

东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金  
(原东方红睿玺三年定期开放灵活配置  
混合型证券投资基金)  
2024 年第 2 季度报告

2024 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：2024 年 7 月 19 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 17 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。

自 2024 年 6 月 13 日起，《东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金基金合同》生效，《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合同》同时失效，东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金正式转型为东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金，本报告中转型后本基金的“基金合同生效日”特指 2024 年 6 月 13 日（转型日）。

转型前本基金于 2020 年 11 月 16 日新增 C 类份额，本报告中转型前本基金 C 类份额的“基金合同生效日”特指 2020 年 11 月 16 日。

基金转型前报告期：自 2024 年 04 月 01 日-2024 年 06 月 12 日止。

基金转型后报告期：自 2024 年 06 月 13 日（基金合同生效日）起至 2024 年 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	东方红睿玺三年持有混合
基金主代码	501049
基金运作方式	契约型开放式 本基金每份基金份额设置 3 年锁定持有期（红利再投资所得份额除外）
基金合同生效日	2024 年 6 月 13 日
报告期末基金份额总额	10,001,145,133.59 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	<p>1、资产配置：本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。2、股票投资策略：本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略，利用基金管理人投研团队的资源，对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出价格低估、质地优秀、未来预期成长性良好，符合转型期中国经济发展趋势的上市公司股票（含存托凭证）进行投资。3、此外，本基金还会运用港股通标的股票投资策略、存托凭证投资策略、可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券的投资策略、其他固定收益类证券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略以及融资投资策略等。</p>	
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×20%+中国债券总指数收益率×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	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	
下属分级基金的基金简称	东方红睿玺三年持有混合 A	东方红睿玺三年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	501049	010506
报告期末下属分级基金的份额总额	9,975,746,028.02 份	25,399,105.57 份

## 2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	东方红睿玺三年定开混合
场内简称	东证睿玺（扩位证券简称：东方红睿玺）
基金主代码	501049
基金运作方式	契约型，定期开放式，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	2017 年 11 月 15 日
报告期末基金份额总额	10,163,056,863.77 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	<p>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。</p> <p>基于本基金每满三年开放一次，除开放期外封闭运作的特点，基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力，分散投资，做好流动性管理以应对开放期投资者的赎回需求。</p>
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	<p>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。</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	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	
下属分级基金的基金简称	东方红睿玺三年定开混合 A	东方红睿玺三年定开混合 C
下属分级基金的交易代码	501049	010506
报告期末下属分级基金的份额总额	10,137,424,255.48 份	25,632,608.29 份

### §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（2024 年 6 月 13 日-2024 年 6 月 30 日）	
	东方红睿玺三年持有混合 A	东方红睿玺三年持有混合 C
1. 本期已实现收益	-119,070,211.70	-301,385.16
2. 本期利润	-162,027,816.38	-408,056.71
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0162	-0.0160
4. 期末基金资产净值	7,885,946,505.38	19,718,206.99
5. 期末基金份额净值	0.7905	0.7763

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、本基金于 2024 年 6 月 13 日转型为东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金，新基金合同于 2024 年 06 月 13 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一季度。

#### 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 12 日）	
	东方红睿玺三年定开混合 A	东方红睿玺三年定开混合 C
1. 本期已实现收益	-1,759,969,245.22	-4,563,685.06
2. 本期利润	-3,591,485.52	-20,337.49
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0003	-0.0007
4. 期末基金资产净值	8,177,203,916.45	20,310,362.92
5. 期末基金份额净值	0.8066	0.7924

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 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

