

东方红创新优选三年定期开放混合型证券
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	东方红创新优选定开混合
场内简称	东方红创优定开
基金主代码	169106
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	2018 年 3 月 22 日
报告期末基金份额总额	1,394,112,271.02 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	本基金主要投资于固定收益类资产，本基金的投资策略将结合基金每三年开放一次，在封闭期封闭运作，在开放期内有大规模申购赎回的流动性需求的特点，做好流动性管理，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。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*80%+沪深 300 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港股通标的股票。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	中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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）
1. 本期已实现收益	5,739,738.46
2. 本期利润	-36,070,366.35
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0259
4. 期末基金资产净值	1,370,294,107.86
5. 期末基金份额净值	0.9829

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。

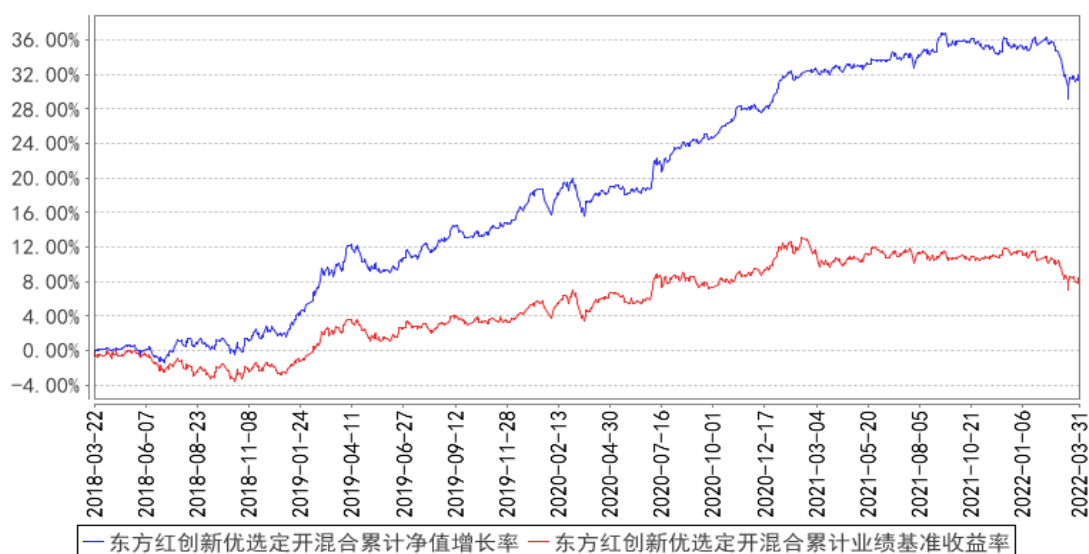
3.2 基金净值表现

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

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	-2.56%	0.34%	-2.92%	0.30%	0.36%	0.04%
过去六个月	-2.99%	0.27%	-2.13%	0.24%	-0.86%	0.03%
过去一年	-0.78%	0.23%	-1.73%	0.23%	0.95%	0.00%
过去三年	19.49%	0.25%	5.19%	0.25%	14.30%	0.00%
自基金合同 生效起至今	31.78%	0.27%	8.35%	0.26%	23.43%	0.01%

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

东方红创新优选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



§ 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		
孔令超	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2018年6月1日	-	10年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2016年08月至今任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2016年08月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016年08月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2018年03月至今任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018年05月至今任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018年06月至今任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018年06月至今任东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2018年07月至今任东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理、2019年09月至今任东方红聚利债券型证券投资基金基金经理、2020年01月至2021年12月任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。北京大学金融学硕士。曾任平安证券有限责任公司总部综合研究所策略研究员，国信证券股

