

## 东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 第二季度报告

2019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:中国工商银行股份有限公司 报告送出日期:2019年7月18日	
1.1 重要提示	
基金管理人及基金托管人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。	
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证托管人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。	
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,也不保证最低收益。	
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者有风险,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。	
本报告自2019年4月1日起至2019年6月30日止。	
1.2 基金产品概况	
基金名称	东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	004988
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
基金类型	混合型证券投资基金
基金运作方式	契约型、定期开放
基金合同生效日期	2017年12月15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

代码	名称	持仓数量(股)	持仓市值(人民币元)	持仓市值占净值比例(%)
A	沪深300	-	-	-
B	中证500	363,513.25	6,017	0.02
C	创业板	1,167,358,501.4	99,491	0.36
D	中证1000	-	-	-
E	中证800	-	-	-
F	中证2000	64,633,668.03	638	0.00
G	中证100	29,296,259.49	1,171	0.00
H	中证500	-	-	-
I	中证1000	77,948,716.19	4,041	0.01
J	中证2000	36,766,794.91	1,481	0.00
K	中证500	253,400,617.42	13,111	0.05
L	中证1000	99,126,231.16	4,849	0.02
M	中证2000	-	-	-
N	中证500	-	-	-
O	中证1000	-	-	-
P	中证2000	-	-	-
Q	中证500	-	-	-
R	中证1000	-	-	-
S	中证2000	-	-	-
T	中证500	-	-	-
U	中证1000	-	-	-
V	中证2000	-	-	-
W	中证500	-	-	-
X	中证1000	-	-	-
Y	中证2000	-	-	-
Z	中证500	-	-	-
合计		1,637,493,643.47	86,521	0.31

代码	名称	持仓数量(股)	持仓市值(人民币元)	持仓市值占净值比例(%)
A	沪深300	16,868,015.22	676	0.00
B	中证500	16,868,015.22	676	0.00
C	创业板	16,868,015.22	676	0.00
D	中证1000	16,868,015.22	676	0.00
E	中证800	16,868,015.22	676	0.00
F	中证2000	16,868,015.22	676	0.00
G	中证100	16,868,015.22	676	0.00
H	中证500	16,868,015.22	676	0.00
I	中证1000	16,868,015.22	676	0.00
J	中证2000	16,868,015.22	676	0.00
K	中证500	16,868,015.22	676	0.00
L	中证1000	16,868,015.22	676	0.00
M	中证2000	16,868,015.22	676	0.00
N	中证500	16,868,015.22	676	0.00
O	中证1000	16,868,015.22	676	0.00
P	中证2000	16,868,015.22	676	0.00
Q	中证500	16,868,015.22	676	0.00
R	中证1000	16,868,015.22	676	0.00
S	中证2000	16,868,015.22	676	0.00
T	中证500	16,868,015.22	676	0.00
U	中证1000	16,868,015.22	676	0.00
V	中证2000	16,868,015.22	676	0.00
W	中证500	16,868,015.22	676	0.00
X	中证1000	16,868,015.22	676	0.00
Y	中证2000	16,868,015.22	676	0.00
Z	中证500	16,868,015.22	676	0.00
合计		16,868,015.22	676	0.00

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

3.1 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
1.本期基金份额净值	1.0000
2.本期基金份额净值增长率	0.00%
3.本期基金份额净值增长率标准差	0.00%
4.本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差距	0.00%

注:1.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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×40%+中证500指数收益率×60%。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	业绩比较基准	净值增长率与业绩比较基准收益率的差距
过去三个月	-2.26%	1.76%	-4.02%
过去六个月	-1.26%	1.76%	-3.02%
过去一年	-1.26%	1.76%	-3.02%
过去三年	-1.26%	1.76%	-3.02%

注:过去三个月指2019年4月1日至2019年6月30日。

3.2.2 本基金成立以来基金份额净值增长率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。

4.1 基金经理(或基金小组)简介

姓名	国籍	学历	证券从业年限	任职日期
王宇	中国	硕士	10年	2017年12月15日

注:1.上述基金经理或基金小组“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,“基金合同生效日”和“离任日期”均指根据公司决定确定的解聘日期。

2.证券从业年限是指从事证券行业(证券从业人员从业资格管理办法)的从业年限。

4.2 基金经理(或基金小组)的变更情况说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为基金管理人,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投资基金管理条例》及有关法律、法规和基金合同的约定,勤勉尽责,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益行为,本基金运作符合有关法律、法规和基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

