

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 年中期报告

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

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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 01 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后） .....	6
2.1 基金基本情况（转型前） .....	6
2.2 基金产品说明（转型后） .....	7
2.2 基金产品说明（转型前） .....	7
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	8
2.4 信息披露方式 .....	8
2.5 其他相关资料(转型后) .....	8
2.5 其他相关资料(转型前) .....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后) .....	9
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前) .....	10
3.2 基金净值表现（转型后） .....	11
3.2 基金净值表现（转型前） .....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	21
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	22
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	22
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	23
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	23
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>23</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	23
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	23
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	23
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....	<b>23</b>
6.1 资产负债表 .....	23
6.2 利润表 .....	25
6.3 净资产变动表 .....	26
6.4 报表附注 .....	27
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>55</b>
6.1 资产负债表 .....	55

6.2 利润表 .....	56
6.3 净资产变动表 .....	57
6.4 报表附注 .....	59
<b>§7 投资组合报告（转型后） .....</b>	<b>82</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	82
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	83
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	84
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	85
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	86
7.6 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 .....	86
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	86
7.8 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贵金属投资明细 .....	87
7.9 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 .....	87
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	87
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	87
7.12 投资组合报告附注 .....	87
<b>§7 投资组合报告（转型前） .....</b>	<b>88</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	88
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	89
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	90
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	91
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	92
7.6 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 .....	92
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	92
7.8 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贵金属投资明细 .....	92
7.9 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 .....	92
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	92
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	93
7.12 投资组合报告附注 .....	93
<b>§8 基金份额持有人信息（转型后） .....</b>	<b>94</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	94
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	94
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	95
<b>§8 基金份额持有人信息（转型前） .....</b>	<b>95</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	95
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	95
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	96
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	96
<b>§9 开放式基金份额变动（转型后） .....</b>	<b>96</b>
<b>§9 开放式基金份额变动（转型前） .....</b>	<b>97</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>97</b>

10.1 基金份额持有人大会决议 .....	97
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	98
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	98
10.4 基金投资策略的改变 .....	98
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	98
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	98
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后) .....	98
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前) .....	102
10.8 其他重大事件(转型后) .....	105
10.8 其他重大事件(转型前) .....	106
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>108</b>
11.1 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 .....	108
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	108
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>108</b>
12.1 备查文件目录 .....	108
12.2 存放地点 .....	109
12.3 查阅方式 .....	109

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份 额总额	10,001,145,133.59 份	
基金合同存续期	不定期	
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）

基金名称	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
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
报告期末基金份 额总额	10,163,056,863.77 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的 证券交易所	上海证券交易所

上市日期	2018 年 6 月 1 日	
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

## 2.2 基金产品说明（转型后）

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	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。
业绩比较基准	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%。
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。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

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。 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。

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周陶	郭明
	联系电话	021-53950806	010-66105799
	电子邮箱	service@dfham.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009200808	95588
传真		021-63326381	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		杨斌	廖林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

### 2.5 其他相关资料(转型后)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额: 中国证券登记结算有限责任公司	A 类份额: 北京市西城区太平桥大街 17 号
	C 类份额: 上海东方证券资产管理有限公司	C 类份额: 上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

### 2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额: 中国证券登记结算有限责任公司	A 类份额: 北京市西城区太平桥大街 17 号
	C 类份额: 上海东方证券资产管理有限公司	C 类份额: 上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）-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
本期已实现收益	-119,070,211.70	-301,385.16
本期利润	-162,027,816.38	-408,056.71
加权平均基金份 额本期利润	-0.0162	-0.0160
本期加权平均净 值利润率	-2.03%	-2.05%
本期基金份额净 值增长率	-2.00%	-2.03%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-3,973,778,503.10	-5,827,176.30
期末可供分配基 金份额利润	-0.3983	-0.2294
期末基金资产净 值	7,885,946,505.38	19,718,206.99
期末基金份额净 值	0.7905	0.7763
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	-2.00%	-2.03%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、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半年。

### 3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1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
本期已实现收益	-2,544,239,862.59	-6,656,616.71
本期利润	-566,638,000.33	-1,539,484.26
加权平均基金份 额本期利润	-0.0510	-0.0525
本期加权平均净 值利润率	-6.37%	-6.67%
本期基金份额净 值增长率	-5.40%	-5.60%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月12日)	
期末可供分配利 润	-3,917,928,243.62	-5,577,153.42
期末可供分配基 金份额利润	-0.3865	-0.2176
期末基金资产净 值	8,177,203,916.45	20,310,362.92
期末基金份额净 值	0.8066	0.7924
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024年6月12日)	
基金份额累计净 值增长率	13.60%	-36.35%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 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%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（Benchmarkt）按下列公式计算：

$$\text{Benchmark}_t = 60\% \times [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 20\% \times [\text{t 日恒生指数 (经汇率估值调整)} / (\text{t-1 日恒生指数 (经汇率估值调整)}) - 1] + 20\% \times [\text{t 日中国债券总指数} / (\text{t-1 日中国债券总指数}) - 1];$$

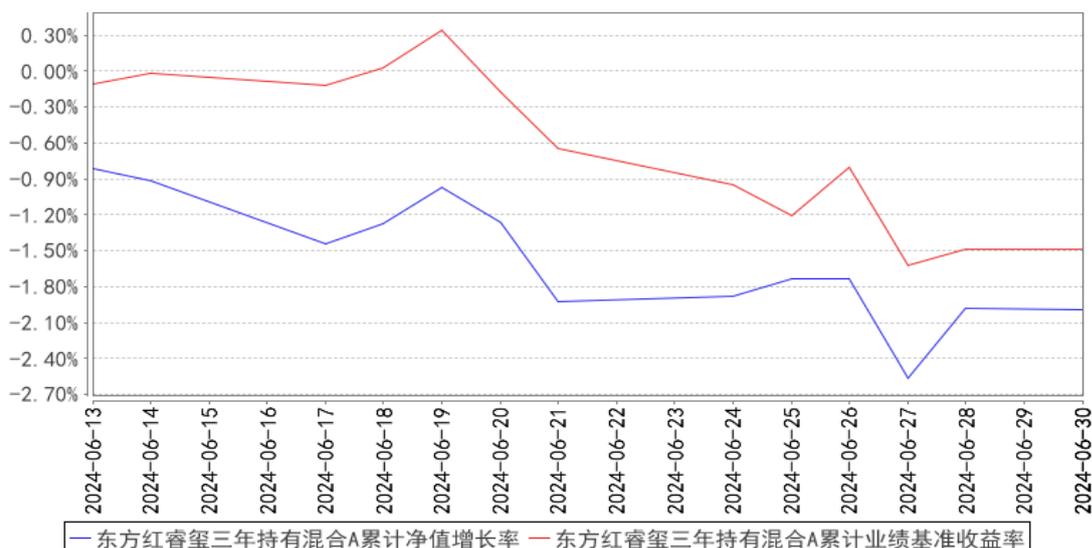
期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod (1 + \text{benchmark}_t)] - 1, \text{ 其中 } t=1, 2, 3, \dots, T, T \text{ 表示时间截至日};$$