					份有限公司经济研究所策略研究研究员。具备证券投资基金从业资格。
陈觉平	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2018 年 6 月 26 日	-	10 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2018 年 06 月至今任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至今任 东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金基金经理、2020 年 03 月至今任东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 08 月至今任东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 08 月至 2021 年 12 月任 东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、2020 年 10 月至今任 东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2021 年 05 月至今任东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 01 月至今任东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 02 月至今任东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。复旦大学理学硕士。曾任上海新世纪资信评估服务有限公司债券评级部债券分析师，中国太平洋人寿保险股份有限公司资产管理中心信用研究员，上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益投资部研究员，上海东方证券资产管理有限公司信用研究员。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

债券方面，一季度 10 年期国债收益率期初、期末皆为 2.78%，但波动较大，全季振幅约 18bp。具体看，1 月起市场预期宽松加码，收益率下行，而后央行先后于 1 月 17 日调降 MLF 及公开市场操作利率各 10bp、1 月 20 日调降 5 年期 LPR 利率 5bp，降息预期落地。2 月以来公布的 1 月社融数据总量超预期，市场则围绕财政基建前置、宽货币向宽信用有效传导预期升温进行交易，收益率回调。进入 3 月，权益市场深度回调带来理财破净赎回压力，债市收益率普遍上行调整，但月中公布的 2 月社融数据存在超市场预期缺口，宽信用预期迅速降温，三个交易日内 10 年期国债收益率下行近 10bp。而后经济数据超预期带动收益率小幅回调，但经济动能弱化、地产销售未有明显起色、内需疲弱等因素被市场共识。3 月中下旬国内疫情，尤其是吉林、上海地区疫情超预期爆发，区域管控封闭措施加严、经济活动暂时性放缓，经济下行不确定性加大，包括国常会、央行例会等在内各部门会议表态总基调维稳，稳健偏宽的货币政策需加大力度服务实体经济，市场对于新一阶段的货币政策宽松预期升温，10 年期国债收益率自前高一路下行，回落至年初水平。我们也关注到一季度国内政策及货币环境仍“以我为主”，海外通胀及美联储加息预期升温等因素讨论关注虽多，但现阶段在国内收益率定价方面较为次要。

信用债方面，投资级信用债收益率在大方向变动上类似于利率债，但是节奏上存在利差调整的时滞，尤其是宽信用预期升温阶段以及理财破净赎回阶段，表征高等级信用债的 3 年期 AAA 品种信用利差出现较大幅度的走阔，历史分位数一度冲高至除疫情初期以及永煤事件中后期水平，但是随着货币环境的实质性宽松，3 年期 AAA 信用利差收敛速度较快，经过两周交易日便回落至历

史中枢水平上方 5bp 位置，后续压缩空间有限；

投机级信用债收益率继续分化，分行业看，地产板块年初以来政策宽松持续加码，多地出现供需两端多层次、立体式放松，旨在推动地产行业在合理区间内回暖，提振内需及经济动能，但是从市场表现来看，政策底与市场底仍存在相位差，从地产销售总量数据上看，一季度同比仍有较大幅度下降，基本面的企稳尚需时日；与此同时，一季度新增多家地产主体债券市场违约或展期，市场信心一度降至低点，市场关注点由房企偿债能力转向偿债意愿，地产债定价逻辑生变、二级交易价格持续下行，期间仅金稳会召开当日出现回暖，而后重回下跌调整状态。城投方面，一季度债券净融资仍为正，但也关注到少数高债务地区出现了债券融资净萎缩、融资结构恶化的趋势，中债 AA-及以下曲线则在流动性宽裕背景下利差持续走阔。

