

东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式
证券投资基金
2024 年第 1 季度报告

2024 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 04 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 东方红智逸沪港深定开混合 |
| 基金主代码 | 004278 |
| 基金运作方式 | 契约型、发起式、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 4 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,147,602,673.86 份 |
| 投资目标 | 本基金在追求基金资产长期安全的基础上，为基金份额持有人获取稳定的投资收益，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金以 36 个月为一个运作周期，以长期投资的理念进行大类资产的配置和个券选择，运用封闭期无流动性需求的优势，同时，充分考虑每个运作周期中期间开放期的安排，在股票的配置上，以时间换空间，采用低风险投资策略，为本基金获得更高的低风险收益；在债券配置上，合理配置久期匹配债券的结构，做好流动性管理，以期获得更高的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×60%+沪深 300 指数收益率×30%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%。 |
| 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公司股票。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

招商银行股份有限公司

§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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -22,673,279.30 |
| 2. 本期利润 | -49,036.88 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0000 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,470,132,096.74 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.2810 |

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。

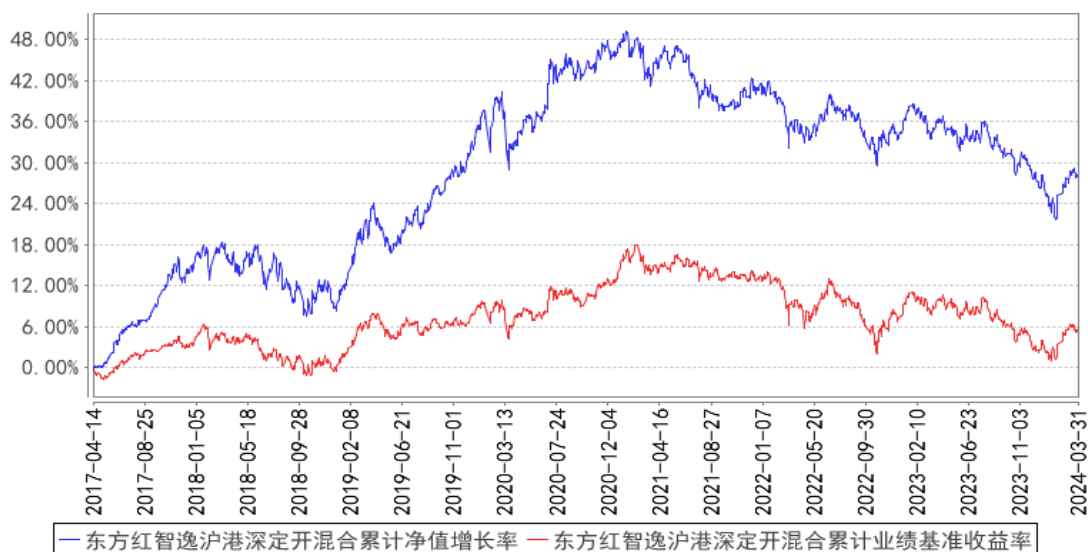
3.2 基金净值表现

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 | -0.01% | 0.50% | 1.54% | 0.42% | -1.55% | 0.08% |
| 过去六个月 | -2.40% | 0.44% | -0.64% | 0.38% | -1.76% | 0.06% |
| 过去一年 | -5.71% | 0.41% | -3.54% | 0.37% | -2.17% | 0.04% |
| 过去三年 | -10.99% | 0.42% | -7.61% | 0.40% | -3.38% | 0.02% |
| 过去五年 | 5.41% | 0.48% | -1.16% | 0.38% | 6.57% | 0.10% |
| 自基金合同 生效起至今 | 28.10% | 0.50% | 5.58% | 0.37% | 22.52% | 0.13% |

