
东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资
基金
2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

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 2017 年 8 月 24 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 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	24
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59

§11 影响投资者决策的其他重要信息	错误!未定义书签。
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	错误!未定义书签。
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	错误!未定义书签。
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金
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	671,118,996.40 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
注册地址		上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
办公地址		上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 层	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
邮政编码		200010	518040
法定代表人		陈光明	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报，上海证券报
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
--	-------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	20,527,126.28
本期利润	86,057,297.89
加权平均基金份额本期利润	0.1067
本期加权平均净值利润率	9.47%
本期基金份额净值增长率	10.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	81,252,475.16
期末可供分配基金份额利润	0.1211
期末基金资产净值	805,230,061.35
期末基金份额净值	1.200
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	20.00%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 2017 年 6 月 30 日；“本期”指 2017 年 1 月 1 日-2017 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	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④

		准差②	率③	准差④		
过去一个月	4.35%	0.41%	0.32%	0.01%	4.03%	0.40%
过去三个月	6.76%	0.35%	0.98%	0.01%	5.78%	0.34%
过去六个月	10.19%	0.29%	1.97%	0.01%	8.22%	0.28%
过去一年	13.21%	0.29%	4.06%	0.01%	9.15%	0.28%
自基金合同 生效起至今	20.00%	0.40%	9.01%	0.01%	10.99%	0.39%

注：1、自基金合同生效日起至至今指 2015 年 06 月 03 日-2017 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期相结合的方式运作，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：

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

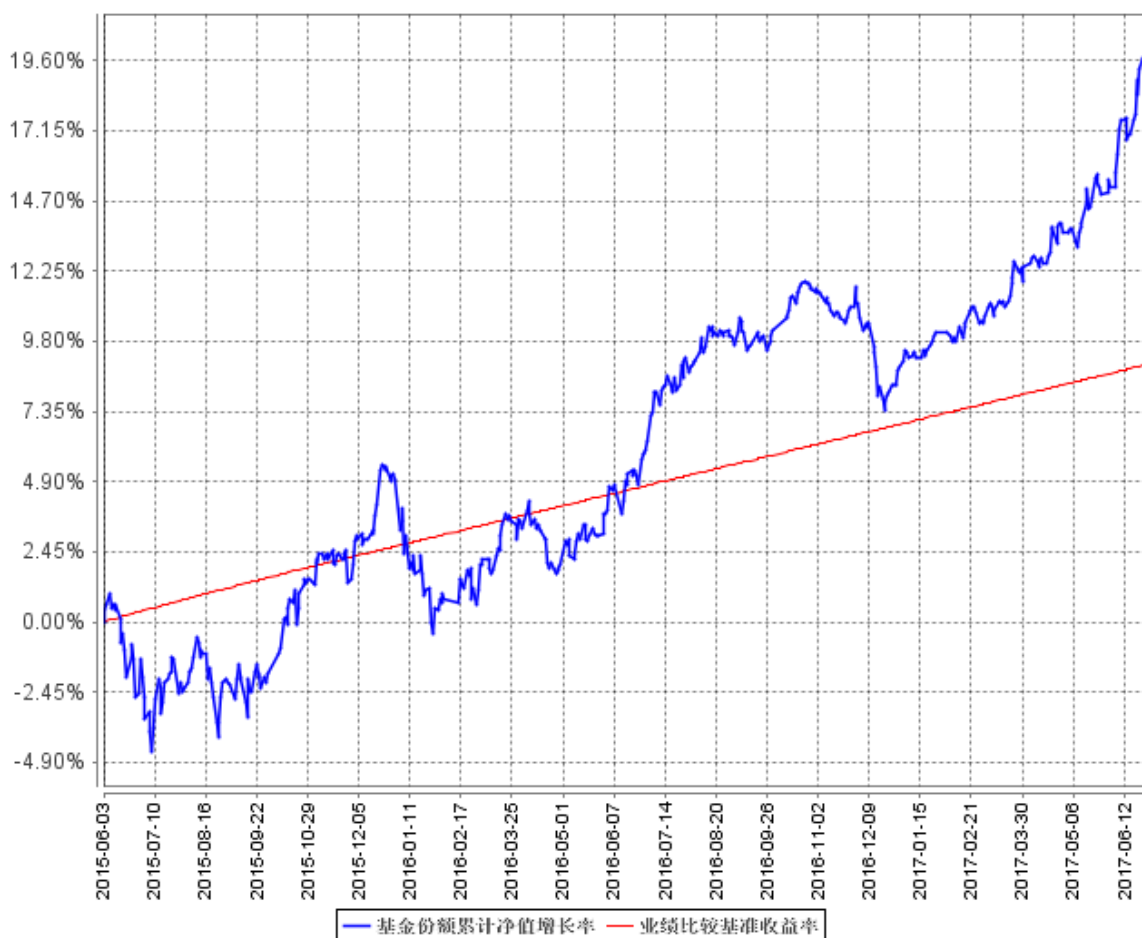
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日；

