

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型
证券投资基金
(原东方红睿阳灵活配置混合型证券投资
基金 (LOF))
2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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。

本报告中财务资料未经审计。

基金转型前：报告期 2019 年 1 月 1 日-2019 年 1 月 15 日。

基金转型后：报告期 2019 年 1 月 16 日-2019 年 3 月 31 日。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	东方红睿阳三年定开混合
场内简称	东证睿阳
基金主代码	169102
基金运作方式	契约型、以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。
基金合同生效日	2019 年 1 月 16 日
报告期末基金份额总额	1,115,519,706.08 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金在中国经济增长模式转型的大背景下，寻找符合经济发展趋势的行业，积极把握由新型城镇化、人口结构调整、资源环境约束、产业升级、商业模式创新等大趋势带来的投资机会，挖掘重点行业中的优势个股，自下而上精选具有核心竞争优势的企业，分享转型期中国经济增长成果，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，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。除了需要承担与境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，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	东方红睿阳混合
场内简称	东证睿阳
基金主代码	169102
前端交易代码	169102
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 19 日
报告期末基金份额总额	1,130,881,034.91 份
投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金在中国经济增长模式转型的大背景下，寻找符合经济发展趋势的行业，积极把握由新型城镇化、人口结构调整、资源环境约束、产业升级、商业模式创新等大趋势带来的投资机会，挖掘重点行业中的优势个股，自下而上精选具有核心竞争优势的企业，分享转型期中国经济增长的成果，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	本基金在封闭期内的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率（税后）；本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。
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。
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019 年 1 月 16 日 - 2019 年 3 月 31 日)
1. 本期已实现收益	3,578,881.46
2. 本期利润	231,674,258.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2077
4. 期末基金资产净值	1,349,639,128.65
5. 期末基金份额净值	1.2099

注：（1）所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) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 1 月 15 日)
1. 本期已实现收益	-418,164.29
2. 本期利润	17,901,616.73
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0237
4. 期末基金资产净值	1,133,356,922.09
5. 期末基金份额净值	1.002

注：(1) 所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) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

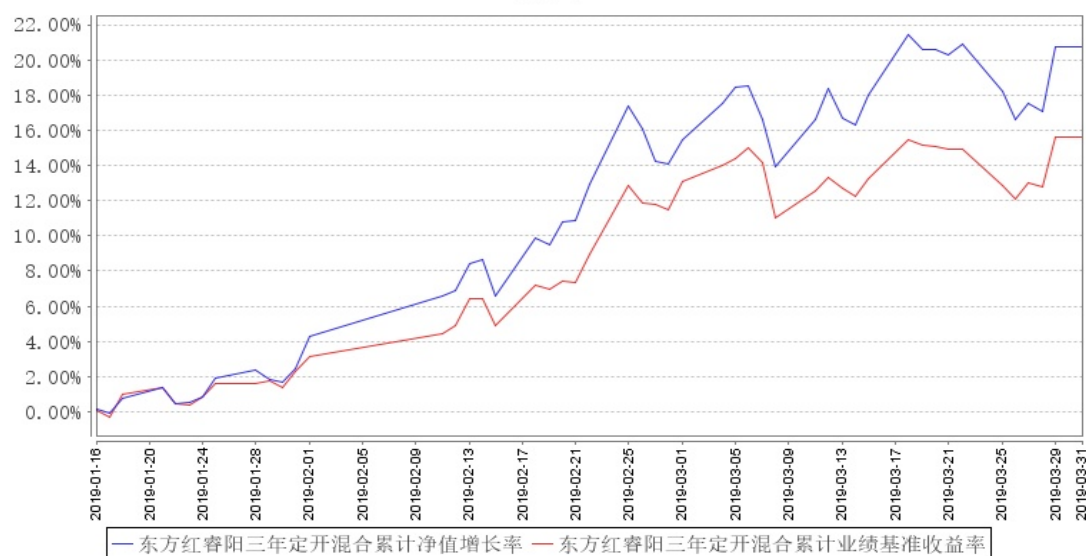
3.2 基金净值表现（转型后）

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 ①	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
自 2019-01-16 至 2019-03-31	20.75%	1.41%	15.63%	1.10%	5.12%	0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红睿阳三年定开混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：截止日期为 2019 年 3 月 31 日。