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

东方红智逸沪港深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 | | |
| 纪文静 | 上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募固定收益投资部总经理、基金经理 | 2017年4月28日 | - | 16年 | 上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募固定收益投资部总经理、基金经理，2015年07月至今任东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2015年07月至2023年04月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、2015年07月至2022年11月任东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理、2015年07月至2017年09月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、2015年10月至2021年12月任东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金（原东方红纯债债券型发起式证券投资基金）基金经理、2015年11月至2024年03月任东方红收益增强债券型证券投资基金基金经理、2015年11月至今任东方红信用债债券型证券投资基金基金经理、2016年05月至今任东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、2016年05月至2017年08月任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2016 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>年 06 月至 2017 年 08 月任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金经理、2016 年 09 月至今任东方红价值精选混合型证券投资基金基金经理、2016 年 11 月至 2021 年 12 月任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、2017 年 04 月至今任东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至 2018 年 11 月任东方红货币市场基金基金经理、2023 年 03 月至今任东方红共赢甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2023 年 09 月至今任东方红 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。江苏大学经济学硕士。曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理,德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理。具备证券投资基金从业资格。</p> |
|--|--|--|--|--|

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

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可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共 1 次，为指数投资组合因跟踪指数需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

权益方面，一季度上证指数上涨 2.23%，沪深 300 上涨 3.10%，创业板指下跌 3.87%，中证 800 上涨 1.56%。石油石化、家电、银行、煤炭涨超 10%，而地产、电子、计算机及医药生物跌超 9%。1 月市场情绪较悲观，开年至 2 月初上证指数跌幅一度达到 9.17%。春节前后，随着市场流动性的改善、对两会政策环境的期待以及对经济数据边际修复的预期，市场自低点强势反弹，反弹幅度达 13%。展望二季度，市场或重新回归业绩，整体或有一定的波动。但我认为中长期来看，市场有望企稳回升、估值或有进一步修复的空间。一方面，二季度或可看到前期政策的逐步落地，如超长特别国债的发行、设备更新、消费品以旧换新等；另一方面，随着全球制造业周期见底，美国或逐步进入补库周期，出口或成为今年经济亮点，并进而带动出口产业链就业改善及投资的回升。虽然地产仍然短期对经济有所影响，但货币政策和财政政策的持续发力或能推动经济边际企稳的态势，并改善市场的预期。本产品操作上维持了股票资产的配置比例，结构上更关注处于周期底部、估值低位且业绩稳定的个股，积极关注受益于出口的行业以及“新质生产力”发展方向的行业。

转债方面，受权益市场悲观情绪及短期流动性压力的影响，开年至 2 月初中证转债指数下跌 5.1%，转债估值明显压缩。春节前后随着权益市场反弹，转债也跟随上涨，整体来看一季度中证转债指数下跌 0.81%。我认为当前配置转债的性价比仍然较高。一方面可以关注高 YTM 转债，其相对信用债的配置价值提升；另一方面高平价低溢价率的转债也有较好的性价比，后续随着权益市场震荡向上，这类标的或将体现较好的跟涨能力。本产品操作上增加了转债的配置比例，后续仍然会对市场保持密切跟踪，关注市场变化，适时精选一些优质转债进行配置。

债券方面，一季度收益率下行明显。一方面，虽然 1 月份降准落地、2 月 LPR 大幅下调 25BP，而调整 MLF 的预期一再落空，也不影响市场持续交易降息的预期；另一方面，3 月政府工作报告对于今年经济目标的设定符合市场预期，而超长特别国债等政策的落地时间、发行方式尚不确定，

市场做多情绪持续。全季度来看，10 年国债从 2.55% 下行至 2.29%，1 年国债则从 2.07% 下行至 1.72%。展望二季度，经济基本面在经历一季度较强的表现后，或需观察前期宏观政策的落地效果对经济的实际提振作用。短期内房地产市场出现 V 型反转的可能性仍然不大，内需或仍面临需求不足等问题，货币和财政政策持续发力的可能性仍然较大，债券市场仍有一定博弈空间。同时需关注在当前收益率低位的情况下，超长特别国债等供给的增加所带来的市场波动。此外美联储降息时点预期一再后移，短期对于央行降息操作也存在一定的约束，或导致当前情况下利率继续大幅下行的空间受阻。从债券品种上，我认为在信用利差较低的情况下，利率债优于信用债。因此本产品操作上将关注基本面和政策预期差带来的波段交易性机会。

