# 东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)(摘要)

(2019年第2号)

东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请经中国证监会2014年7月22日证监许可【2014】720号文准予注册。本基金的基金合同于2014年9月19日正式生效,封闭期自2014年9月19日起至2017年9月18日止。本基金自2017年9月19日起转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。

【重要提示】

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同和基金产品资料概要,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、封闭期无法赎回和开放期大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金资产净值连续60个工作日低于5000万元基金合同提前终止的风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“卖者尽责、买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金投资于中小企业私募债券,由于中小企业私募债券采取非公开发行的方式发行,即使在市场流动性比较好的情况下,个别债券的流动性可能较差,从而使得基金在进行个券操作时,可能难以按计划买入或卖出相应的数量,或买入卖出行为对价格产生比较大的影响,增加个券的建仓成本或变现成本。并且,中小企业私募债信用等级一般债券较低,存在着发行人不能按时足额还本付息的风险,此外,当发行人信用评级降低时,基金所投资的债券可能面临价格下跌风险。

本基金可投资于科创板股票,会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于股价波动风险、退市风险、流动性风险、投资集中风险等。具体风险请查阅本基金招募说明书“风险揭示 ”章节的具体内容。本基金可根据投资策略需要或市场环境变化,选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板,基金资产并非必然投资于科创板。

本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。招募说明书主要向投资者披露与本基金相关事项的信息,是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本基金本次招募说明书的更新涉及《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》变更的相关内容部分、风险揭示部分以及基金份额持有人交易资料的寄送服务部分,前述更新截止至2019年11月4日;基金投资组合报告和基金业绩表现截止至2018年12月31日(财务数据未经审计);其余所载内容截止至2019年3月18日。

本招募说明书规定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《公开募集证券投资基金信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

## 一、基金管理人

(一)基金管理人概况

本基金基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基本信息如下:
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
办公地址:上海市黄浦区中山南路318号2号楼31、37、39、40层
法定代表人:潘鑫军
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
传真:(021)63326981
联系人:彭轶君
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。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

潘鑫军先生,董事长,1961年出生,中共党员,工商管理硕士,高级经济师。曾任中国人民银行上海分行长宁区办事处愚园路分理处出纳、副组长,工商银行上海分行长宁区办事处愚园路分理处党支部书记,工商银行上海分行整党办公室联络员,工商银行上海分行组织处副主任科员,工商银行上海分行长宁支行工会主席、副行长(主持工作)、行长、党委书记兼国际机场支行党支部书记,东方证券股份有限公司党委副书记、总裁、董事长兼总裁,汇添富基金管理有限公司董事长,上海东方证券资本投资有限公司董事长,东方金融控股(香港)有限公司董事。现任东方证券股份有限公司党委书记、董事长、执行董事,东方花旗证券有限公司董事长,上海东方证券资产管理有限公司董事长。

金文忠先生,董事,1964年出生,中共党员,经济学硕士,经济师。曾任上海财经大学财经研究所研究员,上海万国证券办公室主任助理、发行部副经理(主持工作)、研究所副所长、总裁助理兼总裁办公室副主任,野村证券企业现代化委员会项目室副主任,东方证券股份有限公司党委委员、副总裁、证券投资业务总部总经理,杭州东方银帝投资管理有限公司董事长,东方金融控股(香港)有限公司董事、东方花旗证券有限公司董事。现任东方证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总裁,上海东证期货有限公司董事长,上海东方证券资本投资有限公司董事长,上海东方证券创新投资有限公司董事,上海东方证券资产管理有限公司董事。

杜卫华先生,董事,1964年出生,中共党员,工商管理学硕士、经济学硕士,副教授。曾任上海财经大学金融学院教师,东方证券股份有限公司营业部经理、经纪业务总部总经理助理、副总经理、营运管理总部总经理,人力资源管理总部总经理,总裁助理,职工监事。现任东方证券股份有限公司副总裁、工会主席、纪委委员,上海东方证券资本投资有限公司董事,上海东方证券创新投资有限公司董事,上海东方证券资产管理有限公司董事。

任莉女士,董事、总经理、公开募集基金管理业务负责人、财务负责人,1968年出生,社会学硕士、工商管理硕士。拥有十多年海内外市场营销经验,曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部副总经理,上海东方证券资产管理有限公司总经理助理、副总经理、联席总经理、董事会秘书。现任上海东方证券资产管理有限公司董事、总经理、公开募集基金管理业务负责人、财务负责人。