东方红睿玺三年持有混合 A

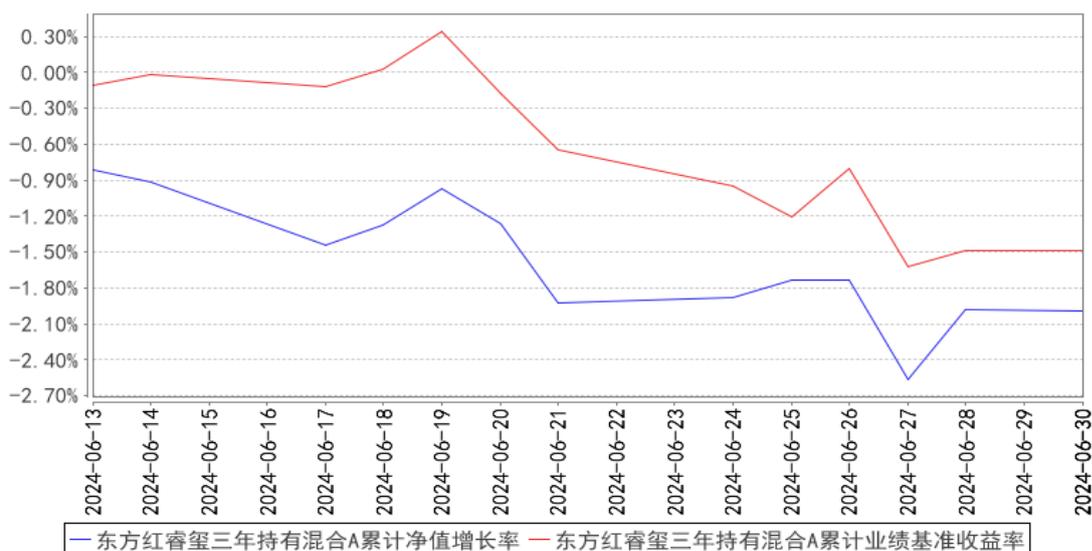
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	-2.00%	0.45%	-1.49%	0.36%	-0.51%	0.09%

东方红睿玺三年持有混合 C

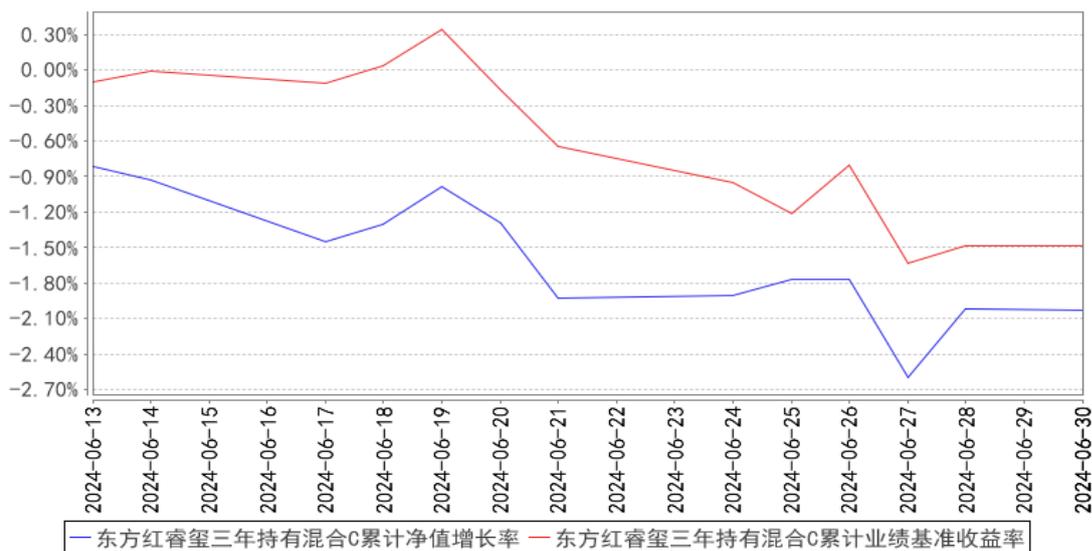
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	-2.03%	0.45%	-1.49%	0.36%	-0.54%	0.09%

#### 3.2.2 自基金转型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

东方红睿玺三年持有混合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



东方红睿玺三年持有混合C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：本基金于 2024 年 6 月 13 日转型为东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金，新基金合同于 2024 年 06 月 13 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