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 1.2810 元，份额累计净值为 1.2810 元。本报告期基金份额净值增长率为-0.01%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%。

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 | 451,866,607.92 | 25.91 |
| | 其中：股票 | 451,866,607.92 | 25.91 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,254,361,061.94 | 71.93 |
| | 其中：债券 | 1,254,361,061.94 | 71.93 |
| | 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 | 37,681,383.34 | 2.16 |
| 8 | 其他资产 | 59,322.24 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 1,743,968,375.44 | 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 63,647,649.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 4.33%。

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 | 2,239,485.00 | 0.15 |
| B | 采矿业 | 8,055,098.00 | 0.55 |
| C | 制造业 | 262,703,584.14 | 17.87 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 6,428,871.00 | 0.44 |
| F | 批发和零售业 | 4,503,976.40 | 0.31 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 11,556.45 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 38,876,508.34 | 2.64 |
| J | 金融业 | 56,723,069.00 | 3.86 |
| K | 房地产业 | 8,645,197.00 | 0.59 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 15,750.21 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,863.38 | 0.00 |
| 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 | 388,218,958.92 | 26.41 |

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 | - | - |
| 15 原材料 | - | - |
| 20 工业 | - | - |
| 25 可选消费 | 18,109,373.00 | 1.23 |
| 30 主要消费 | 6,209,200.00 | 0.42 |
| 35 医药卫生 | 6,562,330.00 | 0.45 |
| 40 金融 | 8,255,256.00 | 0.56 |
| 45 信息技术 | - | - |
| 50 通信服务 | 24,511,490.00 | 1.67 |
| 55 公用事业 | - | - |
| 60 房地产 | - | - |

| | | |
|----|---------------|------|
| 合计 | 63,647,649.00 | 4.33 |
|----|---------------|------|

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 | 002475 | 立讯精密 | 1,000,150 | 29,414,411.50 | 2.00 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 89,000 | 24,511,490.00 | 1.67 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 128,480 | 24,431,756.80 | 1.66 |
| 4 | 688111 | 金山办公 | 69,041 | 20,090,931.00 | 1.37 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 11,500 | 19,583,350.00 | 1.33 |
| 6 | 601658 | 邮储银行 | 3,936,700 | 18,699,325.00 | 1.27 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 924,900 | 17,758,080.00 | 1.21 |
| 8 | 300604 | 长川科技 | 412,100 | 13,846,560.00 | 0.94 |
| 9 | 600276 | 恒瑞医药 | 268,300 | 12,333,751.00 | 0.84 |
| 10 | 002493 | 荣盛石化 | 1,096,700 | 12,074,667.00 | 0.82 |

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 | 45,070,098.36 | 3.07 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 397,739,722.83 | 27.05 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 438,354,327.13 | 29.82 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 111,865,022.95 | 7.61 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 261,331,890.67 | 17.78 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,254,361,061.94 | 85.32 |

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 | 185792 | 22 京投 02 | 800,000 | 81,945,166.02 | 5.57 |
| 2 | 149626 | 21 申证 12 | 600,000 | 61,016,235.62 | 4.15 |
| 3 | 188924 | 21 南网 04 | 600,000 | 60,964,819.73 | 4.15 |
| 4 | 092280065 | 22 工行二级资本 债 03A | 500,000 | 51,666,021.86 | 3.51 |
| 5 | 185821 | 22 光证 G1 | 500,000 | 51,219,821.92 | 3.48 |

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。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 | 59,322.24 |
| 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 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 59,322.24 |

