东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金上市交易公告书

基金管理人： 上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人： 中国建设银行股份有限公司
注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点： 深圳证券交易所
上市时间:2018年6月20日
公告日期:2018年6月14日

一、重要声明与提示

东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)上市交易公告书(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2018年3月8日《中国证券报》和《证券时报》以及上海东方证券资产管理有限公司网站（www.dfham.com）上的《东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》和其他相关公告。

二、基金概览

1、基金名称:东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金。
2、基金类型:混合型。
3、基金运作方式:契约型。
本基金以定期开放方式运作,即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。
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日前的倒数第一日。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日前的倒数第一日,依此类推。年度对日指某一特定日期在后续日历年份中的对应日期,如该对应日期为非工作日,则顺延至下一个工作日,若该日历年份中不存在对应日期的,则顺延至该月最后一日的下一工作日。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务。
本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起进入开放期（即每个开放期首日为每个封闭期起始之日的第三年年度对日,包括该工作日）,期间可以办理申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期期限上不少于5个工作日且最长不超过20个工作日,开放期的具体时间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据《基金合同》暂停申购或赎回等业务的,基金管理人有权合理调整申购或赎回等业务的办理期间并予以公告。
4、基金存续期限:不定期。
5、基金份额总额:截至2018年6月12日,本基金的份额总额为1,987,884,087.75份。
6、本基金金份额参考净值:1.0046元（截至2018年6月12日）。
7、本次上市交易的基金份额简称及代码:东证创优,代码:169106。
8、本基金本次上市交易的基金份额总额:226,339,955.00份（截至2018年6月12日）
9、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
10、上市交易日期:2018年6月20日
11、基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
12、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
13、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况
1、本基金发售申请的核准机构和核准文号:中国证监会证监许可【2017】2260号
2、基金运作方式:契约型
3、发售日期:2018年3月15日
4、发售面值:1.00元人民币
5、发售方式:通过场内、场外两种方式公开发售
6、发售机构:
（1）场内发售机构
爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、网信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、申万宏源西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、九州证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏东方财富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）
（2）场外发售机构
1）直销机构:上海东方证券资产管理有限公司直销中心和上海东方证券资产管理有限公司网上交易系统。
2）代销机构:平安银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、上海好买基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、上海天天基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、北京展恒基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、招商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司。
7、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。
8、募集资金总额及入账情况:
本基金募集的净认购金额为人民币1,987,779,184.38元，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币108,512.77元。
上述资金中，场内首次发行募集基金为人民币226,332,783.00元，场外首次发行募集基金为人民币1,761,446,401.38元,于2018年3月21日划至在中国建设银行上海市分行营业部开立的东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金托管专户。
按照相分基金份额初始面值1.00元计算，本次募集期的募集资金及其利息结转的份额共计1,987,884,087.75份,已全部计入基金份额持有人基金账户,归基金份额持有人所有。
9、基金备案情况
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规以及《东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金募集结果符合备案条件,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于2018年3月22日获中国证监会书面确认,本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起,本基金管理人正式开始管理本基金。
10、基金合同生效日:2018年3月22日。
11、本基金总份额1,987,884,087.75份。
（二）本基金份额上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深证上[2018]272号
2、上市交易日期:2018年6月20日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4、基金简称:东方红创新优选定开混合
场内简称:东证创优
5、交易代码:169106
6、本次上市交易份额:226,339,955.00份(截至2018年6月12日)
7、基金资产净值的披露:每个交易日的次日公布本基金的基金份额净值,并在深交所行情发布系统揭示。
8、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的托管在场外的份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数
截至2018年6月12日,本基金份额持有人户数为42,548户,其中场内基金份额持有人户数为11,259户,场外基金份额持有人户数为31,289户,场内基金份额持有人平均每户持有的本基金场内基金份额20,103.02份。
（二）持有人结构
截至2018年6月12日,本基金份额持有人结构如下:
机构投资者持有的本基金基金份额2,058,770.73份,占比0.10%;个人投资者持有的本基金基金份额1,985,825,317.02份,占比99.90%。