债券操作上，我们整体持仓以投资级品种为主，而对于投机级信用品种，则严格把控久期与集中度，力争获取稳定的票息收益。

展望后市，在宽货币向宽信用传导的路径中，流动性环境总体预计维持宽裕水平，产业类主体再融资环境友好，市场爆发超预期信用事件可能性相对较低，高等级信用品种信用利差有望向中枢回归。从收益率期限结构上看，5 年期信用利差持续处在历史高分位水平；从等级利差上看，流动性溢价回补过程中 AAA/AA+利差仍在较高水平，中债曲线 AA+等级主体参与性价比现阶段高于 AAA 品种。短久期、高票息策略虽然在低收益率环境下有一定防守意义，但过去半年以来，投资者风险厌恶提升致使优质票息资产迅速减少，策略选择空间降低，板块性配置难度加大。城投板块分化仍在加剧，在市场化、法制化、政企关系明确切分的背景下，我们对历史债务杠杆增速过快、区域债务率过高、区域财力和金融资源有限、财报质量下滑严重地区的平台保持谨慎态度。同时，对于主业专注、景气度尚可的产业主体可筛选配置，这些主体当前环境下兼具较高的信用安全性和利差收益。我们将充分发挥团队信用研究及信用债投资方面的优势，加强对持仓主体的基本面跟踪，在认真识别主体信用风险的基础之上优选标的、控制久期与集中度风险。

权益方面，2022 年一季度市场表现不佳，上证综指下跌 10.65%，创业板指下跌 19.96%。一季度的宏观环境基本符合预期，经济仍在筑底过程中，我们的宏观基准假设变化不大。但由于股票估值水平出现了一定程度的压缩，本产品一季度逐渐增配了股票资产，权益配置比例相比去年四季度有所提升。结构上，我们仍然继续维持对估值合理、业绩稳健增长的优质龙头公司的配置，同时仍然看好金融地产、建筑等传统行业的配置价值。在边际变化上，由于一些成长类行业的估值水平出现了较大幅度的压缩，也增加了一些估值调整到相对合理水平，同时基本面优质的公司的配置比例，如医药、传媒、电子、计算机等领域。

转债方面，一季度中证转债指数下跌 8.36%。一季度转债估值水平有所压缩，但相对股票来

说仍没有特别明显的优势。本产品目前持仓主要以一些偏债型品种为主，以及少量金融类转债。本产品仍然会密切关注转债市场的变化，如果转债估值水平出现更大程度的压缩，在合适机会下精选一些优质转债进行配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.9829 元，份额累计净值为 1.2929 元；本报告期间基金份额净值增长率为-2.56%，业绩比较基准收益率为-2.92%。

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

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	268,629,271.21	18.66
	其中：股票	268,629,271.21	18.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,145,937,064.15	79.60
	其中：债券	1,145,937,064.15	79.60
	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	18,144,633.77	1.26
8	其他资产	6,937,449.33	0.48
9	合计	1,439,648,418.46	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 95,628,946.54 元人民币，占期末基金资产净值比例 6.98%。

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	-	-
C	制造业	86,447,766.39	6.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,156,768.00	1.25
F	批发和零售业	710,132.02	0.05
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	14,580,254.34	1.06
J	金融业	35,961,802.00	2.62
K	房地产业	13,405,000.00	0.98
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	56,656.72	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	4,666,193.10	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,752.10	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	173,000,324.67	12.63

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	23,123,598.22	1.69
15 原材料	-	-
20 工业	3,205,111.52	0.23
25 可选消费	13,686,037.05	1.00
30 主要消费	3,811,747.00	0.28
35 医药卫生	-	-
40 金融	1,550,651.12	0.11
45 信息技术	4,522,191.76	0.33
50 通信服务	37,506,779.48	2.74
55 公用事业	8,222,830.39	0.60
60 房地产	-	-
合计	95,628,946.54	6.98

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	00941	中国移动	500,000	21,958,095.76	1.60

2	601668	中国建筑	2,622,200	14,264,768.00	1.04
3	601658	邮储银行	2,500,000	13,475,000.00	0.98
4	000002	万科 A	700,000	13,405,000.00	0.98
5	600887	伊利股份	350,000	12,911,500.00	0.94
6	601601	中国太保	430,000	9,855,600.00	0.72
6	02601	中国太保	100,000	1,550,651.12	0.11
7	00700	腾讯控股	35,000	10,621,797.97	0.78
8	00386	中国石油化工股份	3,200,000	10,199,261.76	0.74
9	002415	海康威视	240,000	9,840,000.00	0.72
10	002493	荣盛石化	600,000	8,580,000.00	0.63

