

# 东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金

## 2022 年第 1 季度报告

2022 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2022 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 月 20 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 东方红启瑞三年持有混合   |
| 基金主代码      | 910011  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式<br>原东方红-新睿 3 号集合资产管理计划份额在基金合同生效后变更为 A 类基金份额，不设置锁定持有期，但仅开放日常赎回业务，不开放日常申购业务。B 类基金份额开放日常申购与赎回业务，但对每份 B 类基金份额设置三年锁定持有期（由红利再投资而来的 B 类基金份额除外）。 |
| 基金合同生效日    | 2021 年 3 月 22 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 19,422,407.16 份   |
| 投资目标       | 本基金通过综合运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，追求基金资产的稳健增值。  |
| 投资策略       | 本基金运用多种策略进行投资。在大类资产配置上，通过分析宏观经济指标，对各类资产的风险收益特征进行预测，合理配置股票、债券的投资比例，并适当使用衍  |

|                 |  |                       |
|-----------------|--|-----------------------|
|                 | <p>生品等工具进行风险对冲。在股票投资上，本基金将采取自上而下和自下而上相结合的选股方法，综合应用基于行业轮动、风格轮动的策略、基于基本面选股的策略，也会适度使用逆向投资策略。此外，本基金还会使用可转债投资策略，定增及定增破发股票、大宗交易等折价套利策略。</p> <p>本基金 B 类份额参与资金三年锁定期满后方可赎回，基金管理人可以更好地进行中长期布局，深入挖掘中长期价值，贯彻长期价值投资的理念。</p> |                       |
| 业绩比较基准          | <p>沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%+中债综合指数收益率×20%。</p>  |                       |
| 风险收益特征          | <p>本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>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。</p>                               |                       |
| 基金管理人           | <p>上海东方证券资产管理有限公司</p>  |                       |
| 基金托管人           | <p>上海浦东发展银行股份有限公司</p>  |                       |
| 下属分级基金的基金简称     | <p>东方红启瑞三年持有混合 A</p>   | <p>东方红启瑞三年持有混合 B</p>  |
| 下属分级基金的交易代码     | <p>910011</p>  | <p>011312</p>         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | <p>15,017,446.86 份</p>   | <p>4,404,960.30 份</p> |

注：2021 年 3 月 22 日东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金由东方红-新睿 3 号集合资产管理计划转型而来，基金合同当日生效，并于当日开始办理 B 类份额申购业务。本基金 A、B 两类份额生效日均为 2021 年 3 月 22 日，B 类份额生效首日（即 2021 年 3 月 22 日）的份额净值同 A 类份额当日的份额净值，为 3.1551 元。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日） |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
|                 | 东方红启瑞三年持有混合 A                       | 东方红启瑞三年持有混合 B |
| 1. 本期已实现收益      | -5,903,194.13                       | -689,615.56   |
| 2. 本期利润         | -8,174,387.59                       | -355,244.67   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.5201                             | -0.3539       |
| 4. 期末基金资产净值     | 38,028,691.95                       | 11,077,772.25 |
| 5. 期末基金份额净值     | 2.5323                              | 2.5148        |

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

#### 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

东方红启瑞三年持有混合 A

| 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   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -16.86% | 1.30%     | -10.87%    | 1.21%         | -5.99% | 0.09% |
| 过去六个月      | -20.35% | 1.11%     | -10.38%    | 0.95%         | -9.97% | 0.16% |
| 过去一年       | -20.89% | 1.47%     | -13.67%    | 0.90%         | -7.22% | 0.57% |
| 自基金合同生效起至今 | -19.87% | 1.46%     | -13.25%    | 0.91%         | -6.62% | 0.55% |