杨斌先生,董事,1972年出生,中共党员,经济学硕士。曾任中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处科员,上海证监局稽查处科员、案件审理处科员、副主任科员、案件调查一处主任科员、机构监管一处副处长、期货监管处处长、法制工作处处长;现任东方证券股份有限公司首席风险官兼合规总监兼稽核总部总经理、上海东证期货有限公司董事、东方金融控股(香港)有限公司董事、东方花旗证券有限公司董事、上海东方证券资产管理有限公司董事。

2、基金管理人监事

陈波先生,监事,1971年出生,中共党员,经济学硕士。曾任东方证券投资银行业务总部副总经理,东方证券股份有限公司上市办副主任、上海东方证券资本投资有限公司副总经理(主持工作)。现任上海东方证券资本投资有限公司董事、总经理,上海东方证券资产管理有限公司监事。

3、经营管理层人员

任莉女士,总经理(简历请参见上述关于董事的介绍)。

饶刚先生,副总经理,1973年出生,硕士研究生。曾任兴业证券职员,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。曾荣获中证报2010年金牛特别基金经理奖(唯一固定收益获奖者)、2012年度上海市金融行业领军人才,在固定收益投资领域具有丰富的经验。

周代希先生,副总经理,1980年出生,中共党员,硕士研究生。曾任深圳证券交易所会员管理部经理、金融创新实验室高级经理、固定收益与衍生品工作小组执行经理,兼任深圳仲裁委员会仲裁员。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理。曾荣获“证券期货监管系统金融服务能手”称号等,在资产证券化等结构融资领域具有丰富的经验。

卢强先生,副总经理,1973年出生,中共党员,硕士研究生。曾任冶金部安全环保研究院五室项目经理,华夏证券武汉分公司投资银行部业务董事,长信基金管理有限公司客户服务部客服总监、综合行政部行政总监,中欧基金管理有限公司基金销售部销售总监,海通证券客户资产管理部市场总监,上海东方证券资产管理有限公司渠道发展部总监兼机构业务部总监、市场部总经理、执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理。

张锋先生,副总经理,1974年出生,硕士研究生。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、执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼公募集合权益投资部总经理,拥有丰富的证券投资经验。

林鹏先生,副总经理,1976年出生,硕士研究生。曾任东方证券研究所研究员、资产管理业务总部投资经理,上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理、专户投资部资深投资经理、基金投资部基金经理、执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼公募权益投资部总经理,拥有丰富的证券投资经验。

汤琳女士,副总经理,1981年出生,本科学士。曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部市场营销经理,上海东方证券资产管理有限公司综合管理部副总监、综合管理部总经理、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司董事会秘书、副总经理兼综合管理部总经理。

4、合规总监、首席风险官

李云亮先生,合规总监兼首席风险官,1978年出生,博士研究生。曾任重庆理工大学计算机学院大学讲师,重庆证监局机构监管处副调研员,西南证券股份有限公司证券资管部总经理,金鹰基金管理有限公司副总经理,深圳前海金鹰资产管理有限公司董事长,金鹰基金管理有限公司督察长。现任上海东方证券资产管理有限公司合规总监、公开募集基金管理业务合规负责人、首席风险官兼合规与风险管理部总经理。

5、公开募集基金管理业务合规负责人(督察长)

李云亮先生,公开募集基金管理业务合规负责人(简历请参见上述关于合规总监、首席风险官的介绍)。

6、本基金基金经理

(1)现任基金经理

林鹏先生,生于1976年,上海财经大学工商管理硕士,自1998年起开始从事证券行业工作。历任东方证券股份有限公司研究所研究员、资产管理业务总部投资经理、上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理、专户投资部资深投资经理、基金投资部基金经理、执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼公募权益投资部总经理、基金经理。2014年9月起任东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2015年1月至2018年8月任东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。2015年1月至2018年1月任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基金经理。2015年4月至2016年8月任东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金和东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理。2015年6月至2018年6月任东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年3月至2018年8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。2016年7月起任东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月起任东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年11月起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。