### 3.2 基金净值表现（转型前）

#### 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

东方红睿玺三年定开混合 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
自 2024-04-01 至 2024-06-12	-0.10%	0.82%	1.93%	0.66%	-2.03%	0.16%
自 2024-01-01 至 2024-06-12	-5.40%	1.24%	3.57%	0.77%	-8.97%	0.47%
自 2023-07-01 至 2024-06-12	-13.09%	1.14%	-4.90%	0.74%	-8.19%	0.40%
自 2021-01-01 至 2024-06-12	-37.46%	1.31%	-26.07%	0.89%	-11.39%	0.42%

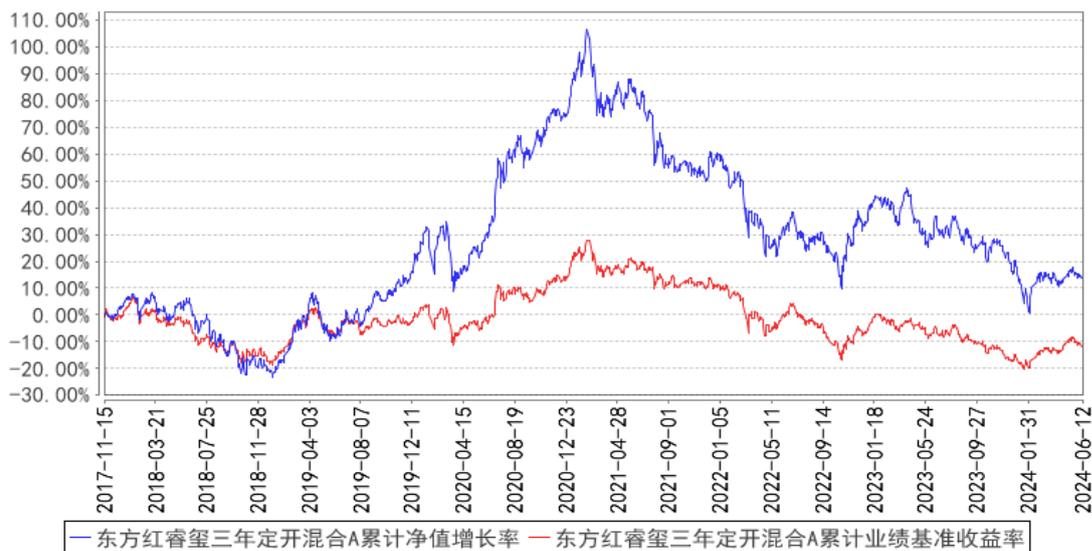
07-01 至 2024-06-12						
自 2019- 07-01 至 2024-06-12	16.46%	1.34%	-9.49%	0.92%	25.95%	0.42%
自基金合同 生效起至 2024-06-12	13.60%	1.36%	-11.86%	0.94%	25.46%	0.42%

东方红睿玺三年定开混合 C

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 2024- 04-01 至 2024-06-12	-0.19%	0.82%	1.93%	0.66%	-2.12%	0.16%
自 2024- 01-01 至 2024-06-12	-5.60%	1.24%	3.57%	0.77%	-9.17%	0.47%
自 2023- 07-01 至 2024-06-12	-13.49%	1.14%	-4.90%	0.74%	-8.59%	0.40%
自 2021- 07-01 至 2024-06-12	-38.37%	1.31%	-26.07%	0.89%	-12.30%	0.42%
自基金合同 生效起至 2024-06-12	-36.35%	1.29%	-21.42%	0.89%	-14.93%	0.40%

### 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

东方红睿玺三年定开混合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



东方红睿玺三年定开混合C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



## §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		
王延飞	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金经理	2017年11月15日	-	13年	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金经理，2015年06月至2018年08月任东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2015年06月至今任东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2016年11