注：对于同时在 A+H 股上市股票，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	5,914,826.30	0.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	479,685,563.30	35.01
	其中：政策性金融债	20,875,594.52	1.52
4	企业债券	478,700,131.01	34.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	25,259,518.36	1.84
7	可转债（可交换债）	56,407,238.47	4.12
8	同业存单	99,969,786.71	7.30
9	其他	-	-
10	合计	1,145,937,064.15	83.63

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	143563	18 张江 01	500,000	51,755,567.13	3.78
2	155415	19 中银 01	500,000	51,373,967.13	3.75
3	175174	20 招证 G4	500,000	50,981,958.91	3.72
4	163019	19 中金 04	500,000	50,795,336.99	3.71
5	136342	16 浦集 01	500,000	50,254,394.52	3.67

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，以期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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

本基金持有的腾讯控股（代码：00700）的发行主体腾讯控股有限公司因共计 28 起违法实施

经营者集中案件，于 2021 年 4 月 28 日、2021 年 7 月 6 日、2021 年 7 月 24 日、2021 年 11 月 13 日、2021 年 11 月 15 日、2021 年 11 月 16 日、2021 年 11 月 17 日、2021 年 11 月 18 日、2021 年 12 月 31 日被国家市场监管总局处以罚款，单起案件罚款 50 万元。

本基金持有的邮储银行（代码：601658）发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司因违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费等六项行为于 2021 年 6 月 22 日被中国银行保险监督管理委员会没收违法所得 11.401116 万元，罚款 437.677425 万元，罚没合计 449.078541 万元；因违反账户管理相关规定于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行警告，并处罚款 600 万元；因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等六项行为于 2021 年 11 月 9 日被国家外汇管理局北京外汇管理部给予警告，没收违法所得 673625.55 元人民币，并处 444 万元人民币罚款；因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在十三项违法违规行为，于 2022 年 3 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 370 万元。

本基金持有的 20 招证 G4（代码：175174 SH）的发行主体招商证券股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告于 2021 年 5 月 26 日被中国人民银行深圳市中心支行罚款 1,730,000 元。

本基金持有的 21 交通银行 CD109（代码：112106109 IB）的发行主体交通银行股份有限公司因理财业务和同业业务制度不健全等二十三项违规行为，于 2021 年 7 月 13 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 4100 万元；因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行处以罚款 62 万元；因未按规定办理内存外贷业务、未按规定办理服务贸易项下海运费支出业务等八项违规行为，于 2021 年 10 月 20 日被国家外汇管理局上海市分局给予警告，处罚款 340 万元人民币，没收违法所得 823166.01 元人民币；因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在十五项违法违规行为，于 2022 年 3 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 420 万元。

本基金持有的 21 中国银行 CD022（代码：112104022 IB）发行主体中国银行股份有限公司因向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款等三十六项行为，于 2021 年 5 月 17 日被中国银行保险监督管理委员会罚没 8761.355 万元；因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在十八项违法违规行为，于 2022 年 3 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 480 万元。

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	29,156.11
2	应收证券清算款	6,908,293.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,937,449.33

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	132015	18 中油 EB	16,359,563.45	1.19
2	132009	17 中油 EB	13,679,912.23	1.00
3	132022	20 广版 EB	5,293,682.19	0.39
4	113042	上银转债	2,297,073.77	0.17
5	110073	国投转债	1,386,320.71	0.10
6	110079	杭银转债	1,167,164.17	0.09
7	113050	南银转债	471,618.64	0.03

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

报告期期初基金份额总额	1,393,401,042.65
报告期期间基金总申购份额	711,228.37
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	1,394,112,271.02
-------------	------------------

§ 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

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

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创新优选三年定期开放混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红创新优选三年定期开放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。

上海东方证券资产管理有限公司

2022 年 4 月 22 日