

东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型
证券投资基金 2019 年第 2 季度报告
(原东方红睿轩灵活配置混合型证券投资
基金 (LOF))

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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 7 月 18 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，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 4 月 1 日-2019 年 4 月 23 日。

基金转型后：报告期 2019 年 4 月 24 日-2019 年 6 月 30 日。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	东方红睿轩三年定开
场内简称	东证睿轩
基金主代码	169103
基金运作方式	本基金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 4 月 24 日
报告期末基金份额总额	2,569,815,120.13 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	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	本基金是一只特殊的开放式基金，以定期开放方式运作，每个封闭期的期限为三年，在封闭期内不办理申购与赎回业务，投资人可通过深圳证券交易所转让基金份额，相对于一般的开放式基金其流动性较差。

	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	平安银行股份有限公司

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	东方红睿轩沪港深混合
场内简称	东证睿轩
基金主代码	169103
基金运作方式	契约型基金，本基金合同生效后，前三年封闭运作，在封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）
基金合同生效日	2016 年 1 月 20 日
报告期末基金份额总额	2,589,502,745.08 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	沪深 300 指数×60%+恒生指数×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，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	平安银行股份有限公司

§ 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 4 月 24 日 - 2019 年 6 月 30 日)
--------	--

1. 本期已实现收益	-4,177,536.71
2. 本期利润	-135,483,919.52
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0527
4. 期末基金资产净值	3,147,140,010.00
5. 期末基金份额净值	1.2247

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4月1日 - 2019年4月23日)
1. 本期已实现收益	6,285,233.31
2. 本期利润	-25,195,261.27
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0094
4. 期末基金资产净值	3,307,765,026.50
5. 期末基金份额净值	1.277

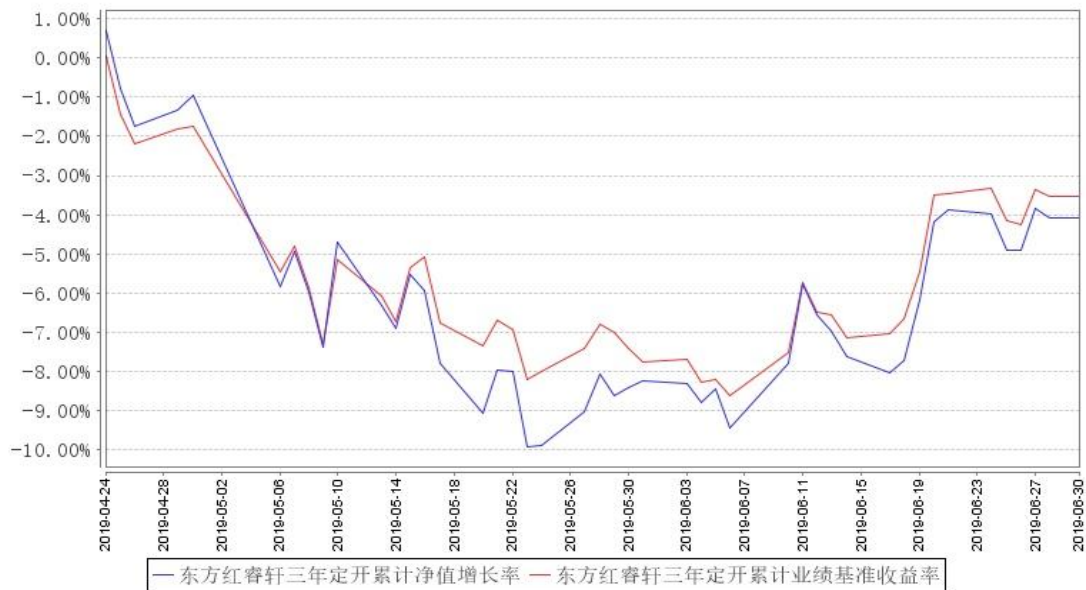
3.2 基金净值表现（转型后）

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 2019-04-24 至 2019-06-30	-4.10%	1.36%	-3.53%	1.09%	-0.57%	0.27%

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

东方红睿轩三年定开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 6 月 30 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 2019-04-01 至 2019-04-23	-0.85%	1.22%	2.59%	0.92%	-3.44%	0.30%

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

东方红睿轩沪港深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 4 月 23 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		
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发起式证券投资基金、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	2016 年 1 月 20 日	-	10 年	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研究部高级研究员、投资经理助理、资深研究员、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总经理助理兼任东方红优势精选混合、东方红睿轩三年定开混合、东方红优享红利混合、东方红智逸沪港深定开混合、东方红沪港深混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

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、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。				
---	--	--	--	--

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。

4.1 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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发起式证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混	2016年1月20日	-	10年	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研究部高级研究员、投资经理助理、资深研究员、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总经理助理兼任东方红优势精选混合、东方红睿轩三年定开混合、东方红优享红利混合、东方红智逸沪港深定开混合、东方红沪港深混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。

	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、东方红智逸沪港深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 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

2019 年二季度沪深 300 指数下跌 1.21%，中小板指下跌 10.99%，创业板指下跌 10.75%。2019 年二季度由于中美贸易争端出现反复等因素整体呈现调整格局。食品饮料（12.1%）、家用电器（2.5%）、银行（1.3%）、非银（0.8%）、休闲服务（0.6%）是为数不多的正收益的行业，传媒（-15.8%）、轻工制造（-14.1%）、钢铁（-13.2%）、纺织服装（-13.0%）、建筑装饰（-11.9%）等行业跌幅较大。