其中,场内基金份额持有人结构如下:
场内机构投资者持有的场内本基金基金份额2,018,232.00份,占比0.10%;场内个人投资者持有的场内本基金基金份额224,321,723.00份,占比11.28%。
场外基金份额持有人结构如下:
场外机构投资者持有的场外本基金基金份额40,538.73份,占比0.002%;场外个人投资者持有的场外本基金基金份额1,761,503,594.02份,占比88.61%。
（三）截至2018年6月12日,本基金份额场内前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例（%）
1	郝立群	4,055,275.00	1.79%
2	王振华	1,632,886.00	0.72%
3	王和香	1,632,886.00	0.72%
4	金太奎	1,632,884.00	0.72%
5	江海萍	1,257,322.00	0.56%
6	杨煜群	1,224,665.00	0.54%
7	姚华俊	1,183,842.00	0.52%
8	郑平平	914,413.00	0.40%
9	尤忠杰	857,265.00	0.38%
10	叶宏	853,999.00	0.38%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、基本情况
名称:上海东方证券资产管理有限公司
授权代表:潘鑫军
总经理:任莉
成立日期:2010年7月28日
注册地址:上海市中山南路318号31层
注册资本:3亿元人民币
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2010]518号
开展公开募集证券投资基金业务批准文号:证监许可[2013]1131号
经营范围:证券资产管理业务;公开募集证券投资基金管理业务
电话:（021）63325888
传真:（021）63326981
信息披露联系人:刘上儒
股东情况:东方证券股份有限公司持有公司100%的股权。
公司前身是东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部,2010年7月28日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,在原东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部的基础上正式成立,是国内首家获批设立的券商系资产管理公司。
2、经营概况
公司具体经营管理由总经理负责,公司根据经营运作需要设置公募权益投资部、私募权益投资部、量化投资部、权益研究部、公募固定收益投资部、私募固定收益投资部、渠道发展部、机构业务部、机构业务部、结构与另类融资部、产品部、市场部、运营部、合规与风险管理部、综合管理部等16个职能部门。
3、人员情况
截至2018年3月31日,公司共有员工198人。
4、基金管理业务情况
本基金管理公司目前管理33只基金。
5、本基金基金经理
饶刚先生,生于1973年,复旦大学数理统计硕士研究生,自1999年起开始证券行业工作。历任兴业证券股份有限公司职员,富国基金管理有限公司研究员、固定收益部总经理兼基金经理、总经理助理,富国资产管理（上海）有限公司总经理,现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理。2016年7月起任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、东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理。2017年12月起任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2018年3月起任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理。
孔令超先生,生于1987年,北京大学金融系硕士,自2011年起开始证券行业工作。历任平安证券有限责任公司总部综合研究所策略研究员,国信证券股份有限公司经济研究所策略研究分析师,现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部基金经理。2016年8月起任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、东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理。2018年3月起任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2018年5月起任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理。2018年6月起任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型证券投资基金基金经理。
（二）基金托管人
1、基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍仟亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田 青
联系电话:(010)6759 5096
中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。
2017年6月末,本集团资产总额216,920.67亿元,较上年末增加7,283.62亿元,增幅3.47%。上半年,本集团实现利润总额1,720.93亿元,较上年同期增长1.30%;净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元,盈利水平实现平稳增长。
核心财务指标表现良好。积极消化五次降息、利率市场化等因素影响,本集团实现净利润2,323.89亿元,较上年增长1.53%。手续费及佣金净收入1,185.09亿元,在营业收入中的占比较上年提升0.83个百分点。平均资产回报率1.18%,加权平均净资产收益率15.44%,净利息收益率2.20%,成本收入比为27.49%,资本充足率14.94%,均居同业领先水平。
2016年,本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”,《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”,《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”,《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额继续位列全球第2;在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。
中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。
2、主要人员情况
纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
姚毅,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
郑旺平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀莲,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
原灯,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
3、基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为客户委托人提供高质量的托管服务,经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、RQFII、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末,中国建设银行已托管750只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。
（三）基金验资机构
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
经办注册会计师:薛莫、陈寡
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:陈寡