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,制定并严格执行相应的制度和流程,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》等相关规定。

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。

4.3.3 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。

4.4 报告期内基金投资的前十名股票

序号	股票代码	股票名称	持仓数量(股)	持仓市值(人民币元)	持仓市值占净值比例(%)
1	000001	平安银行	4,709,944	164,541,204.24	6.42
2	000002	万科A	7,160,575	139,969,240.28	5.31
3	000012	招商银行	3,406,076	122,010,510.00	4.57
4	000004	浦发银行	2,161,361	119,400,000.00	4.29
5	000008	神州数码	3,166,473	106,760,615.40	4.02
6	000215	中兴通讯	3,144,049	103,161,669.03	3.94
7	000027	海信电器	10,622,221	99,920,616.00	3.78
8	000036	招商银行	3,406,076	98,720,000.00	3.72
9	000075	华菱钢铁	3,244,032	64,520,500.00	2.38
10	000018	深发展A	3,011,122	78,261,118.00	2.91

注:1.上述股票的前十名证券“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,“基金合同生效日”和“离任日期”均指根据公司决定确定的解聘日期。

2.证券从业年限是指从事证券行业(证券从业人员从业资格管理办法)的从业年限。

4.2 基金经理(或基金小组)的变更情况说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为基金管理人,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投资基金管理条例》及有关法律、法规和基金合同的约定,勤勉尽责,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益行为,本基金运作符合有关法律、法规和基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

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,制定并严格执行相应的制度和流程,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》等相关规定。

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。

4.3.3 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。

4.4 报告期内基金投资的前十名股票

序号	股票代码	股票名称	持仓数量(股)	持仓市值(人民币元)	持仓市值占净值比例(%)
1	000001	平安银行	4,709,944	164,541,204.24	6.42
2	000002	万科A	7,160,575	139,969,240.28	5.31
3	000012	招商银行	3,406,076	122,010,510.00	4.57
4	000004	浦发银行	2,161,361	119,400,000.00	4.29
5	000008	神州数码	3,166,473	106,760,615.40	4.02
6	000215	中兴通讯	3,144,049	103,161,669.03	3.94
7	000027	海信电器	10,622,221	99,920,616.00	3.78
8	000036	招商银行	3,406,076	98,720,000.00	3.72
9	000075	华菱钢铁	3,244,032	64,520,500.00	2.38
10	000018	深发展A	3,011,122	78,261,118.00	2.91

注:1.上述股票的前十名证券“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,“基金合同生效日”和“离任日期”均指根据公司决定确定的解聘日期。

2.证券从业年限是指从事证券行业(证券从业人员从业资格管理办法)的从业年限。

4.2 基金经理(或基金小组)的变更情况说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为基金管理人,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投资基金管理条例》及有关法律、法规和基金合同的约定,勤勉尽责,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益行为,本基金运作符合有关法律、法规和基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

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,制定并严格执行相应的制度和流程,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》等相关规定。

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。

4.3.3 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。

4.4 报告期内基金投资的前十名股票

序号	股票代码	股票名称	持仓数量(股)	持仓市值(人民币元)	持仓市值占净值比例(%)
1	000001	平安银行	4,709,944	164,541,204.24	6.42
2	000002	万科A	7,160,575	139,969,240.28	5.31
3	000012	招商银行	3,406,076	122,010,510.00	4.57
4	000004	浦发银行	2,161,361	119,400,000.00	4.29
5	000008	神州数码	3,166,473	106,760,615.40	4.02
6	000215	中兴通讯	3,144,049	103,161,669.03	3.94
7	000027	海信电器	10,622,221	99,920,616.00	3.78
8	000036	招商银行	3,406,076	98,720,000.00	3.72
9	000075	华菱钢铁	3,244,032	64,520,500.00	2.38
10	000018	深发展A	3,011,122	78,261,118.00	2.91

注:1.上述股票的前十名证券“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,“基金合同生效日”和“离任日期”均指根据公司决定确定的解聘日期。

2.证券从业年限是指从事证券行业(证券从业人员从业资格管理办法)的从业年限。

4.2 基金经理(或基金小组)的变更情况说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为基金管理人,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投资基金管理条例》及有关法律、法规和基金合同的约定,勤勉尽责,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益行为,本基金运作符合有关法律、法规和基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

