

东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

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

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 东方红睿玺三年持有混合 |
| 基金主代码 | 501049 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 本基金每份基金份额设置 3 年锁定持有期（红利再投资所得份额除外） |
| 基金合同生效日 | 2024 年 6 月 13 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 9,536,668,331.96 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 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 |

| | | |
|-----------------|---|------------------------|
| | <p>而上”的个股投资策略，利用基金管理人投研团队的资源，对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出价格低估、质地优秀、未来预期成长性良好，符合转型期中国经济发展趋势的上市公司股票（含存托凭证）进行投资。3、此外，本基金还会运用港股通标的股票投资策略、存托凭证投资策略、可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券的投资策略、其他固定收益类证券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略以及融资投资策略等。</p> | |
| 业绩比较基准 | <p>沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×20%+中国债券总指数收益率×20%。</p> | |
| 风险收益特征 | <p>本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> | |
| 基金管理人 | <p>上海东方证券资产管理有限公司</p> | |
| 基金托管人 | <p>中国工商银行股份有限公司</p> | |
| 下属分级基金的基金简称 | <p>东方红睿玺三年持有混合 A</p> | <p>东方红睿玺三年持有混合 C</p> |
| 下属分级基金的交易代码 | <p>501049</p> | <p>010506</p> |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | <p>9,511,878,127.87 份</p> | <p>24,790,204.09 份</p> |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| | | |
|--------|-------------------------------------|---------------|
| 主要财务指标 | 报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） | |
| | 东方红睿玺三年持有混合 A | 东方红睿玺三年持有混合 C |

| | | |
|-----------------|------------------|---------------|
| 1. 本期已实现收益 | -216,306,117.68 | -570,994.44 |
| 2. 本期利润 | 284,209,065.09 | 722,980.88 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0292 | 0.0289 |
| 4. 期末基金资产净值 | 7,816,389,543.43 | 19,980,879.94 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8218 | 0.8060 |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红睿玺三年持有混合 A

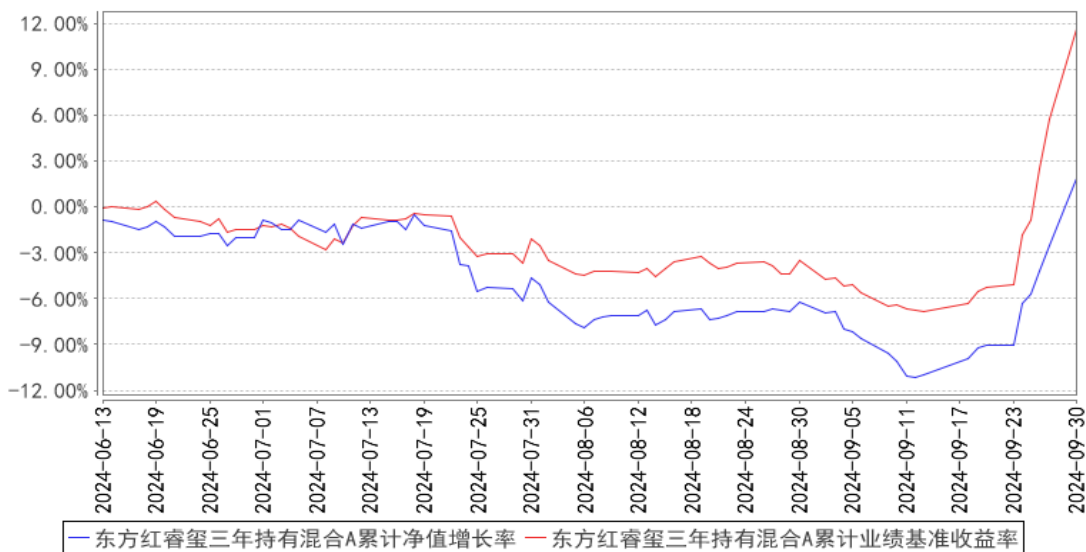
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 3.96% | 1.05% | 13.31% | 1.14% | -9.35% | -0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.88% | 0.97% | 11.63% | 1.05% | -9.75% | -0.08% |