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

$$benchmark_T^t = [\prod_{f=t}^T (1 + benchmark_f)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{f=t}^T (1 + benchmark_f)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + benchmark_f)$ 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 2017 年 6 月 30 日。

(2) 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。截至 2017 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、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、东方红纯债债券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、东方红汇利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二十七只证券投资基金。

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	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募权益投	2015 年 6 月 3 日	-	19 年	硕士，曾任东方证券研究所研究员、资产管理业务总部投资经理，上海东方

	<p>资部总经理、兼任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、东方红睿逸定期开放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、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>				<p>证券资产管理有限公司投资部投资经理、专户投资部资深投资经理、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、公募权益投资部总经理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、东方红睿逸定期开放混合、东方红沪港深混合、东方红睿华沪港深混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。</p>
<p>纪文静</p>	<p>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</p>	<p>2015年7月14日</p>	<p>-</p>	<p>10年</p>	<p>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、销售交易经理，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固定收益部副总监；现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定</p>

	<p>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、东方红纯债债券 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、东方红信用债 债券型证券投资基 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、东方红 稳添利纯债债券型 发起式证券投资基 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。</p>				<p>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 方红策略精选混合、东方 红纯债债券、东方红收益 增强债券、东方红信用债 债券、东方红汇阳债券、 东方红汇利债券、东方红 稳添利纯债、东方红战略 精选混合、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 定开混合基金经理。具有 基金从业资格，中国国籍。</p>
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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》等规定。

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

2017 年上半年 A 股市场结构性的行情依然非常明显，在整体市场风险偏好下降的情况下，市场的存量资金仍然在向估值相对较低的龙头公司倾斜；另一个层面，增量资金主要来自于通过沪港通深港通北上的海外资金，这些资金一向比较青睐有竞争力的低估值龙头企业，导致市场的盘面分化更加加剧，市场的结构化行情一度引发了漂亮 50 的广泛讨论。

2017 年上半年受基本面数据强劲、货币政策收紧以及金融监管等因素影响，债券市场出现了大幅下跌，10 年期国债收益率从年初 3.1%最高上升至 3.7%附近，信用债也出现了 100BP 以上幅度的调整。而 5 月中下旬开始，随着监管基调的缓和、央行加大公开市场操作改善流动性预期以及美联储 6 月鸽派加息后央行未跟随上调公开市场操作利率等因素影响，债券收益率高位企稳并有所回落。上半年中债总财富指数下跌 0.5%。

本产品个股选择上以具有较好稳定性和高分红低估值的优质龙头企业为主，包括消费品行业龙头和一些行业供给侧收缩的部分周期品龙头。同时根据宏观环境变化对仓位和配置方向进行适度调整，以起到降低组合波动、提升夏普比例的组合优化作用。同时也积极参与股票与转债一级市场，获取无风险收益。同时在债券配置上适时调仓，控制久期和杠杆，寻求稳健配置为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 1.200 元, 份额累计净值为 1.200 元。本报告期内, 基金份额净值增长率为 10.19%, 同期业绩比较基准收益率为 1.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年宏观经济呈现相对稳定的格局。上半年整体投资增速虽然未能延续去年的复苏趋势, 但也未出现明显下行, 整体仍然呈现企稳的格局, 好于市场预期。展望下半年, 考虑到美国及欧洲经济持续好转, 不排除国内经济出现继续超预期的情况。

从权益市场来看, 在经济转型期虽然整体经济增速回落, 但仍有一些竞争优势突出、符合经济转型方向的公司能够获得稳定成长, 其中一些估值合理的股票具备长期配置价值。下半年我们认为权益市场仍是以结构性机会为主, 我们仍将追随社会发展的大趋势而选择估值合理的优秀公司, 期望给投资者带来回报。