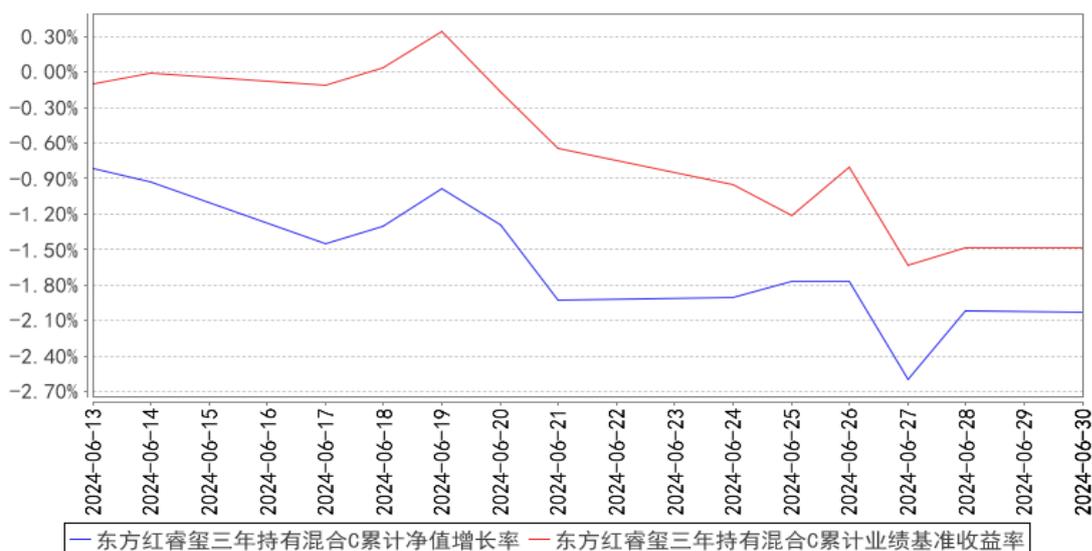
$\prod (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $(1 + \text{benchmark}_t)$  的数学连乘。

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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 2024-06-01 至 2024-06-12	-0.20%	0.63%	-0.71%	0.47%	0.51%	0.16%
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 2021-07-01 至 2024-06-12	-37.46%	1.31%	-26.07%	0.89%	-11.39 %	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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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 2024-06-01 至 2024-06-12	-0.20%	0.63%	-0.71%	0.47%	0.51%	0.16%
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	-36.35%	1.29%	-21.42%	0.89%	-14.93%	0.40%
2024-06-12						

注：本基金的业绩比较基准为沪深 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%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，t 日收益率（Benchmarkt）按下列公式计算：

$$\text{Benchmarkt} = 60\% * [\text{t 日沪深 300 指数} / (\text{t-1 日沪深 300 指数}) - 1] + 20\% * [\text{t 日恒生指数} / (\text{t-1 日恒生指数}) - 1] + 20\% * [\text{t 日中国债券总指数} / (\text{t-1 日中国债券总指数}) - 1];$$

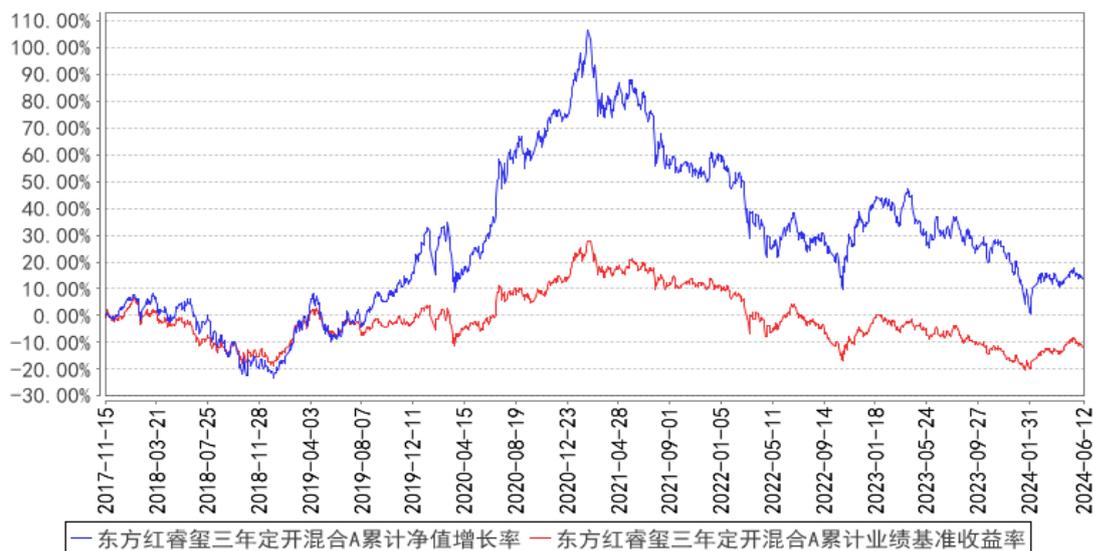
期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod (1 + \text{benchmarkt})] - 1, \text{ 其中 } t = 1, 2, 3, \dots, T, T \text{ 表示时间截至日};$$

$\prod (1 + \text{benchmarkt})$  表示  $(1 + \text{benchmarkt})$  的数学连乘。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿逸定

期开放混合型发起式证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红 6 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红启元三年持有期混合型证券投资基金、东方红聚利债券型证券投资基金、东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金、东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红恒阳五年定期开放混合型证券投资基金、东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红启东三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和稳健养老目标两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和积极养老目标五年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红益丰纯债债券型证券投资基金、东方红智远三年持有期混合型证券投资基金、东方红颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红明鉴优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金、东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红启航三年持有期混合型证券投资基金、东方红多元策略混合型证券投资基金、东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金、东方红远见价值混合型证券投资基金、东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金、东方红欣和平衡配置两年持有期混合型基金中基金（FOF）、东方红启阳三年持有期混合型证券投资基金、东方红创新趋势混合型证券投资基金、东方红启华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金、东方红启盛三年持有期混合型证券投资基金、东方红启程三年持有期混合型证券投资基金、东方红新海混合型证券投资基金、东方红新源三年持有期混合型证券投资基金、东方红内需增长混合型证券投资基金、东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红智华三年持有期混合型证券投资基金、东方红启兴三年持有期混合型证券投资基金、东方红智选三年持有期混合型证券投资基金、东方红睿和三年定期开放混合型证券投资基金、东方红中证东方红红利低波动指数证券投资基金、东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金、

东方红 ESG 可持续投资混合型证券投资基金、东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红医疗升级股票型发起式证券投资基金、东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红短债债券型证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、东方红中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、东方红锦惠甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金、东方红共赢甄选一年持有期混合型证券投资基金、东方红先进制造混合型证券投资基金、东方红颐安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、东方红 30 天滚动持有纯债债券型证券投资基金、东方红欣和积极配置 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、东方红 6 个月持有期债券型证券投资基金、东方红中证东方红优势成长指数发起式证券投资基金、东方红远见领航混合型发起式证券投资基金、东方红 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、东方红季鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红 90 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、东方红 60 天持有期纯债债券型证券投资基金、东方红慧鑫甄选 6 个月持有期混合型证券投资基金、东方红汇享债券型证券投资基金、东方红智享三年持有期混合型证券投资基金、东方红量化选股混合型发起式证券投资基金，共计 105 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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。