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 | 110059 | 浦发转债 | 41,418,906.85 | 2.82 |
| 2 | 113052 | 兴业转债 | 39,347,071.60 | 2.68 |
| 3 | 113021 | 中信转债 | 33,000,034.03 | 2.24 |
| 4 | 113050 | 南银转债 | 18,758,627.73 | 1.28 |
| 5 | 110079 | 杭银转债 | 16,226,124.63 | 1.10 |
| 6 | 118031 | 天 23 转债 | 13,156,195.89 | 0.89 |
| 7 | 113043 | 财通转债 | 8,722,838.36 | 0.59 |
| 8 | 127076 | 中宠转 2 | 6,836,911.23 | 0.47 |
| 9 | 110073 | 国投转债 | 6,459,006.58 | 0.44 |
| 10 | 127089 | 晶澳转债 | 6,220,152.11 | 0.42 |
| 11 | 118042 | 奥维转债 | 4,997,067.10 | 0.34 |
| 12 | 113065 | 齐鲁转债 | 4,890,438.31 | 0.33 |
| 13 | 110083 | 苏租转债 | 3,552,314.49 | 0.24 |
| 14 | 118043 | 福立转债 | 2,677,635.42 | 0.18 |
| 15 | 127075 | 百川转 2 | 2,608,539.68 | 0.18 |
| 16 | 123194 | 百洋转债 | 2,390,145.79 | 0.16 |
| 17 | 128087 | 孚日转债 | 2,317,400.02 | 0.16 |
| 18 | 132018 | G 三峡 EB1 | 2,303,577.26 | 0.16 |
| 19 | 113636 | 甬金转债 | 2,144,022.47 | 0.15 |
| 20 | 123202 | 祥源转债 | 1,808,483.23 | 0.12 |
| 21 | 113055 | 成银转债 | 1,718,257.13 | 0.12 |
| 22 | 127049 | 希望转 2 | 1,684,866.26 | 0.11 |
| 23 | 110091 | 合力转债 | 1,638,078.30 | 0.11 |
| 24 | 123178 | 花园转债 | 1,589,827.40 | 0.11 |
| 25 | 123196 | 正元转 02 | 1,555,778.64 | 0.11 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 26 | 123222 | 博俊转债 | 1,398,703.52 | 0.10 |
| 27 | 123224 | 宇邦转债 | 1,341,188.92 | 0.09 |
| 28 | 110094 | 众和转债 | 1,155,724.18 | 0.08 |
| 29 | 113654 | 永 02 转债 | 1,070,704.11 | 0.07 |
| 30 | 123221 | 力诺转债 | 1,059,948.71 | 0.07 |
| 31 | 113066 | 平煤转债 | 1,001,870.49 | 0.07 |
| 32 | 123205 | 大叶转债 | 944,327.65 | 0.06 |
| 33 | 113615 | 金诚转债 | 871,848.51 | 0.06 |
| 34 | 110077 | 洪城转债 | 870,260.86 | 0.06 |
| 35 | 123184 | 天阳转债 | 821,195.72 | 0.06 |
| 36 | 123203 | 明电转 02 | 730,010.81 | 0.05 |
| 37 | 127063 | 贵轮转债 | 720,557.54 | 0.05 |
| 38 | 113666 | 爱玛转债 | 672,582.94 | 0.05 |
| 39 | 110092 | 三房转债 | 589,770.22 | 0.04 |
| 40 | 110095 | 双良转债 | 538,461.02 | 0.04 |
| 41 | 123197 | 光力转债 | 440,027.83 | 0.03 |
| 42 | 123220 | 易瑞转债 | 257,350.84 | 0.02 |
| 43 | 113044 | 大秦转债 | 234,819.92 | 0.02 |

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 | 1,147,602,673.86 |
| 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 | - |
| 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 | 1,147,602,673.86 |

§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

| | |
|--------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本 | 10,004,586.95 |
|--------------|---------------|

| | |
|------------------------------|---------------|
| 基金份额 | |
| 报告期期间买入/申购总份 额 | - |
| 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 | 10,004,586.95 |
| 报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例(%) | 0.87 |

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总 份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总 份额比例(%) | 发起份额承 诺持有期限 |
|-----------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------|----------------|
| 基金管理人固 有资金 | 10,004,586.95 | 0.87 | 10,004,586.95 | 0.87 | 3年 |
| 基金管理人高 级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人 员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股 东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,004,586.95 | 0.87 | 10,004,586.95 | 0.87 | 3年 |

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金的文件；

- 2、《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式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。

10.2 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。

10.3 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

2024 年 4 月 22 日