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书约定的费率收取认购费。
本基金募集结束后至上市交易公告书公告前未发生重要财务事项。
本基金2018年6月12日资产负债表如下:
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

资 产	本期末2018年6月12日
资产：	
银行存款	50,370,757.63
结算备付金	25,412,313.51
存出保证金	104,798.21
交易性金融资产	2,693,352,921.58
其中:股票投资	205,454,117.88
债券投资	2,387,898,803.70
资产支持证券投资	100,000,000
基金投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	36,449,556.47
应收股利	395,460.80
应收申购款	
其他资产	
资产合计:	2,806,085,808.20

负债和所有者权益	
负债:	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	768,018,000
应付证券清算款	40,022,274.49
应付赎回款	
应付管理人报酬	457,504.62
应付托管费	130,715.60
应付销售服务费	
应付交易费用	117,734.58
应付税费	90,795.80
应付利息	240,397.21
应付利润	
其他负债	72,807.60
负债合计	809,150,229.90
所有者权益:	
实收基金	1,987,884,087.75
未分配利润	9,051,490.55
所有者权益合计	1,996,935,578.30
负债与持有人权益总计:	2,806,085,808.20

八、基金投资组合

截至2018年6月12日,本基金的投资组合如下:
（一）期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	205,454,117.88	7.32
	其中:股票	205,454,117.88	7.32
2	固定收益投资	2,487,898,803.70	88.66
	其中:债券	2,387,898,803.70	85.10
	资产支持证券	100,000,000.00	3.56
3	金融衍生品投资		
4	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
5	银行存款和结算备付金合计	75,783,071.14	2.70
6	其他资产	36,949,815.48	1.32
7	合计	2,806,085,808.20	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合
1.报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业	121,139,096.34	6.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业		
F	批发和零售业		
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	7,922,000.00	0.40
J	金融业	19,563,771.70	0.98
K	房地产业	5,452,000.00	0.27
L	租赁和商务服务业	4,431,000.00	0.22
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	25,898.91	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	158,533,766.95	7.94

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（元）	占基金资产净值比例（%）
能源	4,351,483.50	0.22
原材料	11,746,472.19	0.59
工业	5,148,234.00	0.26
非日常生活消费品	18,824,558.48	0.94
日常消费品	2,013,531.52	0.10
医疗保健	531,984.18	0.03
金融	2,884,645.40	0.14
信息技术		
电信业务		
公用事业	1,419,441.66	0.07
合计	46,920,350.93	2.35

3.报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合
截至2018年6月12日,本基金未持有指数投资股票。
（三）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
1.报告期末指数投资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
截至2018年6月12日,本基金未持有指数投资股票。
2.报告期末积极投资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	601138	工业富联	954,162.00	21,247,277.94	1.06
2	600887	伊利股份	650,000.00	20,689,500.00	1.04
3	00175	吉利汽车	885,000.00	17,646,184.92	0.88
4	600741	华域汽车	499,939.00	12,923,423.15	0.65
5	601601	中国太保	300,000.00	10,446,000.00	0.52
6	002078	太阳纸业	963,300.00	10,143,549.00	0.51
7	600066	宇通客车	447,873.00	9,965,174.25	0.50
8	603228	景旺电子	183,900.00	9,268,560.00	0.46
9	01378	中国宏桥	1,090,000.00	7,339,583.89	0.37
10	600019	宝钢股份	750,000.00	6,697,500.00	0.34

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券		
2	央行票据		
3	金融债券	119,844,000.00	6.00
	其中:政策性金融债		
4	企业债券	1,454,936,905.80	72.86
5	企业短期融资券	99,971,000.00	5.01
6	中期票据	348,967,000.00	17.48
7	可转债（可交换债）	364,179,897.90	18.24
8	同业存单		
9	其他		
10	合计	2,387,898,803.70	119.58