#### 4.1.3 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04月21日
	私募资产管理计划	5	662,482,966.50	2017年12月08日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	21,875,308,249.56	-

#### 4.1.3 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04月21日
	私募资产管理计划	5	710,170,992.49	2017年12月08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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

目前，全球经济政治以及消费者和企业的行为正发生深刻变化，趋势越来越明朗。在全球，供应链分散化、贸易壁垒上升、经济问题政治化等等倾向扩散到许多国家。在国内，新质生产力在加快提升其在 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。当然在经济结构大转变的这个阶段，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。

本基金的投资组合在上半年变化不大，仓位稳定，偏向于供给端具有壁垒，经营受宏观经济影响小，产品差异化明显，杠杆较低、分红能力强的股票。

#### 4.4.2 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 2024.01.01-2024.06.12），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-5.40%，同期业绩比较基准收益率为 3.57%；C 类份额净值增长率为-5.60%，同期业绩比较基准收益率为 3.57%。

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%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年, 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是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力。展望下半年, 美国经济面临越来越大的下行压力。目前看内外环境都暂无剧烈变化的线索, 在内外都存在需求下滑可能的情况下, 供需平衡是寻找投资机会的重要考量维度。

2024 年上半年, 上证指数跌 0.25%, 深证成指跌 7.10%, 创业板指跌 10.99%, 恒生指数涨 3.94%。市场经历了两轮较大的波动, 除了资金端的重新平衡之外, 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 5 月底开始, 由于宏观数据有所走弱, 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, 出口链总体震荡下行。央国企表现好于民企股。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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算操作实务手册》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定, 对基金所持有的投资品种进行估值, 本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后, 经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性, 对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一种投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致(中国证监会规定的特殊品种除外)。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值, 本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系, 估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构。本基金管理人估值委员和估值人员均具有专业胜任

能力和相关工作经历。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——上海东方证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对上海东方证券资产管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	1,407,148,368.43
结算备付金		501,919,576.69
存出保证金		1,138,121.43
交易性金融资产	6.4.7.2	6,068,149,604.69
其中：股票投资		6,061,094,515.76

基金投资		-
债券投资		7,055,088.93
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	954,169,000.00
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		10,168,413.21
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		8,942,693,084.45
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		1,012,564,364.13
应付赎回款		5,722,627.76
应付管理人报酬		7,988,660.14
应付托管费		1,331,443.36
应付销售服务费		8,245.88
应付投资顾问费		-
应交税费		6.09
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	9,413,024.72
负债合计		1,037,028,372.08
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	10,001,145,133.59
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-2,095,480,421.22
净资产合计		7,905,664,712.37
负债和净资产总计		8,942,693,084.45

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 10,001,145,133.59 份，其中东方红睿玺三年持有混合 A 基金份额总额 9,975,746,028.02 份，基金份额净值 0.7905 元；东方红睿玺三年持有混合 C 基金份额总额 25,399,105.57 份，基金份额净值 0.7763 元。 2、本财务报表的实际编制期间为 2024 年 06 月 13 日(基金合同生效日)至 2024 年 06 月 30 日止期间，无上年度可比数据。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-156,914,126.09
1. 利息收入		700,265.41
其中：存款利息收入	6.4.7.13	661,674.78
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		38,590.63
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-114,662,141.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-164,970,407.29
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-98.28
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	50,308,364.06
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-43,064,276.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	112,026.24
<b>减：二、营业总支出</b>		5,521,747.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,715,833.60
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	785,972.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,885.50
4. 投资顾问费		-

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-
7. 税金及附加		0. 65
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	15, 054. 98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-162, 435, 873. 09</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-162, 435, 873. 09</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-162, 435, 873. 09</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	10, 163, 056, 863. 77	-1, 965, 542, 584. 40	8, 197, 514, 279. 37
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-161, 911, 730. 18	-129, 937, 836. 82	-291, 849, 567. 00
（一）、综合收益总额	-	-162, 435, 873. 09	-162, 435, 873. 09
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-161, 911, 730. 18	32, 498, 036. 27	-129, 413, 693. 91
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-161, 911, 730. 18	32, 498, 036. 27	-129, 413, 693. 91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	10, 001, 145, 133. 59	-2, 095, 480, 421. 22	7, 905, 664, 712. 37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张锋</u>	<u>汤琳</u>	<u>陈培</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由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而来。根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]181号《关于准予东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》和基金管理人《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》、《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为东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金的提示性公告》以及《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 A 类基金份额终止上市的公告》，本基金自 2024 年 6 月 13 日起转型为“东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金”，本基金 A 类基金份额于 2024 年 6 月 18 日终止上市。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]81号核准，本基金 210,714,557.00 份基金份额于 2018 年 6 月 1 日在上交所挂牌交易。根据 2020 年 10 月 28 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增加基金份额类别并调整基金收益分配方式的公告》、2020 年 11 月 2 日披露的《东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回和转换业务的公告》以及原《东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定，自 2020 年 11 月 16 日起，本基金根据申购费用、销售服务费收取方式及登记机构的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。A 类基金份额在投资人申购基金时收取申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，而不计提销售服务费，本基金 A 类基金份额的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。C 类基金份额在投资人申购基金时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，本基金 C 类基金份额的登记机构为上海东方证券资产管理有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、

中央银行票据、企业债、公司债(含证券公司发行的短期公司债)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资比例为:本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例为基金资产的 60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%)。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+恒生指数收益率(经汇率估值调整) $\times$ 20%+中国债券总指数收益率 $\times$ 20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算操作实务手册》、《东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 6 月 13 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2024 年 6 月 13 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项

等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报

酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，

并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

2、本基金的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取销售服务费情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营

成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人

投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,407,148,368.43
等于：本金	1,407,008,927.58
加：应计利息	139,440.85
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,407,148,368.43

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	6,304,931,648.29	-	6,061,094,515.76	-243,837,132.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券   交易所市	6,984,337.38	15,821.73	7,055,088.93	54,929.82

	场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,984,337.38	15,821.73	7,055,088.93	54,929.82
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	6,311,915,985.67	15,821.73	6,068,149,604.69	-243,782,202.71

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	954,169,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	954,169,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,293,680.04
其中：交易所市场	9,293,680.04
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	119,344.68
合计	9,413,024.72

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 东方红睿玺三年持有混合 A

项目	本期 2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,137,424,255.48	10,137,424,255.48
2024 年 6 月 13 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2024 年 6 月 13 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2024 年 6 月 13 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2024 年 6 月 13 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-161,678,227.46	-161,678,227.46
本期末	9,975,746,028.02	9,975,746,028.02

##### 东方红睿玺三年持有混合 C

项目	本期 2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	25,632,608.29	25,632,608.29
2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-233,502.72	-233,502.72
本期末	25,399,105.57	25,399,105.57