东方红睿玺三年持有混合 C

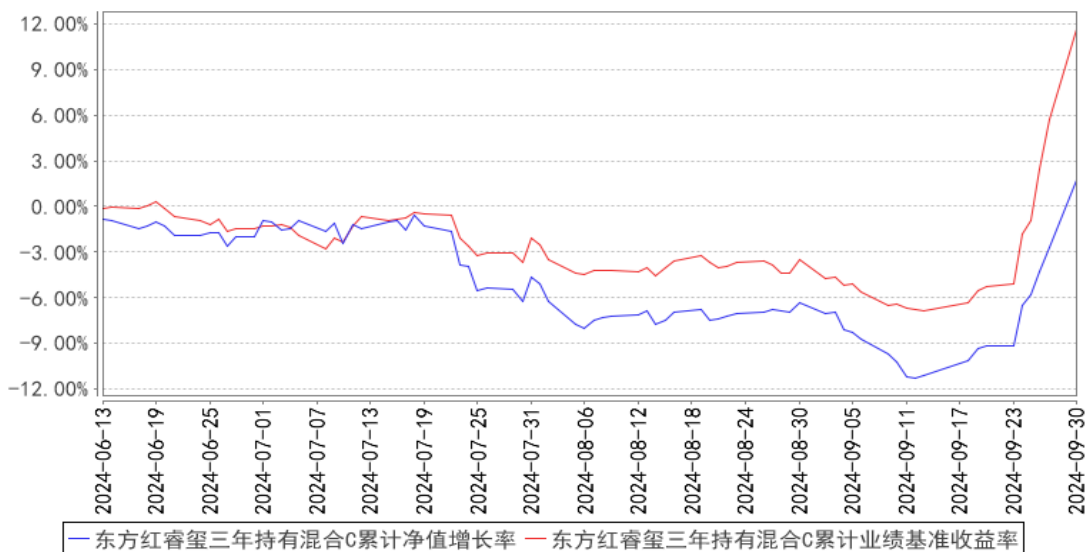
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 3.83% | 1.05% | 13.31% | 1.14% | -9.48% | -0.09% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.72% | 0.97% | 11.63% | 1.05% | -9.91% | -0.08% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红睿玺三年持有混合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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--------------|------------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张伟锋 | 上海东方证券资产管理有限 | 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 |

| | | | | | |
|-----|--------------------------|------------------|-----------------|------|--|
| | 公司基金经理 | | | | 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。 |
| 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 | 2024 年 9 月 30 日 | 14 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 2024 年 09 月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 2024 年 09 月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 2024 年 09 月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。 |
| 张锋 | 上海东方证券资产管理有限公司总经理 | 2024 年 6 月 1 日 | - | 25 年 | 上海东方证券资产管理有限公司总经理，2020 年 09 月至 2023 年 08 月任东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2021 年 03 月至 2023 年 09 月任东方红启程三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 04 月至今任东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2024 年 06 月至今任东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金（原东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2024 年 06 月至今任东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。复旦大学经济学硕士。曾任上海财政证券公司研究员，兴业证券股份有限公司研究员， |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 上海融昌资产管理有限公司研究员, 信诚基金管理有限公司股票投资副总监、基金经理, 上海东方证券资产管理有限公司基金投资部总监、私募权益投资部总经理、公募集合权益投资部总经理、执行董事、董事总经理、副总经理。具备证券投资基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指转型前基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 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 | 20,837,800,195.37 | 2021年4月21日 |
| | 私募资产管理计划 | 5 | 642,250,381.09 | 2017年12月8日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 8 | 21,480,050,576.46 | - |

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年第三季度，上证指数涨 12.44%，深证成指涨 19%，创业板指涨 29.21%，恒生指数涨 19.27%。整体来看，各大市场在第三季度末尾都经历了快速上涨，7 月-9 月中旬，信贷、利率、CPI 等各项宏观数据表现疲软，权益市场也较为压抑，市场成交清淡。9 月底，一系列针对经济刺激的会议过后，市场迅速反弹。

9 月底的市场反弹主要是对资本弱信心的一种纠偏，从悲观的预期转向中性偏有期待的预期，同时叠加了美联储降息，资金面之前过于低配权益等因素，指数快速上涨，市场成交额在短期内快速放大。从中短期的角度来看，目前刺激经济的措施传导到股票基本上可能需要一定的时间，但是市场的表现若要持续主要取决于国内经济数据的后续表现、美联储降息及美大选后海外需求的变动。有持续的经济恢复趋势才能让市场走出较持续的好表现，而不是一轮热钱涌入后进行炒作式的投资。