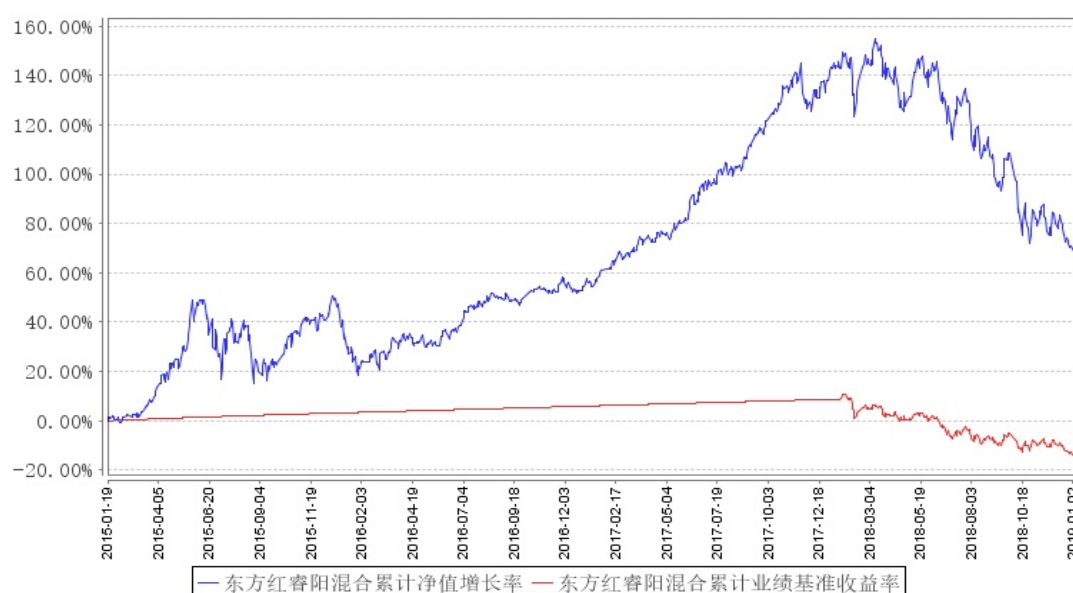
3.2 基金净值表现（转型前）

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 ①	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
自 2019-01-01 至 2019-01-15	1.73%	0.66%	3.15%	1.01%	-1.42%	-0.35%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红睿阳混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：截止日期为 2019 年 1 月 15 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
秦绪文	上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿阳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基金经理。	2017 年 1 月 10 日	—	12 年	硕士，曾任平安证券有限公司证券研究所分析师，东方证券股份有限公司证券研究所董事、汽车行业分析师，上海东方证券资产管理有限公司研究部资深研究员、权益研究部资深研究员；现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿阳混合、东方红沪港深混合基金经理。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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
秦绪文	上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿阳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基金经理。	2017 年 1 月 10 日	-	12 年	硕士，曾任平安证券有限公司证券研究所分析师，东方证券股份有限公司证券研究所董事、汽车行业分析师，上海东方证券资产管理有限公司研究部资深研究员、权益研究部资深研究员；现任上海东方证券资产管理有限公司执行董事兼任东方红睿阳混合、东方红沪港深混合基金经理。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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

1 季度，流动性改善，小微企业融资环境开始好转；国家首次提出金融供给侧改革，认为金融也是国家的核心竞争力之一，并且认为股票市场的繁荣、稳定对宏观经济的稳定发展具有重要的作用；中美贸易谈判取得阶段性成果。上述宏观经济、政策环境的变化极大的提升了股票市场的风险偏好，在 2018 年年底极低的估值的基础上，1 季度 A 股市场迎来一波波澜壮阔的上涨行情。2019 年 1 季度，上证综指上涨 10.1%，深证综指上涨 34.0%，沪深 300 上涨 23.8%，中证 1000 上涨 14.7%。板块方面，家电、食品饮料、计算机涨幅均超过 100%。

1 季度，股票市场的强力反弹，得益于年初的低估值、流动性改善以及市场风险偏好的提升。我们将紧密跟踪持仓标的所在行业的基本面的周期位置、相关标的的风险收益比，严守估值纪律，动态调整组合配置，将组合的风险收益比控制在相对较好的水平。继续坚持价值投资的理念，努力为基金持有人创造价值。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前：截至 2019 年 1 月 15 日（报告期 2019.1.1-2019.1.15），原东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）份额净值为 1.002 元，份额累计净值为 1.728 元，报告期内份额净值增长率为 1.73%，同期业绩比较基准增长率为 3.15%。

转型后：截至 2019 年 3 月 31 日（报告期 2019.1.16-2019.3.31），东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 1.2099 元，份额累计净值为 1.9359 元，报告期内份额净值增长率为 20.75%，同期业绩比较基准增长率为 15.63%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告（转型后：报告期末为 2019 年 3 月 31 日）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,241,619,935.72	91.59
	其中：股票	1,241,619,935.72	91.59
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	113,441,609.05	8.37
8	其他资产	573,322.12	0.04
9	合计	1,355,634,866.89	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 99,768,314.95 元人民币，占期末基金资产净值比例 7.39%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	689,539,856.21	51.09
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	65,838,391.40	4.88
G	交通运输、仓储和邮政业	61,359,170.00	4.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,339,780.44	5.95
J	金融业	44,147,460.00	3.27
K	房地产业	142,039,230.72	10.52
L	租赁和商务服务业	58,587,732.00	4.34
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	1,141,851,620.77	84.60