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

#### 东方红睿玺三年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-3,917,928,243.62	1,957,707,904.59	-1,960,220,339.03
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,917,928,243.62	1,957,707,904.59	-1,960,220,339.03
本期利润	-119,070,211.70	-42,957,604.68	-162,027,816.38
本期基金份额交易产	63,219,952.22	-30,771,319.45	32,448,632.77

生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	63,219,952.22	-30,771,319.45	32,448,632.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,973,778,503.10	1,883,978,980.46	-2,089,799,522.64

东方红睿玺三年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-5,577,153.42	254,908.05	-5,322,245.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-5,577,153.42	254,908.05	-5,322,245.37
本期利润	-301,385.16	-106,671.55	-408,056.71
本期基金份额交易产生的变动数	51,362.28	-1,958.78	49,403.50
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	51,362.28	-1,958.78	49,403.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,827,176.30	146,277.72	-5,680,898.58

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
活期存款利息收入	258,887.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	401,443.21
其他	1,343.97
合计	661,674.78

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-164,970,407.29
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-164,970,407.29

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
卖出股票成交总额	711,597,730.51
减：卖出股票成本总额	874,641,231.14
减：交易费用	1,926,906.66
买卖股票差价收入	-164,970,407.29

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	181.80
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-280.08
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-98.28

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	280.08
买卖债券差价收入	-280.08

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	50,308,364.06
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	50,308,364.06

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-43,064,276.23
股票投资	-43,119,206.05
债券投资	54,929.82
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-43,064,276.23

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
基金赎回费收入	112,026.24
合计	112,026.24

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
审计费用	5,901.66
信息披露费	5,901.66
证券出借违约金	-
证券组合费	3,197.66
银行费用	54.00
合计	15,054.98

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
东方证券	1,206,548,309.94	82.63

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
东方证券	6,999,971.87	100.00

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东方证券	1,757,438,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
东方证券	898,841.16	81.58	1,193,501.09	12.84

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,117,898.68
应支付基金管理人的净管理费	2,597,934.92

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 6 月 13 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红睿玺三年持有 混合 A	东方红睿玺三年持有 混合 C	合计
东证资管	-	52.76	52.76
合计	-	52.76	52.76

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类的基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年6月13日（基金合同生效日）至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,407,148,368.43	258,887.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按协议利率计息，存出保证金不计息。于2024年06月30日，本基金存放于东证期货的结算备付金余额（不含应计利息）为7,838,466.80元，存出保证金余额为0元。于2024年06月13日（基金合同生效日）至2024年06月30日止期间，本基金存放于东证期货的结算备付金利息收入为5,739.10元。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：1、本基金本报告期内未进行利润分配。

2、本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项。

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日
AAA	-
AAA 以下	7,055,088.93
未评级	-
合计	7,055,088.93

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放日内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放日内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 06 月 30 日，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放日内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2024 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6 月30日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,407,148,368.43	-	-	-	-	-	1,407,148,368.43
结算备付金	501,919,576.69	-	-	-	-	-	501,919,576.69
存出保证金	1,138,121.43	-	-	-	-	-	1,138,121.43
交易性金融资产	-	-	-7,055,088.93	-6,061,094,515.76	-	-	6,068,149,604.69
买入返售金融资产	954,169,000.00	-	-	-	-	-	954,169,000.00
应收股利	-	-	-	-	-	10,168,413.21	10,168,413.21
资产总计	2,864,375,066.55	-	-7,055,088.93	-6,071,262,928.97	-	-	8,942,693,084.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,722,627.76	5,722,627.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,988,660.14	7,988,660.14
应付托管费	-	-	-	-	-	1,331,443.36	1,331,443.36
应付清算款	-	-	-	-	-	-1,012,564,364.13	1,012,564,364.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,245.88	8,245.88
应交税费	-	-	-	-	-	6.09	6.09
其他负债	-	-	-	-	-	9,413,024.72	9,413,024.72
负债总计	-	-	-	-	-	-1,037,028,372.08	1,037,028,372.08
利率敏感度缺口	2,864,375,066.55	-	-7,055,088.93	-5,034,234,556.89	-	-	7,905,664,712.37

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2024年6月30日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	52,400.99
	2. 市场利率上升 25 个基点	-51,883.78

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	968,436,177.93	-	968,436,177.93
资产合计	-	968,436,177.93	-	968,436,177.93
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	968,436,177.93	-	968,436,177.93

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 (2024 年 6 月 30 日)
	1、港币相对人民币升值 5%	48,421,808.90
	2、港币相对人民币贬值 5%	-48,421,808.90

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	6,061,094,515.76	76.67
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	6,061,094,515.76	76.67

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 (2024 年 6 月 30 日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	
2. 沪深 300 指数下降 5%		-209,670,886.62

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型 (CAPM) 对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数 (沪深 300) 价格发

生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日
第一层次	6,068,149,604.69
第二层次	-
第三层次	-
合计	6,068,149,604.69

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 12 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 12 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,516,887,148.63	1,560,813,836.74
结算备付金		118,239,573.91	115,636,254.62
存出保证金		1,522,584.09	125,550,564.06
交易性金融资产	6.4.7.2	6,230,281,363.82	8,579,684,363.99
其中：股票投资		6,230,281,363.82	8,579,684,363.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-2,243.63
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		388,216,056.24	19,901,317.58
应收股利		1,511,180.59	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		8,256,657,907.28	10,401,584,093.36
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 12 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		4,431,785.51	58,354.90
应付赎回款		42,590,702.55	67,083,737.86
应付管理人报酬		3,272,826.54	10,857,752.17
应付托管费		545,471.09	1,809,625.38
应付销售服务费		3,360.38	12,115.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	8,299,481.84	3,259,401.38
负债合计		59,143,627.91	83,080,987.35
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	10,163,056,863.77	12,103,203,786.98
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-1,965,542,584.40	-1,784,700,680.97
净资产合计		8,197,514,279.37	10,318,503,106.01
负债和净资产总计		8,256,657,907.28	10,401,584,093.36

注：报告截止日 2024 年 06 月 12 日，基金份额总额 10,163,056,863.77 份，其中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 类基金份额总额 10,137,424,255.48 份，基金份额净值 0.8066 元；东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额总额 25,632,608.29 份，基金份额净值 0.7924 元。

## 6.2 利润表

会计主体：东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 12 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 12 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-511,897,847.58	-234,017,107.00
1. 利息收入		2,830,081.01	867,839.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,816,340.75	764,778.96
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,740.26	103,060.22
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,497,620,713.70	-258,329,569.28
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,498,809,643.80	-415,941,184.15

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	253,123.64
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-54,213,621.71	-
股利收益	6.4.7.19	55,402,551.81	157,358,491.23
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损 失以“-”号填列)	6.4.7.20	1,982,718,994.71	23,444,623.10
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.21	173,790.40	-
<b>减：二、营业总支出</b>		56,279,637.01	124,510,743.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	47,975,107.95	106,417,653.90
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,995,851.34	17,736,275.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	51,729.30	94,944.04
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	2.50
8. 其他费用	6.4.7.23	256,948.42	261,867.34
<b>三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)</b>		-568,177,484.59	-358,527,850.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		-568,177,484.59	-358,527,850.41
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-568,177,484.59	-358,527,850.41