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	122383	15恒大01	909,600.00	90,960,000.00	4.55
2	143571	18南水01	900,000.00	89,919,000.00	4.50
3	136045	15复地01	822,200.00	81,397,800.00	4.08
4	101800448	18鲁宏桥MTN002	800,000.00	80,488,000.00	4.03
5	112244	15国海债	800,000.00	80,032,000.00	4.01

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	116907	万科5优A	100,000.00	100,000,000.00	5.01

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
截至2018年6月12日,本基金未持有权证。
（八）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
截至2018年6月12日,本基金未进行股指期货投资。
（九）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
截至2018年6月12日,本基金未进行国债期货投资。
（十）投资组合报告附注
1.本基金持有的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
2.基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
3.其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	104,798.21
2	应收证券清算款	
3	应收股利	395,460.80
4	应收利息	36,449,556.47
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	36,949,815.48

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128010	顺昌转债	1,999,400.00	0.10

5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
（1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
截至2018年6月12日,本基金未持有指数投资股票。
（2）期末积极投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601138	工业富联	14,380,188.42	0.72	网下新股中签带有限售期

九、重大事件揭示

本基金管理人于2018年3月8日发布公告,同意陈光明同志自2018年3月7日起辞去公司董事长职务,由潘鑫军同志担任公司董事长职务。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
（一）严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金份额产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
（一）严格遵守《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
（二）根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查,如发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人未能在合理时间内采取有效措施纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。
（一）中国证监会核准基金募集的文件
（二）《东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金合同》
（三）《东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》
（四）《东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金托管协议》
（五）法律意见书
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照
（七）基金托管人业务资格批件、营业执照
上海东方证券资产管理有限公司
2018年6月14日
附件:基金合同内容摘要
（一）基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
1、基金管理人简况
名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市黄浦区中山南路318号31层
法定代表人:陈光明
设立日期:2010年7月28日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可字[2010]518号
开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号:证监许可[2013]1131号
组织形式:有限责任公司
注册资本:3亿元人民币
存续期限:持续经营
联系电话:（021）63325888
联系人:顾迪
2、基金管理人的权利与义务
（1）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
1）依法募集资金;
2）自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
4）销售基金份额;
5）按照规定召集基金份额持有人大会;
6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应及时向中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
7）在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
8）选择、委托、更换基金代销机构,对基金代销机构的相关行为进行监督和处理;
9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;
10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
11）在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
13）在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;
14）以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
16）在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等的业务规则;
17）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
（2）根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
1）依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2）办理基金备案手续;
3）自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
7）依法接受基金托管人的监督;
8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
10）编制季度、半年度和年度基金报告;
11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
12）保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开按露前应予保密,不向他人泄露;
13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
14）按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
18）组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;
23）以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
25）执行处理基金份额持有人大会的决议;
26）建立并保存基金份额持有人名册;
27）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
3、基金托管人简况
名称:中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码:100033
法定代表人:田国立
成立时间:2004年9月17日
基金托管业务批准文号:证监基字[1998]12号
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍仟亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田 青
联系电话:(010)6759 5096
（1）按照基金备案手续,根据《基金合同》和《基金托管人业务资格批件、营业执照、章程》等有关规定,对基金的设立、募集、基金财产的保管、投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购、赎回价格的计算、基金收益分配、基金信息披露、基金合同的变更、终止与基金财产的清算等事项进行监督和核查。
（2）如发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查,如发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人未能在合理时间内采取有效措施纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。
（3）基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。
（4）基金管理人在基金托管人出现不适合担任基金托管人的情形,或基金托管人出现解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
（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。
4、收益分配方案
基金收益分配方案中应载明截至基金收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。
5、收益分配方案的确定、公告与实施
本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2个工作日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。
基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。
6、基金收益分配中发生的费用
收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。