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前：截至 2019 年 4 月 23 日（报告期 2019.4.1-2019.4.23），原东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）份额净值为 1.277 元，份额累计净值为 1.615 元，报告期内份额净值增长率为-0.85%，同期业绩比较基准增长率为 2.59%。

转型后：截至 2019 年 6 月 30 日（报告期 2019.4.24-2019.6.30），东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 1.2247 元，份额累计净值为 1.5627 元，报告期内份额净值增长率为-4.10%，同期业绩比较基准增长率为-3.53%。

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）

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	2,588,753,878.66	82.05
	其中：股票	2,588,753,878.66	82.05
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	559,169,321.30	17.72
8	其他资产	7,266,868.96	0.23
9	合计	3,155,190,068.92	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 340,229,337.99 元人民币，占期末基金资产净值比例 10.81%。

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	363,431.25	0.01
C	制造业	1,122,435,689.39	35.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,906,408.00	0.57
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	311,496,153.15	9.90
J	金融业	157,290,733.60	5.00

K	房地产业	473,820,019.57	15.06
L	租赁和商务服务业	114,875,730.31	3.65
M	科学研究和技术服务业	50,313,268.80	1.60
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,248,524,540.67	71.45

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	52,659,434.05	1.67
B 消费者非必需品	19,975,431.88	0.63
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	183,422,973.44	5.83
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	33,469,303.68	1.06
K 房地产	50,702,194.94	1.61
合计	340,229,337.99	10.81

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	600048	保利地产	21,330,807	272,181,097.32	8.65
2	000333	美的集团	4,612,620	239,210,473.20	7.60
3	600887	伊利股份	6,832,684	228,279,972.44	7.25
4	002415	海康威视	7,176,092	197,916,617.36	6.29
5	000961	中南建设	19,878,333	168,489,763.78	5.35
6	02869	绿城服务	28,500,000	158,193,656.10	5.03
7	002475	立讯精密	5,754,022	140,525,205.38	4.47
8	002027	分众传媒	21,715,639	114,875,730.31	3.65
9	600036	招商银行	3,071,320	110,506,093.60	3.51
10	300166	东方国信	7,305,383	89,783,157.07	2.85

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投资。

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。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。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	1,057,778.23
2	应收证券清算款	3,154,016.53
3	应收股利	2,949,416.10
4	应收利息	105,658.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,266,868.96

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	000961	中南建设	63,718,200.00	2.02	大宗交易取得并带有限售期
2	002475	立讯精密	33,828,500.00	1.07	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）

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	2,651,899,068.20	79.10
	其中：股票	2,651,899,068.20	79.10
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	696,347,105.11	20.77
8	其他资产	4,205,283.27	0.13
9	合计	3,352,451,456.58	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 308,722,796.06 元人民币，占期末基金资产净值比例 9.33%。

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	1,208,098,112.24	36.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,122,168.00	0.58
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	38,575.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	330,489,077.75	9.99
J	金融业	106,589,069.60	3.22
K	房地产业	488,287,930.62	14.76
L	租赁和商务服务业	143,151,595.29	4.33
M	科学研究和技术服务业	47,399,742.88	1.43
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	2,343,176,272.14	70.84

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	53,139,479.49	1.61
B 消费者非必需品	16,799,666.32	0.51
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	161,551,932.20	4.88
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	25,764,969.24	0.78
K 房地产	51,466,748.81	1.56
合计	308,722,796.06	9.33

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	600048	保利地产	21,330,807	285,832,813.80	8.64
2	002415	海康威视	7,176,092	237,743,927.96	7.19
3	000333	美的集团	4,324,758	226,055,100.66	6.83
4	600887	伊利股份	6,832,684	208,260,208.32	6.30
5	000961	中南建设	19,878,333	167,279,580.45	5.06
6	002475	立讯精密	5,754,022	150,780,485.20	4.56
7	002027	分众传媒	20,133,839	143,151,595.29	4.33
8	02869	绿城服务	24,194,000	141,089,183.62	4.27
9	600036	招商银行	3,025,520	106,589,069.60	3.22
10	300166	东方国信	7,064,483	100,810,172.41	3.05

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投资。

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。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。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	3,584,095.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	621,188.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,205,283.27

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	000961	中南建设	62,629,000.00	1.89	大宗交易取得并带有限售期
2	002475	立讯精密	36,293,500.00	1.10	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4月24日）基金份额总额	2,589,502,745.08
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	19,687,624.95

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	2,569,815,120.13

注:根据《关于东方红睿轩沪港深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,集中选择期期间为 2019 年 3 月 22 日至 2019 年 4 月 23 日。集中选择期最后一日(即 2019 年 4 月 23 日)发起的赎回申请 19,687,624.95 份,赎回确认日为本基金转型后的第一日(即 2019 年 4 月 24 日)。自 2019 年 4 月 24 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轩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 4 月 24 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	2,727,107,490.54
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	137,604,745.46
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	2,589,502,745.08

§ 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、赎回或交易本基金的情况。

§ 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、赎回或交易本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本报告期内本基金无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立东方红睿轩沪港深灵活配置混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿轩沪港深灵活配置混合型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。

9.2 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。

9.3 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 7 月 18 日