(2)历任基金经理

杨达治先生,2014年9月至2015年12月任东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

刚登峰先生,2015年5月至2016年11月任东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

韩冬先生,2016年1月至2017年4月任东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

7、公募产品业务投资决策委员会成员

公募产品投资决策委员会成员构成如下:主任委员饶刚先生,委员林鹏先生,委员刚登峰先生,委员纪文静女士,委员周云先生。

8、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

(一)基金托管人概况

1、基本情况
名称:招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)
设立日期:1987年4月8日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
注册资本:252.20亿元
法定代表人:李建红
行长:田惠宇
资产托管业务批准文号:证监基金字[2002]83号
电话:0755—83199084
传真:0755—83195201
资产托管部信息披露负责人:张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日,是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年3月成功地发行了15亿A股,4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036),是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股,9月22日在香港联交所挂牌交易(股票代码:3968),10月5日行使H股超额配售,共发行了24.2亿H股。截至2018年9月30日,集团总资产65,086.81亿元人民币,高级法下资本充足率15.46%,权重法下资本充足率12.80%。

2002年8月,招商银行成立基金托管部;2005年8月,经报中国证监会同意,更名为资产托管部,下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室,现有员工80人。2002年11月,经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格,成为国内第一家获得该项业务资格上市银行;2003年4月,正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行,拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管(QFII)、合格境内机构投资者托管(QDII)、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值,独创“6S托管银行”品牌体系,以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命,不断创新托管系统、服务和产品:在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准,首家发布私募基金绩效分析报告,开办国内首个托管银行网站,成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管,实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变,得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,成为国内唯一获得该奖项的托管银行;“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”;2017年6月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”,“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”;8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”,2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项,同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖,以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖;3月招商银行荣获公募基金20年“最佳基金托管银行”奖,5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。

(二)主要人员情况

李建红先生,董事长、非执行董事,2014年7月起担任董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士,高级经济师。招商局集团有限公司董事长,兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输(集团)总公司总裁助理、总经济师、副总裁,招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生,行长、执行董事,2013年5月起担任行长、执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位,高级经济师。曾于2003 年7 月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生,副行长,货币银行学硕士,高级经济师。1991年至1995年,在中国科技国际信托投资公司工作;1995年6月至2001年10月,历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理;2001年10月至2006年3月, 历任北京分行行长助理、副行长;2006年3月至2008年6月,任北京分行党委书记、副行长(主持工作);2008年6月至2012年6月,任北京分行行长、党委书记;2012年6月至2013年11月,任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记;2013年11月至2014年12月, 任招商银行总行行长助理;2015年1月起担任副行长;2016年11月起兼任董事会秘书。

姜然女士,招商银行资产托管部总经理,大学本科毕业,具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行,华商银行,中国农业银行深圳市分行,从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今,历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一,具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

(三)基金托管业务经营情况

截至2018年9月30日,招商银行股份有限公司累计托管401只开放式基金。

## 三、相关服务机构

(一)基金销售机构

1、场外直销机构

(1)直销中心
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
办公地址:上海市黄浦区中山南路318号2号楼37层
法定代表人:潘鑫军
联系电话:(021)33315895
传真:(021)63326381
联系人:彭轶君
客服电话:4009200808
公司网址:www.dfham.com

(2)网上交易系统

网上交易系统包括管理人公司网站(www.dfham.com)、东方红资产管理APP和管理人指定且授权的电子交易平台。个人投资者可登陆本公司网站(www.dfham.com)、东方红资产管理APP和管理人指定且授权的电子交易平台,在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款、了解有关基金网上交易的具体业务规则后,通过本公司网上交易系统办理开户、认购、申购、赎回等业务。

2、场外代销机构

(1)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
联系电话:(0755)83198888
传真:(0755)83195050
联系人:邓炯鹏
客服电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

(2)东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层 – 29层
办公地址: 上海市中山南路318号2号楼13层、21层 – 23层、25层 – 29层、32层、36层、39层、40层
法定代表人:潘鑫军
联系电话:(021)63325888
联系人:黄静
客服电话:(021)95503
公司网站:www.dfzq.com.cn

(3)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
办公地址:浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
法定代表人:陈柏青
联系电话:(021)60897840
传真:(0571)26698533
联系人:徐昳绯
客服电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn

(4)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址:深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人:薛峰
联系电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
联系人:童彩平
客服电话:400-678-8887
公司网址:www.zlfund.cn