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,制定并严格执行相应的制度和流程,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》等相关规定。

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。

4.3.3 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。

4.4 报告期内基金投资的前十名股票

序号	股票代码	股票名称	持仓数量(股)	持仓市值(人民币元)	持仓市值占净值比例(%)
1	000001	平安银行	4,709,944	164,541,204.24	6.42
2	000002	万科A	7,160,575	139,969,240.28	5.31
3	000012	招商银行	3,406,076	122,010,510.00	4.57
4	000004	浦发银行	2,161,361	119,400,000.00	4.29
5	000008	神州数码	3,166,473	106,760,615.40	4.02
6	000215	中兴通讯	3,144,049	103,161,669.03	3.94
7	000027	海信电器	10,622,221	99,920,616.00	3.78
8	000036	招商银行	3,406,076	98,720,000.00	3.72
9	000075	华菱钢铁	3,244,032	64,520,500.00	2.38
10	000018	深发展A	3,011,122	78,261,118.00	2.91

注:1.上述股票的前十名证券“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,“基金合同生效日”和“离任日期”均指根据公司决定确定的解聘日期。

2.证券从业年限是指从事证券行业(证券从业人员从业资格管理办法)的从业年限。

4.2 基金经理(或基金小组)的变更情况说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为基金管理人,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投资基金管理条例》及有关法律、法规和基金合同的约定,勤勉尽责,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益行为,本基金运作符合有关法律、法规和基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

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,制定并严格执行相应的制度和流程,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》等相关规定。

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。

4.3.3 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。

4.4 报告期内基金投资的前十名股票

序号	股票代码	股票名称	持仓数量(股)	持仓市值(人民币元)	持仓市值占净值比例(%)
1	000001	平安银行	4,709,944	164,541,204.24	6.42
2	000002	万科A	7,160,575	139,969,240.28	5.31
3	000012	招商银行	3,406,076	122,010,510.00	4.57
4	000004	浦发银行	2,161,361	119,400,000.00	4.29
5	000008	神州数码	3,166,473	106,760,615.40	4.02
6	000215	中兴通讯	3,144,049	103,161,669.03	3.94
7	000027	海信电器	10,622,221	99,920,616.00	3.78
8	000036	招商银行	3,406,076	98,720,000.00	3.72
9	000075	华菱钢铁	3,244,032	64,520,500.00	2.38
10	000018	深发展A	3,011,122	78,261,118.00	2.91

注:1.上述股票的前十名证券“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,“基金合同生效日”和“离任日期”均指根据公司决定确定的解聘日期。

2.证券从业年限是指从事证券行业(证券从业人员从业资格管理办法)的从业年限。

4.2 基金经理(或基金小组)的变更情况说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为基金管理人,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投资基金管理条例》及有关法律、法规和基金合同的约定,勤勉尽责,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益行为,本基金运作符合有关法律、法规和基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

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,制定并严格执行相应的制度和流程,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》等相关规定。

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。

4.3.3 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。

4.4 报告期内基金投资的前十名股票

序号	股票代码	股票名称	持仓数量(股)	持仓市值(人民币元)	持仓市值占净值比例(%)
1	000001	平安银行	4,709,944	164,541,204.24	6.42
2	000002	万科A	7,160,575	139,969,240.28	5.31
3	000012	招商银行	3,406,076	122,010,510.00	4.57
4	000004	浦发银行	2,161,361	119,400,000.00	4.29
5	000008	神州数码	3,166,473	106,760,615.40	4.02
6	000215	中兴通讯	3,144,049	103,161,669.03	3.94
7	000027	海信电器	10,622,221	99,920,616.00	3.78
8	000036	招商银行	3,406,076	98,720,000.00	3.72
9	000075	华菱钢铁	3,244,032	64,520,500.00	2.38
10	000018	深发展A	3,011,122	78,261,118.00	2.91

注:1.上述股票的前十名证券“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,“基金合同生效日”和“离任日期”均指根据公司决定确定的解聘日期。

2.证券从业年限是指从事证券行业(证券从业人员从业资格管理办法)的从业年限。

4.2 基金经理(或基金小组)的变更情况说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为基金管理人,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投资基金管理条例》及有关法律、法规和基金合同的约定,勤勉尽责,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人的利益行为,本基金运作符合有关法律、法规和基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

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,制定并严格执行相应的制度和流程,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》等相关规定。

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。

4.3.3 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。