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
------	---------	--------------

A 基础材料	—	—
B 消费者非必需品	42,573,401.80	3.15
C 消费者常用品	—	—
D 能源	—	—
E 金融	—	—
F 医疗保健	—	—
G 工业	57,194,913.15	4.24
H 信息技术	—	—
I 电信服务	—	—
J 公用事业	—	—
K 房地产	—	—
合计	99,768,314.95	7.39

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

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	5,560,550	137,901,640.00	10.22
2	002415	海康威视	3,422,216	120,017,115.12	8.89
3	600887	伊利股份	2,577,158	75,021,069.38	5.56
4	000002	万科A	2,346,441	72,082,667.52	5.34
5	600048	保利地产	4,912,680	69,956,563.20	5.18
6	600297	广汇汽车	12,422,338	65,838,391.40	4.88
7	300349	金卡智能	2,962,438	61,855,705.44	4.58
8	600004	白云机场	4,151,500	61,359,170.00	4.55
9	300450	先导智能	1,582,161	58,840,567.59	4.36
10	002027	分众传媒	9,511,600	58,587,732.00	4.34

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	552,079.76

2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	21,242.36
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	573,322.12

5.11.4 报告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债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情 况说明
1	002027	分众传媒	17,760,000.00	1.32	大宗交易取得并带有限售期

5.11.6 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。

§ 5 投资组合报告（转型前：报告期末为 2019 年 1 月 15 日）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	523,109,272.25	43.39
	其中：股票	523,109,272.25	43.39
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	323,768,687.87	26.85
8	其他资产	358,825,908.31	29.76

9	合计	1,205,703,868.43	100.00
---	----	------------------	--------

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 17,024,206.30 元人民币，占期末基金资产净值比例 1.50%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	10,578,423.24	0.93
B	采矿业	—	—
C	制造业	330,386,425.23	29.15
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	18,381,654.72	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	109,487.50	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,777,826.50	3.16
J	金融业	143,348.80	0.01
K	房地产业	68,861,457.96	6.08
L	租赁和商务服务业	41,846,442.00	3.69
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	506,085,065.95	44.65

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	—	—
B 消费者非必需品	11,353,150.80	1.00
C 消费者常用品	—	—
D 能源	—	—
E 金融	—	—
F 医疗保健	—	—
G 工业	5,671,055.50	0.50

H 信息技术	—	—
I 电信服务	—	—
J 公用事业	—	—
K 房地产	—	—
合计	17,024,206.30	1.50

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

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	2,577,158	62,109,507.80	5.48
2	002475	立讯精密	3,508,350	52,765,584.00	4.66
3	000002	万科A	1,944,141	48,914,587.56	4.32
4	002027	分众传媒	7,834,200	41,846,442.00	3.69
5	300450	先导智能	1,226,300	34,299,611.00	3.03
6	603228	景旺电子	517,712	24,705,216.64	2.18
7	002470	金正大	3,214,756	22,728,324.92	2.01
8	300349	金卡智能	1,168,950	20,772,241.50	1.83
9	600048	保利地产	1,707,780	19,946,870.40	1.76
10	002415	海康威视	643,355	18,933,937.65	1.67

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,398,357.20
2	应收证券清算款	357,354,617.38
3	应收股利	—
4	应收利息	72,933.73
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	358,825,908.31
---	----	----------------

5.11.4 报告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债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情 况说明
1	002027	分众传媒	15,210,000.00	1.34	大宗交易取得并带有限售期

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2019 年 1 月 16 日）基金 份额总额	1,130,881,034.91
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	15,361,328.83
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	1,115,519,706.08

注：根据《关于东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型及修改基金合同有关事项的议案》经基金份额持有人大会决议生效后，本基金已安排 20 个工作日的集中选择期为基金份额持有人办理赎回业务，集中选择期间为 2018 年 12 月 17 日至 2019 年 1 月 15 日。集中选择期最后一日（即 2019 年 1 月 15 日）发起的赎回申请 15,361,328.83 份，赎回确认日为本基金转型后的第一日（即 2019 年 1 月 16 日）。自 2019 年 1 月 16 日起，本基金管理人根据持有人大会决议执行基金的正式转型，将原基金份额变更为东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金份额。自 2019 年 1 月 16 日起，本基金进入第一个封闭期，封闭期结束之日为第三年年度对日前的倒数第一日。

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	350,405,863.13
报告期期间基金总申购份额	814,395,937.97
减：报告期期间基金总赎回份额	33,920,766.19
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,130,881,034.91

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期，本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，本基金管理人不存在申购、赎回、买卖本基金的情况。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期，本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，本基金管理人不存在申购、赎回、买卖本基金的情况。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。

8.2 存放地点

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

8.3 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

2019 年 4 月 22 日