(5)上海浦发银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
办公地址:上海市北京东路689号
法定代表人:高国富
联系电话:(021)61618888
传真:(021)63230807
联系人:杨国平、吴蓉
客服电话:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

(6)平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路 5047号
办公地址:深圳市罗湖区深南东路 5047 号
法定代表人:谢永林
联系电话:021-38637673
联系人:张莉
客服电话:95511
公司网站:www.bank.pingan.com

(7)中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
法定代表人:李晓鹏
联系电话:010-63636235
传真:010-63636713
联系人:张谓
客服电话:95595
网址:www.cebbank.com

(8)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
公司地址: 上海市徐汇区龙田路195号天华信息科技园南区3C座7楼(天天基金)
法定代表人:其实
联系电话:021-54509988
传真:021-64385308
联系人:胡阅
客服电话:4001818188
网址:http://www.1234567.com.cn/

(9)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
联系电话:(021)20211842
传真:(021) 68596916
联系人:高源
客服电话:4007009665
公司网站:www.ehowbuy.com

(10)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路188号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:彭纯
联系电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:陈铭铭
客服电话:95559
公司网站:www.bankcomm.com

(11)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区显龙山路19号1幢4层1座401
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部
法定代表人:江卉
联系人:韩锦星
客服电话:400-098-8511 (个人业务)、400-088-8816 (企业业务)
公司网站:http://kenterui.jd.com/

(12)嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
联系电话:021-38789658-5834
传真:021-68880023
联系人:李雯
客服电话:4000218850
网址:www.harvestwm.cn

(13)兴业银行股份有限公司
注册地址:福建省福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
联系电话:021-52629999
联系人:李博
客服电话:95561
网址:www.cib.com.cn

(14)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B,E座3层
法定代表人:王常青
联系电话:010- 85130628
传真:010-65182261
联系人:许梦园
客户服务电话:400-8888-108
公司网站:www.csc108.com

(15)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区金融大街25号
法定代表人:田国立
联系人:徐漫霞
电话:86-10-66215533
传真:010-66275654
客服电话:95533
公司网站:www.ccb.com

(16)诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋
法定代表人:汪静波
联系人:朱了
电话:86-21-80358749
传真:021-38509777
客服电话:400-821-5399
公司网站:www.noah-fund.com

(17)上海东证期货有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区浦电路500号上海期货大厦14层
办公地址:上海市黄浦区中山南路318号35层
法定代表人:卢大印
联系人:张敏圆
联系电话:021-63325888-4259
传真:021-63326752
客服电话:400-885-9999
网址:www.dzqh.com.cn

(18)长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市新华路特8号
办公地址:湖北省武汉市新华路特8号
法定代表人:李新华
联系人:吴麟
联系电话:027-65799999
传真:027-85481900
客服电话:95579
网址:www.95579.com

(19)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼
法定代表人:周易
联系电话:025-83387249
传真:025- 83387254
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金。

3、场内销售机构

本基金的场内销售机构为具有基金销售资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的的深圳证券交易所会员单位,具体名单请详见深圳证券交易所网站(http://www.szse.cn/)。

(二)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-58598853
传真:010-58598907
联系人:赵亦清

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
办公地址: 上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
法人代表:李丹
经办注册会计师:陈熹、叶尔甸
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:乐美昊

## 四、基金的名称

东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

## 五、基金的类型

混合型证券投资基金

## 六、基金的投资目标

本基金以追求绝对收益为目标,在有效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。

## 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券(含中小企业私募债)、中期票据、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)。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的,本基金可参与同业存单的投资,不需召开基金份额持有人大会,具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

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:本基金转换为上市开放式基金(LOF)后股票资产投资比例为基金资产的0%—95%,封闭期内股票资产投资比例为基金资产的0%—100%;权证投资比例为基金资产净值的0%-3%;

本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,每个交易日日终,在扣除国债期货和股指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国债期货和股指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,前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

待基金参与证券投资基金投资、融资融券和转融通业务等的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,参与证券投资基金投资、融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与证券投资基金投资、融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

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。

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。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产投资权重,实现资产合理配置。