					月至 2018 年 01 月任东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017 年 11 月至今任东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（原东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2020 年 05 月至今任东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。复旦大学管理学硕士。曾任东方证券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行业研究员。具备证券投资基金从业资格。
张伟锋	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2020 年 12 月 21 日	-	7 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2020 年 09 月至 2022 年 06 月任东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理、2020 年 12 月至今任东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（原东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2024 年 06 月至今任东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。上海交通大学高级金融学院 EMBA。曾任上海汉得信息技术有限公司咨询顾问、部门经理，上海汉得信息技术股份有限公司证券事务代表、董事会秘书，上海东方证券资产管理有限公司行业研究员。具备证券投资基金从业资格。
张锋	上海东方证券资产管理有限公司总经理	2024 年 6 月 1 日	-	24 年	上海东方证券资产管理有限公司总经理，2020 年 09 月至 2023 年 08 月任东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2021 年 03 月至 2023 年 09 月任东方红启程三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 04 月至今任东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2024 年 06 月至今任东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（原东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2024 年 06 月至今任东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。复旦大学经济学硕士。曾任上海财政证券公司研究员，兴业证券股份有限公司研究员，上海融昌资产管理有限公司研究员，信诚基金管理有限公司

					股票投资副总监、基金经理，上海东方证券资产管理有限公司基金投资部总监、私募权益投资部总经理、公募集合权益投资部总经理、执行董事、董事总经理、副总经理。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”指转型前基金合同生效日，“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（转型后）

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
张锋	公募基金	3	21,212,825,283.06	2021年4月21日
	私募资产管理计划	5	662,482,966.50	2017年12月8日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	21,875,308,249.56	-

#### 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		
王延飞	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金经理	2017年11月15日	-	13年	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金经理，2015年06月至2018年08月任东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2015年06月至今任东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2016年11月至2018年01月任东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017年11月至今任东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（原东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2020年05月至今任东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。复旦大学管理学硕士。曾任东方证券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行业研究员。具备证券投资基金从

					业资格。
张伟锋	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2020 年 12 月 21 日	-	7 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2020 年 09 月至 2022 年 06 月任东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理、2020 年 12 月至今任东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（原东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2024 年 06 月至今任东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。上海交通大学高级金融学院 EMBA。曾任上海汉得信息技术有限公司咨询顾问、部门经理，上海汉得信息技术股份有限公司证券事务代表、董事会秘书，上海东方证券资产管理有限公司行业研究员。具备证券投资基金从业资格。
张锋	上海东方证券资产管理有限公司总经理	2024 年 6 月 1 日	-	24 年	上海东方证券资产管理有限公司总经理，2020 年 09 月至 2023 年 08 月任东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2021 年 03 月至 2023 年 09 月任东方红启程三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 04 月至今任东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2024 年 06 月至今任东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（原东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2024 年 06 月至今任东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。复旦大学经济学硕士。曾任上海财政证券公司研究员，兴业证券股份有限公司研究员，上海融昌资产管理有限公司研究员，信诚基金管理有限公司股票投资副总监、基金经理，上海东方证券资产管理有限公司基金投资部总监、私募权益投资部总经理、公募集合权益投资部总经理、执行董事、董事总经理、副总经理。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（转型前）

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
张锋	公募基金	3	21,989,425,071.42	2021年4月21日
	私募资产管理计划	5	710,170,992.49	2017年12月8日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	22,699,596,063.91	-

#### 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 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》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

2024 年二季度，上证指数跌 2.43%，深证成指跌 5.87%，创业板指跌 7.41%，恒生指数涨 7.12%。二季度股票市场表现先涨后跌，整体脉络主要是反映对宏观的预期和情绪，4-5 月份市场延续了一季度末对经济数据的乐观态度的趋势，从 6 月份开始，由于宏观数据的走弱，市场也随之再度调整。表现较好的行业和板块仍然是能源、资源、银行、公用事业、红利等方向，而消费和科技偏弱，出口产业链总体震荡下行。央企股票表现好于民企股。从大小盘风格分化来

看，大市值个股明显强于小盘、微盘股票，反映出两个情况：一是在宏观经济新旧动能转换的过渡期内，大企业表现出的抗风险能力、综合实力明显好于小企业，全社会的资源都出现了向头部企业集中的趋势。二是新“国九条”颁布实施以来，加强资本市场监管力度，规范减持、规范融资、加大退市力度，强调提升投资者回报，市场各方重新审视大、小盘股票的估值以及潜在回报率的差异问题，风险偏好发生了转变。