从债券市场来看, 金融监管以及货币政策边际再收紧概率降低都将使市场面临的环境较上半年有所好转, 但经济回落幅度短期内或不及预期、海外数据好转也带来货币政策的转向, 都将导致短期内市场仍维持震荡走势。下半年操作上, 我们将精选个券, 目标以获取稳定的票息收入为主, 同时关注市场波动带来的机会。

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、合规总监(或督察长)、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。

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，每份基金份额每次收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额截至收益分配基准日可供分配利润的 10%；
- 3、若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 4、本基金收益分配方式仅现金分红一种方式；
- 5、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；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末进行利润分配。

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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,191,672.17	50,548,486.42
结算备付金		14,525,119.65	16,873,274.01
存出保证金		71,497.30	55,211.24
交易性金融资产	6.4.7.2	961,455,313.28	1,103,932,369.96
其中：股票投资		237,172,512.88	222,281,514.96
基金投资		-	-
债券投资		724,282,800.40	881,650,855.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	11,967,198.56	9,999,709.07
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,003,210,800.96	1,181,409,050.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		182,000,000.00	229,000,000.00
应付证券清算款		13,894,215.50	50,072,883.84
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,041,320.16	1,146,492.78
应付托管费		138,842.66	152,865.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	842,649.42	773,206.38
应交税费		-	-
应付利息		-75,136.85	4,570.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	138,848.72	270,000.00
负债合计		197,980,739.61	281,420,019.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	671,118,996.40	826,753,482.17
未分配利润	6.4.7.10	134,111,064.95	73,235,549.17
所有者权益合计		805,230,061.35	899,989,031.34
负债和所有者权益总计		1,003,210,800.96	1,181,409,050.70

注： 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.200 元，基金份额 671,118,996.40 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至
-----	-----	-----------------------	----------------------------

		2017 年 6 月 30 日	2016 年 6 月 30 日
一、收入		97,092,788.85	19,622,387.70
1.利息收入		15,230,478.32	16,637,603.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	443,891.70	538,196.05
债券利息收入		14,785,184.96	16,057,842.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,401.66	41,564.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,780,250.64	11,258,237.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	20,277,860.75	-294,261.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-8,249,440.64	7,969,256.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,751,830.53	3,583,242.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	65,530,171.61	-9,584,948.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	551,888.28	1,311,495.18
减：二、费用		11,035,490.96	11,855,965.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,771,196.11	7,866,161.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	902,826.11	1,048,821.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	213,631.97	562,440.16
5. 利息支出		2,979,546.54	2,207,506.24
其中：卖出回购金融资产支出		2,979,546.54	2,207,506.24
6. 其他费用	6.4.7.20	168,290.23	171,036.05
三、利润总额（亏损总额以“-”		86,057,297.89	7,766,421.84

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		86,057,297.89	7,766,421.84

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	826,753,482.17	73,235,549.17	899,989,031.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	86,057,297.89	86,057,297.89
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）	-155,634,485.77	-25,181,782.11	-180,816,267.88
其中：1.基金申购款	29,722,256.98	5,010,169.70	34,732,426.68
2.基金赎回款	-185,356,742.75	-30,191,951.81	-215,548,694.56
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)	671,118,996.40	134,111,064.95	805,230,061.35
项目	上年度可比期间 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

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：

陈光明

基金管理人负责人

任莉

主管会计工作负责人

詹朋

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”)《关于核准东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》(证监许可[2015]783号文)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》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、开放式和发起式,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,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

本基金的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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《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、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。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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》、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[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》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。

(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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	15,191,672.17
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	15,191,672.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	168,093,032.54	237,172,512.88	69,079,480.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	459,962,352.00	455,407,800.40	-4,554,551.60

	银行间市场	270,414,556.89	268,875,000.00	-1,539,556.89
	合计	730,376,908.89	724,282,800.40	-6,094,108.49
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		898,469,941.43	961,455,313.28	62,985,371.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	6,274.69
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6,536.00
应收债券利息	11,954,322.27
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	33.50
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	32.10
合计	11,967,198.56

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	840,349.52
银行间市场应付交易费用	2,299.90
合计	842,649.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	138,848.72
合计	138,848.72

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	826,753,482.17	826,753,482.17
本期申购	29,722,256.98	29,722,256.98
本期赎回(以“-”号填列)	-185,356,742.75	-185,356,742.75
本期末	671,118,996.40	671,118,996.40