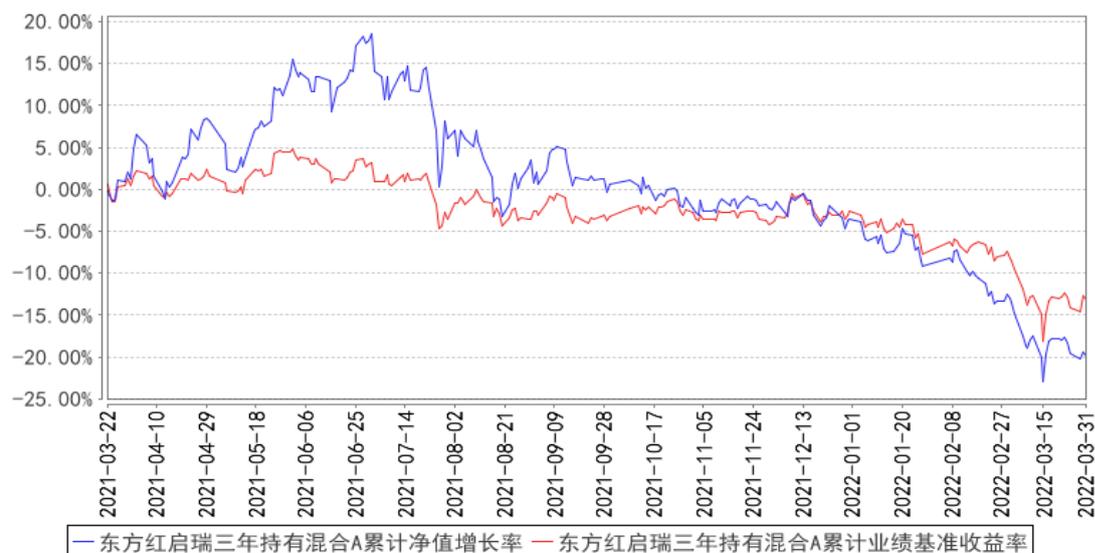
东方红启瑞三年持有混合 B

| 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   |
|-------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | -16.99% | 1.30%     | -10.87%    | 1.21%         | -6.12%  | 0.09% |
| 过去六个月 | -20.62% | 1.11%     | -10.38%    | 0.95%         | -10.24% | 0.16% |
| 过去一年  | -21.43% | 1.47%     | -13.67%    | 0.90%         | -7.76%  | 0.57% |

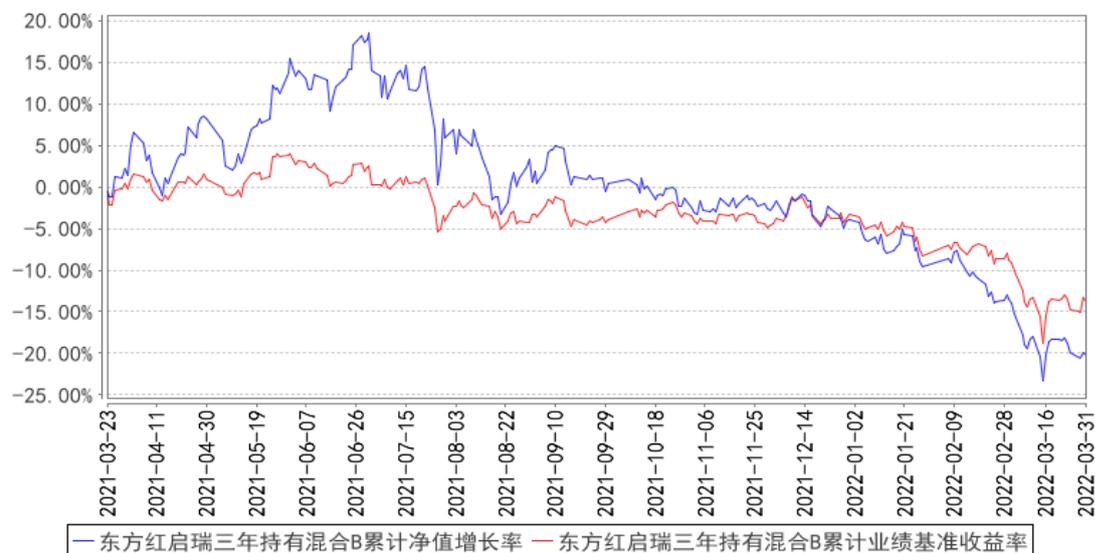
|                |         |       |         |       |        |       |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 自基金合同<br>生效起至今 | -20.29% | 1.46% | -13.84% | 0.91% | -6.45% | 0.55% |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|