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 12 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 12 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	12,103,203,786.98	-1,784,700,680.97	10,318,503,106.01
二、本期期初净资产	12,103,203,786.98	-1,784,700,680.97	10,318,503,106.01
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,940,146,923.21	-180,841,903.43	-2,120,988,826.64
(一)、综合收益总额	-	-568,177,484.59	-568,177,484.59
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-1,940,146,923.21	387,335,581.16	-1,552,811,342.05
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-1,940,146,923.21	387,335,581.16	-1,552,811,342.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	10,163,056,863.77	-1,965,542,584.40	8,197,514,279.37
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	14,630,343,877.06	-694,446,490.61	13,935,897,386.45
二、本期期初净资产	14,630,343,877.06	-694,446,490.61	13,935,897,386.45
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-316,562.51	-358,519,414.01	-358,835,976.52
(一)、综合收益总额	-	-358,527,850.41	-358,527,850.41
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-316,562.51	8,436.40	-308,126.11
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-316,562.51	8,436.40	-308,126.11

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	14,630,027,314.55	-1,052,965,904.62	13,577,061,409.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张锋</u>	<u>汤琳</u>	<u>陈培</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1746号《关于准予东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,976,255,251.85元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第997号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2017年11月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,978,629,341.34份基金份额,其中认购资金利息折合2,374,089.49份基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《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》的相关规定,本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日,结束之日为基金合同生效日所对应的第三年年度对应日前的倒数第一个工作日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日,结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的第三年年度对应日前的倒数第一个工作日,依次类推。本基金自封闭期结束之后的第一个工作日起(即每个封闭期起始之日的第三年年度对应日的第一个工作日,包括该日)进入开放期,期间可以办理申购与赎回业务。本基金每个开放期原则上不少于5个工作日且最长不超过20个工作日。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]81号核准,本基金210,714,557.00份基金份额于2018年6月1日在上交所挂牌交易。对于托管在场外的基金份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至上交所场内即可上市流通。

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增加基金份额类别并调整基金收益分配方式的公告》、2020年11月2日披露的《东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回和转换业务的公告》以及更新的《东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定,自2020年11月16日起,本基金根据申购费用、销售服务费收取方式及登记机构的不同,将基金份额分为不同的类别。A类基金份额在投资人申购基金时收取申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费,而不计提销售服务费,本基金A类基金份额的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。C类基金份额在投资人申购基金时不收取申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费,本基金C类基金份额的登记机构为上海东方证券资产管理有限公司。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置基金代码,并且分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行的股票及存托凭证(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金的基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。开放期内,本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)投资比例为基金资产的0%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%);封闭期内,本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)投资比例为基金资产的0%-100%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%);开放期每个交易日日终,在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率x60%+恒生指数收益率x20%+中国债券总指数收益率x20%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算操作实务手册》、《# {基金名称} 基金合同》和其他中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 12 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 12 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政

策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月12日
活期存款	1,516,887,148.63
等于：本金	1,515,784,691.05
加：应计利息	1,102,457.58
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,516,887,148.63

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月12日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	6,430,999,290.30	-	6,230,281,363.82	-200,717,926.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,430,999,290.30	-	6,230,281,363.82	-200,717,926.48

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月12日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,191,940.48
其中：交易所市场	8,191,940.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	107,541.36
合计	8,299,481.84

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东方红睿玺三年定开混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月12日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,070,173,723.62	12,070,173,723.62

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-1,932,749,468.14	-1,932,749,468.14
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,137,424,255.48	10,137,424,255.48

东方红睿玺三年定开混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 12 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,030,063.36	33,030,063.36
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-7,397,455.07	-7,397,455.07
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	25,632,608.29	25,632,608.29

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

东方红睿玺三年定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,854,651,422.78	75,256,330.72	-1,779,395,092.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,854,651,422.78	75,256,330.72	-1,779,395,092.06
本期利润	-2,544,239,862.59	1,977,601,862.26	-566,638,000.33
本期基金份额交易产生的变动数	480,963,041.75	-95,150,288.39	385,812,753.36
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	480,963,041.75	-95,150,288.39	385,812,753.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,917,928,243.62	1,957,707,904.59	-1,960,220,339.03

东方红睿玺三年定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	432,717.18	-5,738,306.09	-5,305,588.91

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	432,717.18	-5,738,306.09	-5,305,588.91
本期利润	-6,656,616.71	5,117,132.45	-1,539,484.26
本期基金份额交易产生的变动数	646,746.11	876,081.69	1,522,827.80
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	646,746.11	876,081.69	1,522,827.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,577,153.42	254,908.05	-5,322,245.37

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月12日	
活期存款利息收入	1,940,143.18	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	868,226.28	
其他	7,971.29	
合计	2,816,340.75	

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月12日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,498,809,643.80	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	-2,498,809,643.80	

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月12日	
卖出股票成交总额	9,818,582,567.59	
减：卖出股票成本总额	12,296,545,468.36	
减：交易费用	20,846,743.03	
买卖股票差价收入	-2,498,809,643.80	

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

### 6.4.7.18 衍生工具收益

#### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月12日
股指期货投资收益	-54,213,621.71

### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月12日
股票投资产生的股利收益	55,402,551.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	55,402,551.81

### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月12日
1. 交易性金融资产	1,945,281,701.82
股票投资	1,945,281,701.82
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	37,437,292.89
权证投资	-
期货投资	37,437,292.89
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,982,718,994.71

### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月12日
基金赎回费收入	173,790.40
合计	173,790.40

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月12日
审计费用	53,770.68
信息披露费	53,770.68
证券出借违约金	-
证券组合费	38,649.80
银行费用	1,757.26
账户维护费	9,000.00
持有人大会费用	100,000.00
合计	256,948.42

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月12日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	1,376,648,870.76	7.73	4,578,131,434.46	33.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月12日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	1,327,510.64	96.09

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月12日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
东方证券	12,000,000.00	12.27	-	-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度末未通过关联方交易单元进行权证交易

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月12日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	1,016,650.66	7.68	294,659.93	3.60
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	3,302,221.76	32.84	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 12 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	47,975,107.95	106,417,653.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	21,562,365.22	47,667,136.72
应支付基金管理人的净管理费	26,412,742.73	58,750,517.18

注：1、根据《上海东方证券资产管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 7 月 10 日（含）的管理费率由 1.5%/年调整为 1.2%/年。

(1) 2023 年 1 月 1 日（含）至 2023 年 7 月 9 日（含），本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

(2) 自 2023 年 7 月 10 日（含），本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 12 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,995,851.34	17,736,275.63

注：根据《上海东方证券资产管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 7 月 10 日（含）的托管费率由 0.25%/年调整为 0.20%/年。

(1) 2023 年 1 月 1 日（含）至 2023 年 7 月 9 日（含），本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

(2) 自 2023 年 7 月 10 日（含），本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 12 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红睿玺三年定开 混合 A	东方红睿玺三年定开 混合 C	合计
东证资管	-	612.33	612.33
合计	-	612.33	612.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红睿玺三年定开 混合 A	东方红睿玺三年定开 混合 C	合计
东证资管	-	1,276.81	1,276.81
合计	-	1,276.81	1,276.81