2、股票组合的构建

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进行投资。

(1)中国经济发展的趋势

1)新型城镇化

城镇化是扩大内需、拉动经济增长的持久动力。城镇化带动大量农村人口进入城镇,带来消费需求的大幅增加,同时还产生庞大的基础设施、公共服务设施以及住房建设等投资需求。

城镇化既创造了供给,也能够创造需求。推进城镇化将从基础设施建设和消费市场扩大两方面消化工业化带来的产能。此外,城镇化和第三产业的发展紧密相连,城镇化还可以推进消费和服务行业发展,实现经济结构转型。

我国的城镇化率刚刚超过50%,仍然处于快速提升的阶段。与发达国家相比,我国的城镇化率仍然有较大上升空间。但是受到人口、土地、资源、环境等诸多因素制约,传统的以基建投资和圈地造城为主要手段的城镇化方式已经面临越来越高的成本约束,走到了尽头。如何把潜在的空间变为现实,解决的办法只有依靠改革。十八大以来政府推行的一系列市场化改革措施,就是旨在通过改革财政金融体系、土地制度、户籍制度、人口政策、要素价格、人力资本等多方面,优化资源配置效率,提升全要素生产率,从而跨越中等收入陷阱。

未来的城镇化图景一定有别于过去,核心是人的城镇化。它应该着眼农村和中小城镇,实现城乡基础设施一体和公共服务均等化,进城人口的市民化,促进经济社会发展,实现共同富裕。以新型工业化为动力,实现制造业和服务业升级,投入资本的回报率逐步提升,人力资本在收入分配中的占比提升,消费和服务业占GDP 的比重提高,资源和环境更加友好。新型城镇化将带动消费和服务产业大发展,尽管增长速度的绝对值未必比得上过去,但增长将更有质量和更加可持续。

2)人口结构变化

随着出生率的下降、婴儿潮部分人口步入老龄以及预期寿命的延长,我国人口结构将发生巨大的变化,在未来的十五到二十年内这个趋势是无可逆转的。随着人口结构的调整,将给传统的经济模式带来挑战与考验,同时对相关产业带来投资机会。比如将形成大量对于自动化的需求以替代人工;比如由于老龄化人口的增多,使得医疗服务业、养老产业的市场需求迅速进入到爆发周期;又比如人口结构的剧变也会驱动着人口政策随之变化,从而带来相关投资机会。

3)资源环境约束

中国经济经过30多年的高速发展,以GDP单一考核的机制,已经让环境付出了巨大代价。环境治理、能源结构调整、要素价格改革将为中国的环保服务、新能源产业和设备商等带来新一轮的发展机遇。同样,也将对传统产业的行业集中度产生影响,从而改变企业的投资价值。

4)产业升级和商业模式创新

由于人口和资源环境约束,传统型企业正在逐渐失去成本优势,迫切需要转型升级来提高附加值和竞争力。这种机会既有产业层面的,比如劳动力结构的智力化带来的工程师红利,将直接表现为我国科技型企业的人均效率和成本优势。也有企业层面的,更多依靠企业家的勤奋和创新精神,运用智能化生产、信息和网络技术、新材料技术等先进手段来建立创新型企业,或者改造传统企业。

产业升级带来的投资价值提升是巨大的,重要的是回避了低水平恶性竞争,提高了企业的附加值。企业的人均产出和人均效益将得到提升,资产由重变轻,更多依靠创新来获得竞争优势。另外,人力资本高端化正在成为重要的趋势,有些企业在享受这种红利,比如在互联网、生物医药、先进制造业等领域,已经在局部领域具有了全球一流的竞争力,这样的企业数量必然会越来越多。

随着互联网逐渐成为人们生活中无所不在的基础设施,互联网化已成为一个趋势。互联网化是指企业利用互联网(包含移动互联网)平台和技术从事的内外部商务活动。随着企业互联网化的发展,对传统商业模式进行优化、创新、甚至替换,带来了巨大的投资机会。

(2)行业配置策略

在行业配置层面,本基金会倾向于一些符合转型期中国经济发展趋势的行业或子行业,比如由人口老龄化驱动的医疗行业、具有品牌优势的消费品行业、可以替代人工的自动化行业等。具体分析时,基金管理人会跟踪各行业整体的收入增速、利润增速、毛利率变动幅度、ROIC变动情况,依此来判断各行业的景气度,再根据行业整体的估值情况,市场的预期,目前机构配置的比例来综合考虑各行业在组合中的配置比例。