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	77,950,948.56	-4,715,399.39	73,235,549.17
本期利润	20,527,126.28	65,530,171.61	86,057,297.89
本期基金份额交易产生的变动数	-17,225,599.68	-7,956,182.43	-25,181,782.11
其中：基金申购款	3,346,782.74	1,663,386.96	5,010,169.70
基金赎回款	-20,572,382.42	-9,619,569.39	-30,191,951.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	81,252,475.16	52,858,589.79	134,111,064.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	297,170.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	146,123.20
其他	598.34
合计	443,891.70

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日

卖出股票成交总额	100,998,562.80
减：卖出股票成本总额	80,720,702.05
买卖股票差价收入	20,277,860.75

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-8,249,440.64
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-8,249,440.64

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	743,429,199.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	739,676,808.11
减：应收利息总额	12,001,831.97
买卖债券差价收入	-8,249,440.64

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无贵金属申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,751,830.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,751,830.53

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	65,530,171.61
——股票投资	63,763,421.19
——债券投资	1,766,750.42
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	65,530,171.61

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	551,888.28
其他	-
合计	551,888.28

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	209,156.97
银行间市场交易费用	4,475.00
合计	213,631.97

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	99,177.14
银行费用	10,841.51
帐户维护费	18,600.00
其他	-
合计	168,290.23

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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：1. 本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

2. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	65,431,589.51	50.06%	416,089,909.71	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	555,207,962.21	88.75%	228,474,593.98	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	19,554,500,000.00	99.98%	10,063,300,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	47,846.87	50.75%	810,279.92	96.42%
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：1、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。

2、截至报告期末，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资格；本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元资格，并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	6,771,196.11
其中：支付销售机构的客户维护费	3,319,779.43	3,824,871.04

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。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各销售机构对账确认的金额为准。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	902,826.11	1,048,821.55

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。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016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	-	-
期初持有的基金份额	10,004,850.00	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	1.49%	1.21%

注：基金管理人运用自有资金于 2015 年 5 月 18 日认购东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金，按照招募说明书规定，认购费 1000 元。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	15,191,672.17	297,170.16	4,226,187.54	467,610.28

注：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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金支付给东证期货的交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。本基金本报告期末及上年度末无应付交易手续费余额。本报告期及上年可比期间本基金无交易手续费支出。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，存出保证金不计息。于 2017 年 6 月 30 日，本基金的结算备付金余额为 1,128.07 元，无存出保证金余额；于 2016 年 12 月 31 日，本基金的结算备付金余额为 1,123.97 元，无存出保证金余额。于 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日，本基金结算备付金利息收入 4.08 元；上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日，本基金结算备付金利息收入

1,124.19 元。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-

			日							
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 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 182,000,000.00 元，于 2017 年 07 月 03 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在经营层面设立风险控制委员会，负责在董事会授权范围内的重大经营项目和创新业务的风险评估；在业务操作层面风险管理职责主要由合规与风险管理部和风险管理人员负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	196,374,000.00
合计	-	196,374,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包含期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的其他债券。

3. 本期末未持有需按短期信用评级列示的债券投资。上年度末未评级债券中包含其他未评级债券 196,374,000.00 元。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	241,817,824.40	293,730,855.00
AAA 以下	402,974,976.00	342,826,000.00
未评级	79,490,000.00	48,720,000.00

合计	724,282,800.40	685,276,855.00
----	----------------	----------------

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包含期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的其他债券。

3. 本期末未评级债券中包含国债、政策性金融债 79,490,000.00 元，无其他未评级债券。上年度末未评级债券中包含政策性金融债 48,720,000.00 元，无其他未评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年6月	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
--------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

30 日							
资产							
银行存款	15,191,672.17	-	-	-	-	-	15,191,672.17
结算备付金	14,525,119.65	-	-	-	-	-	14,525,119.65
存出保证金	71,497.30	-	-	-	-	-	71,497.30
交易性金融资产	-	-103,776,595.00	521,872,205.40	98,634,000.00	237,172,512.88	-	961,455,313.28
应收利息	-	-	-	-	-	11,967,198.56	11,967,198.56
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	29,788,289.12	-103,776,595.00	521,872,205.40	98,634,000.00	249,139,711.44	-	1,003,210,800.96
负债							
卖出回购金融资产款	182,000,000.00	-	-	-	-	-	182,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,894,215.50	13,894,215.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,041,320.16	1,041,320.16
应付托管费	-	-	-	-	-	138,842.66	138,842.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	842,649.42	842,649.42
应付利息	-	-	-	-	-	-75,136.85	-75,136.85

