085.47	100.00%	401,085.47	100.00%

注：1. 本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日。

2、上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

3. 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;截至报告期末,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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,866,161.86	1,162,924.75
其中:支付销售机构的客户维护费	3,824,871.04	586,564.79

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:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年6月3日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,048,821.55	155,056.64

注: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:

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期及上年度可比期间 未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 6 月 3 日）持有的基金份额	-	10,004,850.00
期初持有的基金份额	10,004,850.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,004,850.00	10,004,850.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.2101%	0.9487%

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 6 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	4,226,187.54	467,610.28	127,533,237.84	181,622.84

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 2015 年 6 月 3 日。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	7,122	92,443.56	92,443.56	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

6.4.10.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
136499	16 洪市政	2016年6月21日	2016年7月12日	新债未上市	100.00	100.00	460,000	46,000,000.00	46,000,000.00	-
136501	16 天风 01	2016年6月21日	2016年7月13日	新债未上市	100.00	100.00	500,000	50,000,000.00	50,000,000.00	-
127003	海印转债	2016年6月15日	2016年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	5,580	558,000.00	558,000.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项停牌	22.07	-	-	1,163,028	22,988,153.32	25,668,027.96	-
000002	万科 A	2015年12月18日	重大事项停牌	18.20	2016年7月4日	21.99	256,593	3,502,337.13	4,669,992.60	-

601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	30,252	104,974.44	632,871.84	-
601900	南方传媒	2016年6月6日	重大事项停牌	17.67	-	-	18,362	112,559.06	324,456.54	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大事项停牌	4.90	-	-	3,600	21,512.35	17,640.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，本基金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 19,999,870.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101554044	15 首开股份 MTN001	2016 年 7 月 1 日	103.08	200,000	20,616,000.00
合计				200,000	20,616,000.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 113,000,000.00 元，于 2016 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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 2015 年 12 月 31 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 124,677,935.78 元,第二层次的余额为 553,101,362.18 元,无属于第三层次的余额。本基金合同生效日为 2015 年 4 月 17 日,无上年度末可比数据。

(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,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,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。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),本基金采用第三方估值机构根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值,并将相关债券的公允价值确定为第二层次。

(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 2015 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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	251,740,606.07	24.88
	其中:股票	251,740,606.07	24.88
2	固定收益投资	738,751,000.00	73.01
	其中:债券	738,751,000.00	73.01
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,807,129.22	0.97
7	其他各项资产	11,519,185.22	1.14
8	合计	1,011,817,920.51	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

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	6,110,902.98	0.70
B	采矿业	-	-
C	制造业	239,911,763.61	27.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	632,871.84	0.07
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	70,492.40	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,669,992.60	0.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	324,456.54	0.04
S	综合	-	-
	合计	251,740,606.07	28.71

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通交易机制投资的港股。

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	002415	海康威视	2,026,936	43,498,046.56	4.96
2	002475	立讯精密	1,941,738	38,155,151.70	4.35
3	600519	贵州茅台	99,200	28,958,464.00	3.30
4	600887	伊利股份	1,634,300	27,243,781.00	3.11
5	000651	格力电器	1,163,028	25,668,027.96	2.93
6	600066	宇通客车	714,595	14,148,981.00	1.61
7	002001	新和成	573,800	12,124,394.00	1.38
8	600309	万华化学	653,962	11,313,542.60	1.29
9	000538	云南白药	149,396	9,606,162.80	1.10
10	002311	海大集团	504,196	7,951,170.92	0.91

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601169	北京银行	39,168,209.25	3.54
2	600519	贵州茅台	32,151,455.13	2.90
3	002475	立讯精密	21,015,024.46	1.90
4	600030	中信证券	10,898,678.95	0.98
5	600887	伊利股份	10,838,594.00	0.98
6	600019	宝钢股份	10,780,079.50	0.97
7	002001	新和成	10,776,749.00	0.97
8	600690	青岛海尔	10,643,202.00	0.96
9	300408	三环集团	10,284,202.38	0.93