(3)股票投资选择

针对个股,每个报告期基金管理人都会根据公开信息和一些假设推理初筛一批重点研究标的,围绕这些公司,基金管理人的股票研究团队将展开深入的调研,除了上市公司外,基金管理人还会调研竞争对手,产业链的上下游,以此来验证基金管理人的推理是否正确。对于个股是否纳入到组合,基金管理人会重点关注3个方面:公司素质、公司的成长空间及未来公司盈利增速、目前的估值。其中公司素质是基金管理人最看重的因素,包括公司商业模式的独特性、进入壁垒、行业地位、公司管理层的品格和能力等方面;对于具有优秀基因的公司,如果成长性和估值匹配的话,基金管理人将其纳入投资组合;否则将会放在股票库中,保持持续跟踪。

3、折价和套利策略

本基金可运用在封闭期没有流动性需求的优势,抓住一些长期投资的机会,在价值低估或者有折价机会的时候介入,将价值回归转化为投资收益。

(1)大宗交易策略

基金管理人将利用自身在二级市场的规模及影响力的优势寻找大宗交易机会,并综合考虑二级市场价格、折价情况、大宗交易数量、二级市场成交量、交易对手减持目的等多种因素,同时根据公司的基本面情况审慎做出买入决定,对于一些好的大宗交易机会,可利用基金有一定封闭期的优势承诺锁定一定期限,以获得优先获得大宗交易的机会或以此获得更大的折扣优惠,并根据历史和实时交易数据设计了自动化交易算法和交易系统,以扑捉有利的卖出时机,同时尽可能的减小卖出股票时的冲击成本,从而将以大宗交易方式买入股票时的折价转化为基金的收益。

(2)可转换债券

基金管理人在进行可转换债券投资时,首先以债性作为依托进行选择,利用对股票的判断选择可转换债券可以接受的转股溢价率,积极捕捉可转换债券的套利机会。当可转换债券的转换溢价率为负时,买入可转换债券的同时卖出标的股票可以获得套利价差;反之,买入标的股票的同时卖出可转换债券也可以获得套利价差。当对可转换债券未来的转换溢价率有比较明确的趋势判断时,该种套利策略同样适用。另外,基金管理人在投资时不轻易进行条款博弈,但可以通过分析大股东转股动力来进行投资。

(3)参与定向增发投资策略

基金管理人将通过实地调研深入了解发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息;对定向增发价格的合理性做出判断,并结合上市公司大股东参与定向增发的情况,在进行全面和深入研究的基础上做出投资决定,在控制风险的基础上力求获取较高的收益。

(4)定向增发破发股票投资策略

基金管理人将密切关注当前已经实施完定向增发,且还处于锁定期的上市公司,当二级市场股价跌破定向增发价时,通过考虑定向增发数量、发行对象、大股东认购方式、增发锁定期限、资金运用目的等因素,并结合发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息,同时结合当前股价在技术面的情况,在定向增发达到一定的破发幅度后择机买入,在定向增发股票解禁日逐渐临近或定向增发股票解禁后择机卖出,以获取破发回补的收益。

4、债券等其他固定收益类投资策略

本基金的固定收益类投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的,具有良好流动性的金融工具。固定收益投资主要用于提高非股票资产的收益率,管理人将坚持价值投资的理念,严格控制风险,追求合理的回报。

在债券投资方面,管理人将以宏观形势及利率分析为基础,依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标,结合货币政策、财政政策的实施情况,以及国际金融市场基准利率水平及变化情况,预测未来基准利率水平变

化趋势与幅度,进行定量评价。

5、中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。在进行投资时,将采取分散投资、锁定收益策略。在遴选债券时,将只投资有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债,以降低信用风险。

6、股指期货投资策略

本基金投资股指期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。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、国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量,以萃取相应债券组合的超额收益。

8、基金管理人运用基金财产的投资决策依据和投资决策程序

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻与实施,本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序:

(1)投资决策依据

投资决策依据包括:国家有关法律、法规、规章和基金合同的有关规定;宏观经济发展趋势、微观企业运行趋势;证券市场走势。

(2)投资决策原则

合法合规、保密、忠于客户、资产分离、责任分离、谨慎投资、公平交易,及严格控制。

(3)投资决策机制

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会负责确定本基金的大类资产配置比例等重大投资决策。

基金经理在公司权益研究部、固定收益研究部、公募权益投资部、公募固定收益投资部、量化投资部的协助与支持下,在投资决策委员会确定的投资范围和资产配置范围内制定并实施具体的投资决策,构建和调整投资组合,并向交易室下达投资指令。