其他 负债	-	-	-	-	-	138,848.72	138,848.72
负债 总计	182,000,000.00	-	-	-	-	15,980,739.61	197,980,739.61
利率 敏感 度缺 口	-152,211,710.88	-103,776,595.00	521,872,205.40	98,634,000.00	233,158,971.83	805,230,061.35	
上年 度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行 存款	50,548,486.42	-	-	-	-	-	50,548,486.42
结算 备付 金	16,873,274.01	-	-	-	-	-	16,873,274.01
存出 保证 金	55,211.24	-	-	-	-	-	55,211.24
交易 性金 融资 产	-30,075,000.00	185,208,130.00	625,074,525.00	41,293,200.00	222,281,514.96	1,103,932,369.96	
应收 利息	-	-	-	-	-	9,999,709.07	9,999,709.07
资产 总计	67,476,971.67	30,075,000.00	185,208,130.00	625,074,525.00	41,293,200.00	232,281,224.03	1,181,409,050.70
负债							
卖出 回购 金融 资产 款	229,000,000.00	-	-	-	-	-	229,000,000.00
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	50,072,883.84	50,072,883.84
应付 管理	-	-	-	-	-	1,146,492.78	1,146,492.78

人报酬							
应付托管费						152,865.68	152,865.68
应付交易费用						773,206.38	773,206.38
应付利息						4,570.68	4,570.68
其他负债						270,000.00	270,000.00
负债总计	229,000,000.00					52,420,019.36	281,420,019.36
利率敏感度缺口	-161,523,028.33	30,075,000.00	185,208,130.00	625,074,525.00	41,293,200.00	179,861,204.67	899,989,031.34

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于本报告期末的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	上升 0.25%	-5,758,265.65	-4,936,276.97
	下降 0.25%	5,758,265.65	4,936,276.97

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

基金承受的其他市场价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	237,172,512.88	29.45	222,281,514.96	24.70
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	237,172,512.88	29.45	222,281,514.96	24.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；	
	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	上升 5%	11,215,101.16	11,455,053.47
	下降 5%	-11,215,101.16	-11,455,053.47

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准对应的股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 百分之九十五		
	2. 观察期 统计日之前的 250 个交易日		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	1 天	4,702,303.43	8,291,752.04
	1 周	10,514,670.13	18,540,921.20

6.4.14 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 2017 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 253,625,029.78 元，第二层次的余额为 707,830,283.50 元，无属于第三层次的余额。于 2016 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 222,281,514.96 元，第二层次的余额为 881,578,855.00 元，无属于

第三层次的余额。

(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 2017 年 6 月 30 日及 2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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	237,172,512.88	23.64
	其中：股票	237,172,512.88	23.64
2	固定收益投资	724,282,800.40	72.20
	其中：债券	724,282,800.40	72.20
	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	29,716,791.82	2.96
7	其他各项资产	12,038,695.86	1.20
8	合计	1,003,210,800.96	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	237,164,873.26	29.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	237,172,512.88	29.45

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股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所有股票投资明细

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	2,380,800	51,401,472.00	6.38
2	002475	立讯精密	1,341,738	39,232,419.12	4.87
3	002311	海大集团	1,877,196	34,296,370.92	4.26
4	000333	美的集团	769,521	33,120,183.84	4.11
5	600196	复星医药	1,065,700	33,026,043.00	4.10
6	002415	海康威视	858,637	27,733,975.10	3.44
7	600426	华鲁恒升	1,299,884	15,260,638.16	1.90
8	600066	宇通客车	122,842	2,698,838.74	0.34

9	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
10	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
11	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
12	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
13	600019	宝钢股份	3,600	24,156.00	0.00
14	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
15	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
16	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
17	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
18	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
19	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
20	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
21	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
22	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
23	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
24	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
25	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
26	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
27	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	600887	伊利股份	9,163,466.00	1.02
2	600426	华鲁恒升	6,645,930.01	0.74
3	002311	海大集团	5,172,442.00	0.57
4	600196	复星医药	5,100,213.00	0.57