二季度，国内的长端利率继续震荡下行，总体偏弱，债券市场继续保持高度景气，反映出总需求减弱所导致的企业资本开支的需求下降。外部环境方面，以美国为代表的发达经济体的通货膨胀率仍然居高不下，美联储治理通胀的决心和行动表现不强。

百年未有之大变局加速演进，全球经济政治以及消费者和企业的行为正发生深刻变化，且趋势越来越明朗。在全球，供应链分散化、贸易壁垒上升、经济问题政治化等倾向扩散到许多国家。在国内，新质生产力正在加快提升其在 GDP 中的比重，经济增长的新旧动能也在加速转换，产业政策、财政政策和货币政策亦随之而变。对于基金经理而言，这些结构性变化对资产配置和行业配置均构成了重要影响。

本产品紧密跟踪利率对于各行业板块和个股的预期投资回报率的影响，并且针对上述结构性变化，在配置方向和个股上做积极的动态调整。利率下行对于权益投资在一定程度上肯定构成了积极影响，因为它意味着机会成本下降了。当然在经济结构转变的阶段，这种积极影响肯定不会让所有行业都受益，我们将加大研究力度努力寻找部分的结构性投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

转型前：截至 2024 年 6 月 12 日（报告期 2024.04.01-2024.06.12），原东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额净值为 0.8066 元，份额累计净值为 1.3066 元；C 类份额净值为 0.7924 元，份额累计净值为 0.7924 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-0.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.93%；C 类份额净值增长率为-0.19%，同期业绩比较基准收益率为 1.93%。

转型后：截至 2024 年 6 月 30 日（报告期 2024.06.13-2024.06.30），东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金 A 类份额净值为 0.7905 元，份额累计净值为 1.2905 元；C 类份额净值为 0.7763 元，份额累计净值为 0.7763 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-2.00%，同期业绩比较基准收益率为-1.49%；C 类份额净值增长率为-2.03%，同期业绩比较基准收益率为-1.49%。

#### 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	6,061,094,515.76	67.78
	其中：股票	6,061,094,515.76	67.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,055,088.93	0.08
	其中：债券	7,055,088.93	0.08
	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	954,169,000.00	10.67
	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	1,909,067,945.12	21.35
8	其他资产	11,306,534.64	0.13
9	合计	8,942,693,084.45	100.00

注：1、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 968,436,177.93 元人民币，占期末基金资产净值比例 12.25%。

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	208,245,765.00	2.63
B	采矿业	900,442,820.70	11.39
C	制造业	2,672,204,332.99	33.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	790,244,784.00	10.00
E	建筑业	3,640,500.00	0.05
F	批发和零售业	293,397,102.90	3.71
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	169,520,212.24	2.14
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	54,962,820.00	0.70
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	5,092,658,337.83	64.42

### 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（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	440,890,855.72	5.58
15 原材料	12,764,742.48	0.16
20 工业	504,512,929.73	6.38
25 可选消费	10,267,650.00	0.13
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 通信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	968,436,177.93	12.25

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 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	600900	长江电力	27,325,200	790,244,784.00	10.00
2	601899	紫金矿业	43,849,650	770,438,350.50	9.75
3	600019	宝钢股份	77,559,520	515,770,808.00	6.52
4	600426	华鲁恒升	18,944,036	504,669,119.04	6.38
5	300750	宁德时代	2,372,917	427,196,247.51	5.40
6	00883	中国海洋石油	19,107,000	390,624,119.42	4.94
7	000999	华润三九	8,314,990	354,052,274.20	4.48
8	000028	国药一致	9,103,230	293,397,102.90	3.71
9	600660	福耀玻璃	5,900,246	282,621,783.40	3.57
10	02057	中通快递-W	1,778,600	266,544,652.80	3.37

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 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）	7,055,088.93	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,055,088.93	0.09

#### 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	110081	闻泰转债	71,190	7,055,088.93	0.09

#### 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的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。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。

#### 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的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。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。

### 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

本基金投资的前十名证券发行主体中，山东华鲁恒升化工股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到山东省市场监督管理局的处罚，宝山钢铁股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海市应急管理局的处罚。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余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