交易室负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

(4)投资管理流程

投资决策委员会是本基金的最高决策机构,定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、研究员、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下:

1)投资决策委员会定期召开投资决策会议,对资产配置比例提出指导性意见,并讨论股票、债券的投资重点等;

2)基金经理根据投资决策委员会决议,依据宏观分析师、策略研究员的宏观经济分析和策略建议、行业研究员的行业分析和个股研究、债券研究员的债券市场研究和券种选择、量化研究员的定量投资策略研究,结合本基金产品定位及风险控制的要求,在权限范围内制定具体的投资组合方案;

3)基金经理根据基金投资组合方案,向交易室下达交易指令;

4)交易指令通过风控系统的自动合规核查后,由交易室执行,交易室对交易情况及时反馈;

5)基金经理对每日交易执行情况进行回顾,并审视基金投资组合的变动情况;

6)合规与风险管理部定期完成有关投资风险监控报告,并在量化投资部协助下完成基金的绩效归因分析。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要,对上述投资管理程序作出调整。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金在封闭期内的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后);

本基金转换为上市开放式基金(LOF)后的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

其中,三年期银行定期存款利率是指中国人民银行公布并执行的金融机构三年期人民币存款基准利率。

## 十、基金的风险收益特征

本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

## 十一、基金的投资组合报告

以下投资组合报告数据截至2018年12月31日。

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 | 9,171,436,198.18 | 85.16 |
| | 其中:股票 | 9,171,436,198.18 | 85.16 |
| 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 | 223,000,654.50 | 2.07 |
| | 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 | 1,368,692,400.59 | 12.71 |
| 8 | 其他资产 | 6,557,644.58 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 10,769,686,897.85 | 100.00 |

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、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 | 7,805,552,640.22 | 72.77 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 159,244,433.88 | 1.48 |
| 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 | 259,415,898.86 | 2.42 |
| J | 金融业 | 134,645,046.33 | 1.26 |
| K | 房地产业 | 537,002,010.30 | 5.01 |
| L | 租赁和商务服务业 | 275,514,279.64 | 2.57 |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 61,888.95 | 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 | 9,171,436,198.18 | 85.50 |

(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

3、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 | 600741 | 华域汽车 | 56,352,387 | 1,036,883,920.80 | 9.67 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 36,073,405 | 929,250,912.80 | 8.66 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 63,510,247 | 892,954,072.82 | 8.32 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 18,173,554 | 669,877,200.44 | 6.24 |
| 5 | 600104 | 上汽集团 | 25,080,806 | 668,905,096.02 | 6.24 |
| 6 | 002311 | 海大集团 | 23,766,571 | 550,671,450.07 | 5.13 |
| 7 | 000002 | 万 科A | 22,544,165 | 537,002,010.30 | 5.01 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 22,636,521 | 517,923,600.48 | 4.83 |
| 9 | 000338 | 潍柴动力 | 48,999,954 | 377,299,645.80 | 3.52 |
| 10 | 600183 | 生益科技 | 30,001,161 | 301,811,679.66 | 2.81 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末进行股指期货投资。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量,以萃取相应债券组合的超额收益。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未进行国债期货投资。

(3)本期国债期货投资评价

本基金本报告期未进行国债期货投资。

11、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 | 1,252,416.47 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 1,679,660.02 |
| 5 | 应收申购款 | 3,625,568.09 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 6,557,644.58 |

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(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。

## 十二、基金的业绩

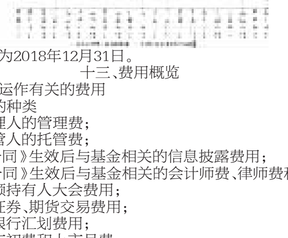
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