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月12日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,516,887,148.63	1,940,143.18	634,655,147.14	653,874.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金支付给东证期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2024 年 06 月 12 日，本基金无应付交易手续费余额(2023 年 12 月 31 日：同)。于 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 12 日止期间，本基金当期交易手续费支出 22,748.82 元(2023 年同期：0 元)。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算

备付金按协议利率计息，存出保证金不计息。于 2024 年 06 月 12 日，本基金存放于东证期货的结算备付金余额（不含应计利息）为 7,614,357.14 元，存出保证金余额为 0 元。（2023 年 12 月 31 日：结算备付金 79,813,703.48 元，存出保证金余额为 124,262,156.20 元）。于 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 12 日止期间，本基金存放于东证期货的结算备付金利息收入为 513,325.84 元（2023 年同期：528.41 元）。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：1、本基金本报告期内未进行利润分配。

2、本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 12 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立风险控制委员会，负责指导、协调和监督各职能

部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 06 月 12 日，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2024 年 06 月 12 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 12 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,516,887,148.63	-	-	-	-	-	1,516,887,148.63
结算备付金	118,239,573.91	-	-	-	-	-	118,239,573.91
存出保证金	1,522,584.09	-	-	-	-	-	1,522,584.09
交易性金融资产	-	-	-	-	-	6,230,281,363.82	6,230,281,363.82
应收股利	-	-	-	-	-	1,511,180.59	1,511,180.59
应收清算款	-	-	-	-	-	388,216,056.24	388,216,056.24
资产总计	1,636,649,306.63	-	-	-	-	6,620,008,600.65	8,256,657,907.28

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	42,590,702.55	42,590,702.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,272,826.54	3,272,826.54
应付托管费	-	-	-	-	-	545,471.09	545,471.09
应付清算款	-	-	-	-	-	4,431,785.51	4,431,785.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,360.38	3,360.38
其他负债	-	-	-	-	-	8,299,481.84	8,299,481.84
负债总计	-	-	-	-	-	59,143,627.91	59,143,627.91
利率敏感度缺口	1,636,649,306.63	-	-	-	-	-6,560,864,972.74	8,197,514,279.37
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,560,813,836.74	-	-	-	-	-	1,560,813,836.74
结算备付金	115,636,254.62	-	-	-	-	-	115,636,254.62
存出保证金	1,288,407.86	-	-	-	-	124,262,156.20	125,550,564.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-8,579,684,363.99	8,579,684,363.99
买入返售金融资产	-2,243.63	-	-	-	-	-	-2,243.63
应收清算款	-	-	-	-	-	19,901,317.58	19,901,317.58
资产总计	1,677,736,255.59	-	-	-	-	-8,723,847,837.77	10,401,584,093.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	67,083,737.86	67,083,737.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,857,752.17	10,857,752.17
应付托管费	-	-	-	-	-	1,809,625.38	1,809,625.38
应付清算款	-	-	-	-	-	58,354.90	58,354.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,115.66	12,115.66
其他负债	-	-	-	-	-	3,259,401.38	3,259,401.38
负债总计	-	-	-	-	-	83,080,987.35	83,080,987.35
利率敏感度缺口	1,677,736,255.59	-	-	-	-	-8,640,766,850.42	10,318,503,106.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 06 月 12 日，本基金未持有交易性债券投资（2023 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月12日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	890,502,174.94	-	890,502,174.94
资产合计	-	890,502,174.94	-	890,502,174.94
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	890,502,174.94	-	890,502,174.94
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,192,971,547.06	-	1,192,971,547.06
资产合计	-	1,192,971,547.06	-	1,192,971,547.06
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,192,971,547.06	-	1,192,971,547.06

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月12日）	上年度末（2023年12月31日）
	1、港币相对人民币升值 5%	38,907,606.77	59,648,577.35
2、港币相对人民币贬值 5%	-38,907,606.77	-59,648,577.35	

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月12日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	6,230,281,363.82	76.00	8,579,684,363.99	83.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,230,281,363.82	76.00	8,579,684,363.99	83.15

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 12 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	223, 710, 401. 10	476, 419, 015. 25
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-223, 710, 401. 10	-476, 419, 015. 25

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6. 4. 14 公允价值

##### 6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6. 4. 14. 2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6. 4. 14. 2. 1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 12 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	6, 230, 281, 363. 82	8, 579, 684, 363. 99
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	6, 230, 281, 363. 82	8, 579, 684, 363. 99

###### 6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易

不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 12 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告（转型后）

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	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。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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
11	002223	鱼跃医疗	6,342,309	238,470,818.40	3.02
12	00257	光大环境	65,269,000	233,513,266.81	2.95
13	601118	海南橡胶	45,768,300	208,245,765.00	2.63
14	002410	广联达	15,100,758	144,665,261.64	1.83
15	000708	中信特钢	6,985,000	94,786,450.00	1.20
16	600282	南钢股份	14,394,600	71,685,108.00	0.91
17	002311	海大集团	1,297,082	61,027,708.10	0.77
18	600323	瀚蓝环境	2,629,800	54,962,820.00	0.70
19	601857	中国石油	3,831,500	39,541,080.00	0.50
20	600489	中金黄金	2,281,500	33,766,200.00	0.43
21	01787	山东黄金	900,000	12,764,742.48	0.16
21	600547	山东黄金	455,340	12,467,209.20	0.16
22	600845	宝信软件	778,420	24,854,950.60	0.31
23	03668	兖煤澳大利亚	680,800	21,219,189.38	0.27
24	600985	淮北矿业	1,261,900	21,124,206.00	0.27
25	01088	中国神华	415,000	13,616,501.09	0.17
25	601088	中国神华	96,100	4,263,957.00	0.05
26	002648	卫星化学	866,300	15,576,074.00	0.20
27	002568	百润股份	918,098	15,451,589.34	0.20
28	01171	兖矿能源	1,515,000	15,431,045.83	0.20
29	600809	山西汾酒	62,400	13,158,912.00	0.17
30	603605	珀莱雅	100,000	11,099,000.00	0.14
31	601225	陕西煤业	414,600	10,684,242.00	0.14
32	02020	安踏体育	150,000	10,267,650.00	0.13
33	002372	伟星新材	665,100	10,255,842.00	0.13
34	000933	神火股份	500,000	10,115,000.00	0.13
35	002078	太阳纸业	703,600	9,815,220.00	0.12
36	000338	潍柴动力	585,300	9,505,272.00	0.12
37	601001	晋控煤业	493,800	8,157,576.00	0.10

38	600285	羚锐制药	328,200	7,945,722.00	0.10
39	600737	中粮糖业	800,000	7,672,000.00	0.10
40	000807	云铝股份	519,700	7,021,147.00	0.09
41	00586	海螺创业	670,500	4,455,010.12	0.06
42	600989	宝丰能源	248,600	4,308,238.00	0.05
43	601611	中国核建	450,000	3,640,500.00	0.05