10	002415	海康威视	9,566,695.57	0.86
11	002073	软控股份	5,463,858.05	0.49
12	600486	扬农化工	5,386,934.60	0.49
13	600885	宏发股份	5,380,315.30	0.49
14	002041	登海种业	5,352,682.57	0.48
15	300059	东方财富	5,336,898.00	0.48
16	002311	海大集团	5,335,577.97	0.48
17	300166	东方国信	5,175,342.57	0.47
18	002797	第一创业	152,152.00	0.01
19	603377	东方时尚	113,750.40	0.01
20	601900	南方传媒	112,559.06	0.01

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601169	北京银行	41,482,281.01	3.75
2	000858	五粮液	20,117,870.76	1.82
3	002400	省广股份	11,682,081.12	1.06
4	300408	三环集团	11,081,152.81	1.00
5	600519	贵州茅台	11,031,584.09	1.00
6	600030	中信证券	10,932,893.16	0.99
7	600690	青岛海尔	10,579,644.91	0.96
8	600019	宝钢股份	9,831,807.80	0.89
9	300498	温氏股份	7,772,966.75	0.70
10	600885	宏发股份	7,709,097.72	0.70
11	600066	宇通客车	7,577,491.84	0.68
12	600196	复星医药	6,919,103.69	0.62
13	300059	东方财富	5,561,011.00	0.50
14	600276	恒瑞医药	5,445,844.80	0.49
15	300166	东方国信	5,358,277.06	0.48
16	600660	福耀玻璃	5,260,227.69	0.48
17	300146	汤臣倍健	5,058,173.48	0.46
18	000860	顺鑫农业	3,247,399.79	0.29
19	002311	海大集团	3,218,526.65	0.29

20	000889	茂业通信	2,320,701.08	0.21
----	--------	------	--------------	------

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	205,377,979.88
卖出股票收入（成交）总额	212,535,410.41

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,020,000.00	19.39
	其中：政策性金融债	99,880,000.00	11.39
4	企业债券	199,626,000.00	22.77
5	企业短期融资券	29,988,000.00	3.42
6	中期票据	338,559,000.00	38.61
7	可转债（可交换债）	558,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	738,751,000.00	84.26

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160206	16 国开 06	1,000,000	99,880,000.00	11.39
2	101559059	15 余城建设 MTN001	600,000	60,876,000.00	6.94
3	101556041	15 青岛地铁 MTN001	500,000	50,775,000.00	5.79
4	136288	16 建发 02	500,000	50,105,000.00	5.71
5	136501	16 天风 01	500,000	50,000,000.00	5.70

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	184,187.22
2	应收证券清算款	483,919.75
3	应收股利	-
4	应收利息	10,851,078.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,519,185.22

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换债券。

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	000651	格力电器	25,668,027.96	2.93	重大事项停牌

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
5,154	160,410.07	10,993,172.29	1.33%	815,760,309.88	98.67%

8.2 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	0.00	0.0000%

8.3 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,004,850.00	1.21	10,004,850.00	1.21	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,004,850.00	1.21	10,004,850.00	1.21	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月3日）基金份额总额	1,054,594,202.29
本报告期期初基金份额总额	1,054,594,202.29
本报告期基金总申购份额	23,039,657.64
减：本报告期基金总赎回份额	250,880,377.76
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	826,753,482.17

§ 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

本报告期本基金管理人于2016年3月25日发布公告，同意王国斌先生自2016年3月24日起辞去公司董事长职务，由公司总经理陈光明先生代为履行公司董事长职务。

本报告期本基金管理人于2016年6月16日发布公告，自2016年6月15日起任命饶刚同志担任基金管理人副总经理。

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立信会计师事务所（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	416,089,909.71	100.00%	304,284.34	100.00%	-
方正证券	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（如有）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、本基金在本报告期末新增租用证券公司交易席位。

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	228,474,593.98	100.00%	10,063,300,000.00	100.00%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

上海东方证券资产管理有限公司
2016 年 8 月 29 日