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,138,121.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	10,168,413.21
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,306,534.64

### 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	110081	闻泰转债	7,055,088.93	0.09

### 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。

## §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	6,230,281,363.82	75.46
	其中：股票	6,230,281,363.82	75.46
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	1,635,126,722.54	19.80
8	其他资产	391,249,820.92	4.74
9	合计	8,256,657,907.28	100.00

注：1、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 890,502,174.94 元人民币，占期末基金资产净值比例 10.86%。

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	217,482,138.00	2.65
B	采矿业	863,771,555.30	10.54
C	制造业	2,975,668,109.38	36.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	791,251,428.00	9.65
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	243,399,980.40	2.97

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	194,084,693.80	2.37
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	54,121,284.00	0.66
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	5,339,779,188.88	65.14

### 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（人民币）	占基金资产净值比例（%）
10 能源	359,389,049.26	4.38
15 原材料	13,492,739.34	0.16
20 工业	338,502,878.06	4.13
25 可选消费	21,702,325.28	0.26
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 通信服务	157,415,183.00	1.92
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	890,502,174.94	10.86

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 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	600900	长江电力	27,880,600	791,251,428.00	9.65
2	601899	紫金矿业	44,658,950	768,580,529.50	9.38
3	600426	华鲁恒升	23,964,736	676,524,497.28	8.25
4	600019	宝钢股份	76,091,820	524,272,639.80	6.40
5	300750	宁德时代	2,265,617	420,498,515.20	5.13
6	000999	华润三九	5,091,100	324,914,002.00	3.96
7	00883	中国海洋石油	15,446,000	306,690,493.47	3.74

8	002223	鱼跃医疗	6,553,009	266,969,586.66	3.26
9	000028	国药一致	6,708,930	243,399,980.40	2.97
10	601118	海南橡胶	42,311,700	217,482,138.00	2.65

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

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的原则，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将根据风险管理的原则，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

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

本基金投资的前十名证券发行主体中，山东华鲁恒升化工股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到山东省市场监督管理局的处罚，宝山钢铁股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海市应急管理局的处罚。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余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	1,522,584.09
2	应收证券清算款	388,216,056.24
3	应收股利	1,511,180.59
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	391,249,820.92

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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（转型后）

单位：份

项目	东方红睿玺三年持有混合 A	东方红睿玺三年持有混合 C
基金合同生效日(2024 年 6 月 13 日)基金份额总额	10,137,424,255.48	25,632,608.29
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	161,678,227.46	233,502.72
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)	-	-
报告期期末基金份额总额	9,975,746,028.02	25,399,105.57

注：本基金基金合同生效日为 2024 年 06 月 13 日。根据《关于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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》经基金份额持有人大会决议生效后，本基金已安排二十个交易日的转型选择期，转型选择期期间，基金份额持有人可以选择将场内份额进行场内赎回、卖出或者通过跨系统转托管转到场外后继续持有场外份额，并同时开放场内买入和场外赎回及转换转出业务。转型选择期期间为 2024 年 5 月 15 日至 2024 年 6 月 12 日。自 2024 年 6 月 13 日起，基金管理人根据基金份额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玺三年持有期混合型证券投资基金相应类别的基金份额。

### §6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	东方红睿玺三年定开混合 A	东方红睿玺三年定开混合 C
报告期期初基金份额总额	11,036,568,515.32	29,312,444.97
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	899,144,259.84	3,679,836.68
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	10,137,424,255.48	25,632,608.29

### §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

注：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

注：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

注：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

注：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

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

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，对《关于东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》（以下简称《议案》）进行了表决。根据 2024 年 5 月 15 日披露的《关于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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2024 年 5 月 14 日表决通过了《议案》，决议自该日起生效。2024 年 6 月 13 日起，本基金正式变更为东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金。变更注册为转型后基金后，A 类基金份额将不再上市交易，且同时取消场内申购赎回安排。具体详情请参见相关公告。

## §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睿玺三年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2024 年 7 月 19 日