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。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	02057	中通快递-W	101,139,694.15	1.28
2	000028	国药一致	79,741,640.76	1.01
3	00883	中国海洋石油	77,419,025.10	0.98
4	000999	华润三九	74,198,776.14	0.94
5	600282	南钢股份	71,925,157.69	0.91
6	600660	福耀玻璃	68,280,700.91	0.86
7	00257	光大环境	66,467,641.34	0.84
8	601857	中国石油	41,897,221.00	0.53
9	000708	中信特钢	39,992,740.77	0.51
10	600030	中信证券	27,393,180.00	0.35
11	300750	宁德时代	19,740,568.00	0.25
12	601118	海南橡胶	15,881,728.82	0.20
13	601899	紫金矿业	12,094,685.00	0.15
14	600011	华能国际	11,689,488.00	0.15
15	603605	珀莱雅	11,359,509.10	0.14
16	600019	宝钢股份	9,914,842.80	0.13
17	000338	潍柴动力	9,499,494.00	0.12
18	00586	海螺创业	4,601,491.47	0.06
19	601611	中国核建	3,750,447.00	0.05
20	01171	兖矿能源	1,585,557.08	0.02

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	162,860,902.78	2.06
2	002568	百润股份	140,661,636.68	1.78
3	600426	华鲁恒升	137,465,428.72	1.74
4	002311	海大集团	68,121,103.22	0.86

5	002841	视源股份	64,285,735.04	0.81
6	600030	中信证券	27,475,491.96	0.35
7	601899	紫金矿业	26,142,215.00	0.33
8	002180	纳思达	17,058,143.00	0.22
9	600900	长江电力	15,820,390.00	0.20
10	600011	华能国际	11,766,466.00	0.15
11	09992	泡泡玛特	10,282,234.11	0.13
12	000933	神火股份	10,103,597.00	0.13
13	002223	鱼跃医疗	7,909,810.00	0.10
14	300957	贝泰妮	6,504,626.00	0.08
15	601857	中国石油	4,784,451.00	0.06
16	002372	伟星新材	355,500.00	0.00

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	748,573,589.13
卖出股票收入（成交）总额	711,597,730.51

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110081	闻泰转债	71,190	7,055,088.93	0.09

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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。

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。

#### 7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,138,121.43
2	应收清算款	-
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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,306,534.64

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110081	闻泰转债	7,055,088.93	0.09

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

## § 7 投资组合报告（转型前）

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	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。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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
11	600660	福耀玻璃	4,405,046	206,860,960.16	2.52
12	02057	中通快递-W	1,145,350	184,541,413.71	2.25
13	002568	百润股份	8,372,298	168,450,635.76	2.05
14	002410	广联达	15,100,758	167,618,413.80	2.04
15	00700	腾讯控股	466,100	157,415,183.00	1.92
16	00257	光大环境	46,439,000	153,961,464.35	1.88
17	002311	海大集团	2,745,682	134,016,738.42	1.63
18	002841	视源股份	2,123,823	65,201,366.10	0.80
19	000708	中信特钢	4,174,700	61,368,090.00	0.75
20	600323	瀚蓝环境	2,629,800	54,121,284.00	0.66
21	600489	中金黄金	2,281,500	33,218,640.00	0.41
22	600845	宝信软件	778,420	26,466,280.00	0.32
23	01787	山东黄金	900,000	13,492,739.34	0.16
23	600547	山东黄金	455,340	12,804,160.80	0.16
24	600985	淮北矿业	1,261,900	23,698,482.00	0.29
25	000933	神火股份	1,000,000	23,090,000.00	0.28
26	03668	兖煤澳大利亚	680,800	20,152,582.06	0.25
27	01088	中国神华	415,000	14,968,251.54	0.18
27	601088	中国神华	96,100	4,290,865.00	0.05
28	01171	兖矿能源	1,050,000	17,577,722.19	0.21
29	002180	纳思达	624,300	16,462,791.00	0.20
30	002648	卫星化学	866,300	15,835,964.00	0.19
31	600809	山西汾酒	62,400	14,460,576.00	0.18
32	601225	陕西煤业	414,600	11,530,026.00	0.14
33	002372	伟星新材	687,900	11,254,044.00	0.14
34	02020	安踏体育	150,000	11,223,456.23	0.14
35	09992	泡泡玛特	300,000	10,478,869.05	0.13
36	002078	太阳纸业	703,600	10,399,208.00	0.13
37	601001	晋控煤业	493,800	9,648,852.00	0.12

38	600285	羚锐制药	328,200	8,221,410.00	0.10
39	600737	中粮糖业	800,000	8,152,000.00	0.10
40	000807	云铝股份	519,700	7,769,515.00	0.09
41	300957	贝泰妮	131,300	6,895,876.00	0.08
42	600989	宝丰能源	248,600	4,049,694.00	0.05

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。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	749,870,755.93	7.27
2	600900	长江电力	726,129,595.55	7.04
3	600019	宝钢股份	534,200,834.51	5.18
4	000333	美的集团	481,818,093.90	4.67
5	300750	宁德时代	452,286,224.03	4.38
6	002475	立讯精密	355,699,666.13	3.45
7	000568	泸州老窖	326,968,386.56	3.17
8	603993	洛阳钼业	311,853,191.60	3.02
9	000999	华润三九	297,213,331.67	2.88
10	00883	中国海洋石油	287,433,789.35	2.79
10	600938	中国海油	9,026,273.00	0.09
11	000932	华菱钢铁	286,223,008.18	2.77
12	000858	五粮液	274,084,099.20	2.66
13	000028	国药一致	239,009,673.83	2.32
14	601118	海南橡胶	213,379,649.00	2.07
15	600660	福耀玻璃	207,475,821.83	2.01
16	02057	中通快递-W	196,774,044.07	1.91
17	002311	海大集团	163,303,517.57	1.58
18	00257	光大环境	150,361,926.08	1.46
19	600426	华鲁恒升	139,935,022.86	1.36
20	002517	恺英网络	137,189,241.63	1.33

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	643,813,481.37	6.24
2	300033	同花顺	536,876,378.24	5.20
3	000333	美的集团	507,032,083.44	4.91
4	000858	五粮液	476,393,019.95	4.62

5	00700	腾讯控股	466,868,830.94	4.52
6	002555	三七互娱	412,289,433.27	4.00
7	300122	智飞生物	409,481,990.54	3.97
8	002475	立讯精密	347,678,396.90	3.37
9	600426	华鲁恒升	346,529,779.10	3.36
10	000568	泸州老窖	331,345,755.01	3.21
11	02020	安踏体育	321,365,092.25	3.11
12	601058	赛轮轮胎	303,480,624.19	2.94
13	002352	顺丰控股	285,559,539.24	2.77
14	603993	洛阳钼业	282,503,154.28	2.74
15	600346	恒力石化	267,534,601.35	2.59
16	688002	睿创微纳	258,199,328.13	2.50
17	000932	华菱钢铁	254,124,705.55	2.46
18	002027	分众传媒	251,516,054.72	2.44
19	03690	美团-W	248,853,241.52	2.41
20	300036	超图软件	205,941,506.78	2.00

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,001,860,766.37
卖出股票收入（成交）总额	9,818,582,567.59