### 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

东方红启瑞三年持有混合A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



东方红启瑞三年持有混合B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：本基金建仓期 6 个月，即从 2021 年 3 月 22 日起至 2021 年 9 月 21 日，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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 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 |        |   |
| 高义 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理 | 2021 年 3 月 22 日 | -    | 13 年   | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2021 年 01 月至今任 东方红多元策略混合型证券投资基金基金经理、2021 年 03 月至今任东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 07 月至今任东方红新源三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 07 月至今任东方红新海混合型证券投资基金基金经理。北京大学经济学博士。曾任东方证券研究所宏观策略高级研究员、资产管理业务总部首席策略师，上海东方证券资产管理有限公司宏观策略研究员、投资主办人、投资经理。具备证券投资基金从业资格。 |

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。

##### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 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，严格按照《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，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 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投资组合，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，主要指数均有所下跌，行业方面，除煤炭、地产、综合、银行、农林牧渔、建筑装饰外，其他行业均下跌，跌幅较大的是电子、军工、汽车、食品饮料、家用电器、机械设备等。总体看，一季度市场表现较差，主要原因有几个方面：一是过去几年上涨后，市场估值相对偏高，自去年 2 月以来，估值消化持续进行；二是经济快速下行，叠加上海等多个城市疫情爆发，市场预期悲观；三是外部因素复杂多变，俄乌局势动荡、美联储加息、中概股审计的监管问题等，引发市场担忧；四是赚钱效应消失、投资者风险偏好下降、基金发行数据欠佳等市场因素导致投资者情绪悲观。基于上述因素，报告期内，本基金总体上维持相对较为谨慎的投资策略，可转债仓位总体变化不大，持仓以低价转债为主；股票仓位上保持相对较低配置水平，在持仓结构上也进行一定优化，主要是：减持了部分食品饮料（短期消费基本面下行，估值消化仍需时间），高端制造（需求疲弱、成本上行）和非银金融（成交量下行、市场风险偏好下降）等行业，增持了上游资源（新旧能源转换导致的绿色通胀、全球动荡引发产业链不稳定等）、地产基建（自上而下稳增长配置需求）、旅游交运（看好疫情受损板块未来困境反转的价值）等板块。我们认为，年初以来股票市场的快速调整，或许已反映了大部分悲观预期，风险得到了较为充分的释放，估值已具备一定性价比。短期市场可能仍将维持震荡运行态势，或许有反复，但类似前期那样的快速大幅下跌可能已告一段落，后续市场进入震荡磨底阶段的概率较大。预计 2022 年市场有一定结构性投资机会，全年行业配置节奏可能会呈现先“稳增长”、后“高质量”，“消费内需”殿后的态势。从中长期角度看，今年可能是未来几年一个比较好的建仓阶段，我们看好市场中长期的投资机遇。我们将积极行动，力争为投资者获取稳健回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 2.5323 元，份额累计净值为 2.8473 元；B 类份额净值为 2.5148 元，份额累计净值为 2.5148 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-16.86%，同期业绩比较基准收益率为-10.87%；B 类份额净值增长率为-16.99%，同期业绩比较基准收益率

为-10.87%。

#### 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，本基金于 2022 年 1 月 5 日至 2022 年 3 月 22 日存在基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 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              | 23,990,178.02 | 47.74        |
|    | 其中：股票             | 23,990,178.02 | 47.74        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 6,606,005.27  | 13.15        |
|    | 其中：债券             | 6,606,005.27  | 13.15        |
|    | 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      | 19,616,888.23 | 39.04        |
| 8  | 其他资产              | 38,231.14     | 0.08         |
| 9  | 合计                | 50,251,302.66 | 100.00       |

注：1、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。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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              | 4,422,600.00  | 9.01         |
| C  | 制造业              | 15,052,621.02 | 30.65        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 454,896.00    | 0.93         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,942,084.00  | 5.99         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 410,268.00    | 0.84         |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | -             | -     |
| J | 金融业             | 227,715.00    | 0.46  |
| K | 房地产业            | 479,994.00    | 0.98  |
| 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              | 23,990,178.02 | 48.85 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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  | 601899 | 紫金矿业 | 390,000 | 4,422,600.00 | 9.01         |
| 2  | 600426 | 华鲁恒升 | 99,000  | 3,224,430.00 | 6.57         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 1,400   | 2,406,600.00 | 4.90         |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 11,500  | 1,783,190.00 | 3.63         |
| 5  | 601816 | 京沪高铁 | 309,800 | 1,480,844.00 | 3.02         |
| 6  | 600009 | 上海机场 | 29,700  | 1,461,240.00 | 2.98         |
| 7  | 300122 | 智飞生物 | 9,500   | 1,311,000.00 | 2.67         |
| 8  | 300750 | 宁德时代 | 2,200   | 1,127,060.00 | 2.30         |
| 9  | 000568 | 泸州老窖 | 5,500   | 1,022,340.00 | 2.08         |
| 10 | 601100 | 恒立液压 | 18,700  | 973,335.00   | 1.98         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -            | -            |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 6,606,005.27 | 13.45        |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |

|    |    |              |       |
|----|----|--------------|-------|
| 10 | 合计 | 6,606,005.27 | 13.45 |
|----|----|--------------|-------|

### 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

| 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  | 127005 | 长证转债 | 13,026 | 1,480,781.40 | 3.02         |
| 2  | 110079 | 杭银转债 | 5,490  | 672,374.74   | 1.37         |
| 3  | 110075 | 南航转债 | 5,150  | 637,916.53   | 1.30         |
| 4  | 127027 | 靖远转债 | 3,486  | 460,142.54   | 0.94         |
| 5  | 113563 | 柳药转债 | 4,000  | 444,577.53   | 0.91         |

### 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

注：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

注：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

注：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

注：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将根据风险管理原则，以套期保值为目的，回避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得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，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，回避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约，并与债券现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得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

注：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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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是否超出基金合同规定的备选股票库

本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   | 38,111.19 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | -         |
| 6  | 其他应收款   | 119.95    |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 38,231.14 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 127005 | 长证转债 | 1,480,781.40 | 3.02         |
| 2  | 110079 | 杭银转债 | 672,374.74   | 1.37         |
| 3  | 110075 | 南航转债 | 637,916.53   | 1.30         |
| 4  | 127027 | 靖远转债 | 460,142.54   | 0.94         |
| 5  | 113563 | 柳药转债 | 444,577.53   | 0.91         |
| 6  | 127036 | 三花转债 | 260,562.77   | 0.53         |
| 7  | 113622 | 杭叉转债 | 235,780.38   | 0.48         |
| 8  | 110067 | 华安转债 | 225,150.38   | 0.46         |

|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 9  | 110073 | 国投转债  | 223,944.12 | 0.46 |
| 10 | 127033 | 中装转 2 | 214,542.24 | 0.44 |
| 11 | 110068 | 龙净转债  | 212,687.81 | 0.43 |
| 12 | 127028 | 英特转债  | 212,479.10 | 0.43 |
| 13 | 128132 | 交建转债  | 207,829.71 | 0.42 |
| 14 | 110081 | 闻泰转债  | 201,406.03 | 0.41 |
| 15 | 128035 | 大族转债  | 199,121.91 | 0.41 |
| 16 | 128134 | 鸿路转债  | 123,772.66 | 0.25 |
| 17 | 128121 | 宏川转债  | 76,699.54  | 0.16 |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 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

单位：份

| 项目                        | 东方红启瑞三年持有混合 A | 东方红启瑞三年持有混合 B |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 16,139,792.65 | 325,995.31    |
| 报告期期间基金总申购份额              | -             | 4,078,964.99  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,122,345.79  | -             |
| 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               | 15,017,446.86 | 4,404,960.30  |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                | 东方红启瑞三年持有混合 A | 东方红启瑞三年持有混合 B |
|-------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额  | -             | -             |
| 报告期期间买入/申购总份额     | -             | 776,496.06    |
| 报告期期间卖出/赎回总份额     | -             | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额  | -             | 776,496.06    |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总 | -             | 17.63         |

|          |  |  |
|----------|--|--|
| 份额比例 (%) |  |  |
|----------|--|--|

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额(份)    | 交易金额(元)      | 适用费率(%) |
|----|------|------------|------------|--------------|---------|
| 1  | 申购   | 2022-03-22 | 776,496.06 | 1,998,002.00 | 0.1000  |
| 合计 |      |            | 776,496.06 | 1,998,002.00 |         |

## § 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

注：本基金本报告期内未发生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、中国证监会准予注册东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、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：上海市黄浦区外马路 108 号 7 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

2022 年 4 月 22 日