以下基金业绩数据截至2018年12月31日。

1、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2014年9月19日至2014年12月31日 | 12.60% | 0.97% | 1.18% | 0.01% | 11.42% | 0.96% |
| 2015年1月1日至2015年12月31日 | 65.64% | 2.03% | 3.33% | 0.01% | 62.31% | 2.02% |
| 2016年1月1日至2016年12月31日 | 3.83% | 1.23% | 2.64% | 0.01% | 1.19% | 1.22% |
| 2017年1月1日至2017年12月31日 | 54.75% | 0.78% | 4.93% | 0.28% | 49.82% | 0.50% |
| 2018年1月1日至2018年12月31日 | -22.69% | 1.41% | -16.59% | 0.93% | -6.10% | 0.48% |
| 2014年9月19日至2018年12月31日 | 131.67% | 1.41% | -6.08% | 0.47% | 137.75% | 0.94% |

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



注:截止日期为2018年12月31日。

## 十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
(4)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)基金的证券、期货交易费用;
(7)基金的银行汇划费用;
(8)基金上市初费和上市月费;
(9)证券、期货账户开户费和账户维护费;
(10)按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

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×1.5%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

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×0.25%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金管理人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

(3)证券账户开户费用:证券账户开户费由基金托管人在开户时先行垫付,基金在证券账户开户两个月内成立的,经基金管理人与基金托管人核对无误后,自证券账户开户两个月内由基金托管人从基金财产中扣划;如证券账户开户两个月内基金未能成立,由基金管理人在收到基金托管人缴费通知后的5个工作日内支付给基金托管人,基金托管人不承担垫付开户费用义务。

上述基金费用的种类中第3-10项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

(2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3)《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费。

调高基金管理费率、基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率或基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费率

本基金场内和场外的申购费率相同,申购费率为:

| 申购金额(M) | 适用申购费率 |
|---|---|
| M<100万 | 1.5% |
| 100万≤M<500万 | 1% |
| M≥500万 | 1000元/笔 |

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。本基金申购费率按申购金额递减。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

2、赎回费率

本基金的场内赎回费用由基金赎回人承担,赎回费用全部归入基金财产。投资者在一天之内如果有多笔赎回,适用费率按单笔分别计算。具体如下:

| 份额持续持有时间(L) | 适用赎回费率 |
|---|---|
| L<7个自然日 | 1.5% |
| L≥7个自然日 | 0.5% |

本基金场外赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回,适用费率按单笔分别计算。具体如下:

| 份额持续持有时间(L) | 适用赎回费率 |
|---|---|
| L<7个自然日 | 1.5% |
| 7个自然日≤L<30个自然日 | 0.75% |
| 30个自然日≤L<365个自然日 | 0.5% |
| 365个自然日≤L<730个自然日 | 0.3% |
| L≥730个自然日 | 0 |

其中,在场外认购以及本基金转为上市开放式基金(LOF)之后场外申购的投资者其份额持有年限以份额实际持有年限为准;在场内认购、场内申购以及场内买入,并转托管至场外赎回的投资者其份额持有年限自份额转托管至场外之日起开始计算。

场外赎回费用由基金赎回人承担,在场外赎回的份额,对份额持续持有时间小于30个自然日的,赎回费用全部归基金财产,对份额持续持有时间大于等于30个自然日但小于3个自然月的,赎回费用的75%归基金财产,对份额持续持有时间大于等于3个自然月但小于6个自然月的,赎回费用的50%归基金财产,对份额持续持有时间大于等于6个自然月的,赎回费用的25%归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定,在指定媒体公告。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以在履行适当程序后,采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性,摆动定价机制的具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定,具体见基金管理人届时的相关公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

(三)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

管理人依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、“重要提示”部分增加了招募说明书本次更新内容及更新截止日期的说明,以及本基金可投资科创板的风险提示。。

2、“重要提示”、“一、绪言”、“二、释义”、“三、基金管理人”、“五、相关服务机构”、“九、基金份额的申购、赎回与转换” 、“十三、基金资产的估值”、“十四、基金的收益与分配”、“十七、基金的会计与审计”、“十八、基金的信息披露”、“十九、风险揭示”、“二十、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”、“二十一、基金合同内容摘要”、“二十二、托管协议的内容摘要”部分对涉及《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》变更的相关内容部分进行了更新。

3、“十九、风险揭示”部分新增了投资科创板股票的风险、法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

4、“二十三、对基金份额持有人的服务”部分更新了基金份额持有人交易资料的寄送服务的规则。

上海东方证券资产管理有限公司
二〇一九年十一月七日