5	601012	隆基股份	1,820,475.00	0.20
6	600166	福田汽车	1,806,685.00	0.20
7	603833	欧派家居	116,636.32	0.01
8	601952	苏垦农发	97,161.00	0.01
9	601878	浙商证券	93,364.05	0.01
10	603225	新凤鸣	85,295.96	0.01
11	601366	利群股份	74,088.00	0.01
12	002867	周大生	68,604.48	0.01
13	603980	吉华集团	59,322.80	0.01
14	601228	广州港	54,250.10	0.01
15	300660	江苏雷利	47,479.74	0.01
16	603920	世运电路	47,125.00	0.01
17	603113	金能科技	46,741.52	0.01
18	002872	天圣制药	44,807.11	0.00
19	603303	得邦照明	44,562.96	0.00
20	603586	金麒麟	43,723.02	0.00

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	002415	海康威视	40,674,225.24	4.52
2	600309	万华化学	15,448,671.82	1.72
3	000538	云南白药	11,552,571.64	1.28
4	600066	宇通客车	9,028,897.16	1.00
5	600557	康缘药业	5,790,617.80	0.64
6	002073	软控股份	4,513,841.00	0.50

7	600276	恒瑞医药	3,404,342.17	0.38
8	601012	隆基股份	1,876,112.20	0.21
9	000333	美的集团	1,859,788.68	0.21
10	600166	福田汽车	1,769,440.00	0.20
11	000848	承德露露	281,449.00	0.03
12	603833	欧派家居	256,381.32	0.03
13	601228	广州港	241,500.70	0.03
14	601952	苏垦农发	195,025.50	0.02
15	601878	浙商证券	185,070.75	0.02
16	601366	利群股份	166,100.00	0.02
17	002867	周大生	150,778.32	0.02
18	603225	新凤鸣	140,447.27	0.02
19	603303	得邦照明	109,840.64	0.01
20	603980	吉华集团	108,126.15	0.01

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	31,848,278.78
卖出股票收入（成交）总额	100,998,562.80

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	59,570,000.00	7.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	118,111,000.00	14.67
	其中：政策性金融债	19,920,000.00	2.47
4	企业债券	340,640,600.40	42.30

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	189,385,000.00	23.52
7	可转债（可交换债）	16,576,200.00	2.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	724,282,800.40	89.95

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	136501	16 天风 01	500,000	48,625,000.00	6.04
2	136499	16 洪市政	460,000	43,350,400.00	5.38
3	101553022	15 苏州高新 MTN001	400,000	40,288,000.00	5.00
4	170004	17 付息国债 04	400,000	39,648,000.00	4.92
5	127282	15 贵路桥	400,000	39,064,000.00	4.85

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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	71,497.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,967,198.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,038,695.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110032	三一转债	7,128,000.00	0.89
2	110033	国贸转债	7,105,200.00	0.88
3	128010	顺昌转债	2,343,000.00	0.29

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
5,427	123,662.98	10,004,850.00	1.49%	661,114,146.40	98.51%

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	1.49	10,004,850.00	1.49	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	1.49	10,004,850.00	1.49	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	826,753,482.17
本报告期基金总申购份额	29,722,256.98
减：本报告期基金总赎回份额	185,356,742.75
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	671,118,996.40

§ 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

基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的无重大人事变动

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有限公司。该会计师事务所自本基金基金合同生效日（2015年6月3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	65,431,589.51	50.06%	47,846.87	50.75%	-
宏信证券	1	65,276,184.30	49.94%	46,431.44	49.25%	-
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、本基金在本报告期新增租用交易席位情况：新增宏信证券 1 个交易单元。

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	508,622,233.21	87.84%	19,554,500,000.00	99.98%	-	-
宏信证券	70,389,727.68	12.16%	3,000,000.00	0.02%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上海东方证券资产管理有限公司旗下基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报和公司网站	2017 年 1 月 3 日
2	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(摘要) (2017 年第 1 号)	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 1 月 12 日

3	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 1 号）	公司网站	2017 年 1 月 12 日
4	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 1 月 20 日
5	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金 2016 年年度报告	公司网站	2017 年 3 月 30 日
6	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金 2016 年年度报告(摘要)	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 3 月 30 日
7	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 4 月 21 日
8	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金期间开放期(2017 年 6 月 5 日至 2017 年 6 月 16 日)开放申购、赎回业务公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 6 月 1 日
9	东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金暂停大额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报和公司网站	2017 年 6 月 1 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《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》；
- 3、《东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人办公场所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：
www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2017 年 8 月 28 日