从长期的视角来看，经过一段较长时间的弱需求状态，很多行业都经历了较长时间的库存出清、产能出清、格局优化的阶段。与三、四年前人声鼎沸时，社会资金跑步涌入一二级市场相比，虽然目前我们难言需求在短期内有确定性的向上，但至少理论的资产回报率的潜力因为过去几年的出清是有改善的可能。目前只是外部较弱的环境抑制了市场表现，这个位置可以考虑针对这种可能进行合理下注。未来我们应根据政策发力的方向，去寻找结构性的需求变好的机会，特别关注过去因外部弱需求而承压的、竞争格局好的优秀公司。这类公司可能存在净资产回报率提升的趋势。因此可以更积极的去寻找出手的机会。

2024 年第三季度，本基金组合整体变化不大，偏向于供给端具有壁垒，经营较为稳定的公司。具体而言，仓位保持稳定，减少了一些有色金属和锂电龙头的持仓，增加了部分农产品和汽车制造龙头的持仓。展望未来，我们将积极寻找结构性需求恢复带来的机会；同时也会关注政策和经济数据的变化，寻找风险偏好回暖带来的市场整体估值水位的提升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 0.8218 元，份额累计净值为 1.3218 元；C 类份额净值为 0.8060 元，份额累计净值为 0.8060 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 3.96%，同期业绩比较基准收益率为 13.31%；C 类份额净值增长率为 3.83%，同期业绩比较基准收益率为 13.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 5,853,290,619.56 | 74.52 |
| | 其中：股票 | 5,853,290,619.56 | 74.52 |
| 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 | 1,781,151,949.09 | 22.68 |
| 8 | 其他资产 | 220,244,447.79 | 2.80 |
| 9 | 合计 | 7,854,687,016.44 | 100.00 |

注：1、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,404,927,786.85 元人民币，占期末基金资产净值比例 17.93%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 348,005,812.00 | 4.44 |
| B | 采矿业 | 827,974,223.60 | 10.57 |
| C | 制造业 | 2,230,120,466.21 | 28.46 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 661,196,160.00 | 8.44 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 294,170,703.10 | 3.75 |
| 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 | 29,434,337.80 | 0.38 |
| 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 | 57,461,130.00 | 0.73 |
| 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 | 4,448,362,832.71 | 56.77 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|------------------|--------------|
| 10 能源 | 740,259,788.05 | 9.45 |
| 15 原材料 | 14,203,192.50 | 0.18 |
| 20 工业 | 619,037,235.43 | 7.90 |
| 25 可选消费 | 31,427,570.87 | 0.40 |
| 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 | 1,404,927,786.85 | 17.93 |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 00883 | 中国海洋石油 | 39,665,000 | 694,643,696.80 | 8.86 |
| 2 | 600900 | 长江电力 | 22,003,200 | 661,196,160.00 | 8.44 |
| 3 | 601899 | 紫金矿业 | 31,147,650 | 565,018,371.00 | 7.21 |
| 4 | 600019 | 宝钢股份 | 74,524,864 | 517,202,556.16 | 6.60 |
| 5 | 600660 | 福耀玻璃 | 8,172,635 | 475,647,357.00 | 6.07 |
| 6 | 02057 | 中通快递-W | 2,117,700 | 374,114,281.80 | 4.77 |
| 7 | 000999 | 华润三九 | 7,808,390 | 371,757,447.90 | 4.74 |
| 8 | 600426 | 华鲁恒升 | 13,514,456 | 353,943,602.64 | 4.52 |
| 9 | 601118 | 海南橡胶 | 56,434,400 | 334,091,648.00 | 4.26 |
| 10 | 000028 | 国药一致 | 9,300,370 | 294,170,703.10 | 3.75 |

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量 (买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动 (元) | 风险说明 |
|--------------------|----|-----------|---------|---------------|--------------|
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计 (元) | | | | | - |
| 股指期货投资本期收益 (元) | | | | | 1,954,736.77 |
| 股指期货投资本期公允价值变动 (元) | | | | | - |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约，并与债券现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

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

本基金持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,241,584.75 |
| 2 | 应收证券清算款 | 189,098,172.73 |
| 3 | 应收股利 | 29,904,690.31 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 220,244,447.79 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾

差。

§6 开放式基金份额变动

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 |
|---------------------------|------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 9,975,746,028.02 | 25,399,105.57 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 463,867,900.15 | 608,901.48 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 9,511,878,127.87 | 24,790,204.09 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期，本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，本基金管理人不存在申购、赎回或交易本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红睿玺三年持有期混合型证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：
www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2024 年 10 月 25 日