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,522,584.09
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	391,249,820.92

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息（转型后）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
东方红睿玺三年持有混合 A	271,364	36,761.49	158,487,550.20	1.59	9,817,258,477.82	98.41
东方红睿玺三年持有混合 C	1,007	25,222.55	0.00	0.00	25,399,105.57	100.00
合计	272,371	36,718.83	158,487,550.20	1.58	9,842,657,583.39	98.42

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方红睿玺三年持有混合 A	2,775,620.97	0.03
	东方红睿玺三年持有混合 C	8.03	0.00
	合计	2,775,629.00	0.03

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方红睿玺三年持有混合 A	50~100
	东方红睿玺三年持有混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红睿玺三年持有混合 A	0~10
	东方红睿玺三年持有混合 C	0
	合计	0~10

## § 8 基金份额持有人信息（转型前）

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
东方红睿玺三年定开混合 A	283,781	35,722.70	27,432,392.20	0.27	10,109,991,863.28	99.73
东方红睿玺三年定开混合 C	1,029	24,910.21	0.00	0.00	25,632,608.29	100.00
合计	284,810	35,683.64	27,432,392.20	0.27	10,135,624,471.57	99.73

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

东方红睿玺三年定开混合 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	李翎	3,150,597.00	2.28
2	邱文奎	2,002,000.00	1.45
3	李惠丽	1,899,850.00	1.37
4	彭治	1,789,643.00	1.29
5	单秋霞	1,582,811.00	1.14
6	温璐	1,500,000.00	1.08

7	叶利平	1,441,707.00	1.04
8	杨凯	1,366,627.00	0.99
9	孔传赞	1,206,485.00	0.87
10	谢可钧	1,187,109.00	0.86

注：上述持有人为本基金本报告期末场内份额持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方红睿玺三年定开混合 A	2,944,866.08	0.03
	东方红睿玺三年定开混合 C	8.03	0.00
	合计	2,944,874.11	0.03

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	东方红睿玺三年定开混合 A	50~100
	东方红睿玺三年定开混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红睿玺三年定开混合 A	0~10
	东方红睿玺三年定开混合 C	0
	合计	0~10

## § 9 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	161,678,227.46	233,502.72

总赎回份额		
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 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。

### § 9 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
基金合同生效日 (2017 年 11 月 15 日) 基金份额总额	1,978,629,341.34	-
本报告期期初基金份 额总额	12,070,173,723.62	33,030,063.36
本报告期基金总申购 份额	-	-
减：本报告期基金总 赎回份额	1,932,749,468.14	7,397,455.07
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	10,137,424,255.48	25,632,608.29

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，自 2024 年 3 月 7 日起至 2024 年 5 月 13 日 17:00 时止进行了投票表决。会议表决通过了《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》），同意对本基金实施转型，将本基金由三年定期开放变更为设置三年锁定持有期，终止 A 类基金份额的上市交易，

并调整投资范围、投资比例、投资策略和投资限制等，并对基金合同进行修改和补充。《议案》于 2024 年 5 月 14 日表决通过，决议自该日起生效。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

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，转型后本基金的投资策略包括：资产配置、股票组合的构建、存托凭证的投资策略、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、融资投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内本基金未发生改聘会计师事务所的情形。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	6	1,206,548,30	82.63	898,841.16	81.58	-

		9.94				
兴业证券	2	253,623,009.70	17.37	202,898.40	18.42	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国 证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的合规风控能力、交易能力和研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

2、本基金合同生效日为 2024 年 06 月 13 日，报告期内本基金转型后交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东方证券	6,999,971.87	100.00	1,757,438,000.00	100.00	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

安						
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	2,110,472,536.94	11.84	1,553,070.51	11.73	-
浙商证券	2	1,989,964,303.08	11.17	1,464,865.42	11.06	-
广发证券	2	1,716,832,424.46	9.63	1,265,438.71	9.55	-
华西证券	1	1,544,897,253.65	8.67	1,172,367.33	8.85	-
东方证券	6	1,376,648,870.76	7.73	1,016,650.66	7.68	-
国海证券	2	1,311,156,737.64	7.36	964,865.22	7.28	-
信达证券	1	1,243,486,776.11	6.98	915,088.22	6.91	-
中信证券	2	1,081,945,500.20	6.07	796,198.88	6.01	-
海通证券	2	958,546,309.47	5.38	705,398.36	5.33	-
东吴证券	2	899,606,264.81	5.05	662,022.36	5.00	-
民生证券	1	786,815,538.44	4.42	579,021.62	4.37	-
国盛证券	1	704,495,308.40	3.95	518,438.83	3.91	-
兴业证券	2	649,520,612.90	3.64	512,405.95	3.87	-
中泰证券	2	448,930,284.53	2.52	330,370.06	2.49	-
野村东方国际证券	1	427,097,042.02	2.40	341,677.63	2.58	-
开源证券	2	388,945,840.11	2.18	311,156.66	2.35	-

申万宏源	1	61,860,524.04	0.35	45,523.48	0.34	-
瑞银证券	2	52,663,516.28	0.30	38,755.84	0.29	-
上海证券	2	35,278,101.36	0.20	28,222.48	0.21	-
国投证券	1	31,279,588.76	0.18	23,018.81	0.17	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国 证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的合规风控能力、交易能力和研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

2、本基金本报告期租用券商交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	36,382,000.00	37.21	-	-
东方证券	-	-	12,000,000.00	12.27	-	-
国海证券	-	-	26,380,000.00	26.98	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	23,000,000.00	23.53	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国投证	-	-	-	-	-	-

券						
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
高盛中 国证券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2024年6月13日
2	东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2024年6月13日

3	东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 13 日
4	上海东方证券资产管理有限公司东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金场内基金份额“确权”登记指引	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 13 日
5	上海东方证券资产管理有限公司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 A 类基金份额终止上市的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 13 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 27 日

### 10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 5 日
2	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）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 18 日
3	东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 18 日
4	东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 18 日
5	东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
6	关于拟召开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（通讯方式）的预公告	中国证监会规定媒介	2024 年 2 月 20 日
7	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在直销平台调整赎回数额限制的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 2 月 28 日
8	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停牌提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 7 日
9	关于召开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（通讯方式）的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 7 日
10	关于召开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	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 8 日

	持有人大会（通讯方式）的第一次提示性公告		
11	关于召开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（通讯方式）的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 11 日
12	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非港股通交易日暂停赎回（含转换转出）业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 26 日
13	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 26 日
14	东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
15	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 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
16	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暂停赎回（含转换转出）业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 14 日
17	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停牌的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 14 日
18	东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 15 日
19	东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 15 日
20	东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 15 日
21	东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 15 日
22	上海东方证券资产管理有限公司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	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 15 日
23	东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 15 日
24	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经理变更的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 1 日
25	东方红睿玺三年定期开放灵活配置混	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 4 日

	合型证券投资基金（待转型）（A 类份额）基金产品资料概要更新		
26	东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金（待转型）招募说明书（更新）（2024 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 4 日
27	东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金（待转型）（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 4 日
28	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为东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 12 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

## 12.2 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。

## 12.3 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 8 月 30 日