

东方红汇阳债券型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告

2018 年 3 月 31 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 4 月 23 日

§ 1 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 4 月 19 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。

上海东方证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | | |
|-------------|---|-----------|-----------|
| 基金简称 | 东方红汇阳债券 | | |
| 基金主代码 | 002701 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 5 月 26 日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 867,256,132.20 份 | | |
| 投资目标 | 本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。 | | |
| 投资策略 | 本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。另外，本基金可投资于股票、权证等权益类资产，基金管理人将运用定性分析和定量分析相结合的方法选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资，强化基金的获利能力，提高预期收益水平，以期达到收益强化的效果。 | | |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。 | | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 | | |
| 基金管理人 | 上海东方证券资产管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 东方红汇阳债券 A | 东方红汇阳债券 C | 东方红汇阳债券 Z |

| | | | |
|-----------------|------------------|------------------|-----------------|
| 下属分级基金的交易代码 | 002701 | 002702 | 005008 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 587,218,913.51 份 | 201,679,845.75 份 | 78,357,372.94 份 |

§ 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（2018年1月1日—2018年3月31日） | | |
|-----------------|---------------------------|----------------|---------------|
| | 东方红汇阳债券 A | 东方红汇阳债券 C | 东方红汇阳债券 Z |
| 1. 本期已实现收益 | 7,737,071.42 | 3,095,398.60 | 553,030.61 |
| 2. 本期利润 | 15,496,338.20 | 6,475,258.42 | 950,235.77 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0336 | 0.0328 | 0.0260 |
| 4. 期末基金资产净值 | 626,464,473.57 | 213,425,244.81 | 83,619,790.98 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0668 | 1.0582 | 1.0672 |

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 本报告期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

东方红汇阳债券 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 | 3.32% | 0.21% | 0.72% | 0.11% | 2.60% | 0.10% |

东方红汇阳债券 C

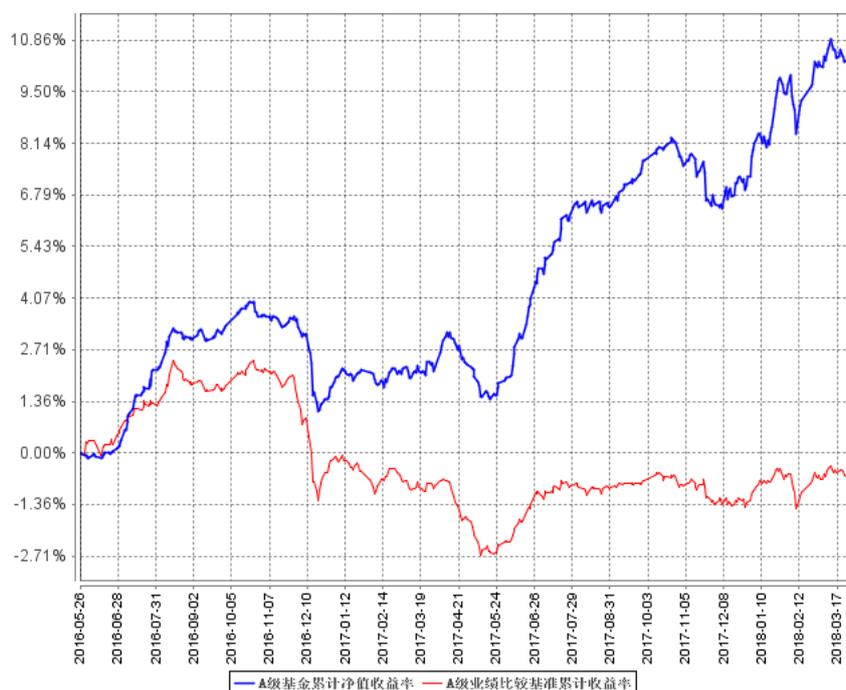
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 3.20% | 0.21% | 0.72% | 0.11% | 2.48% | 0.10% |

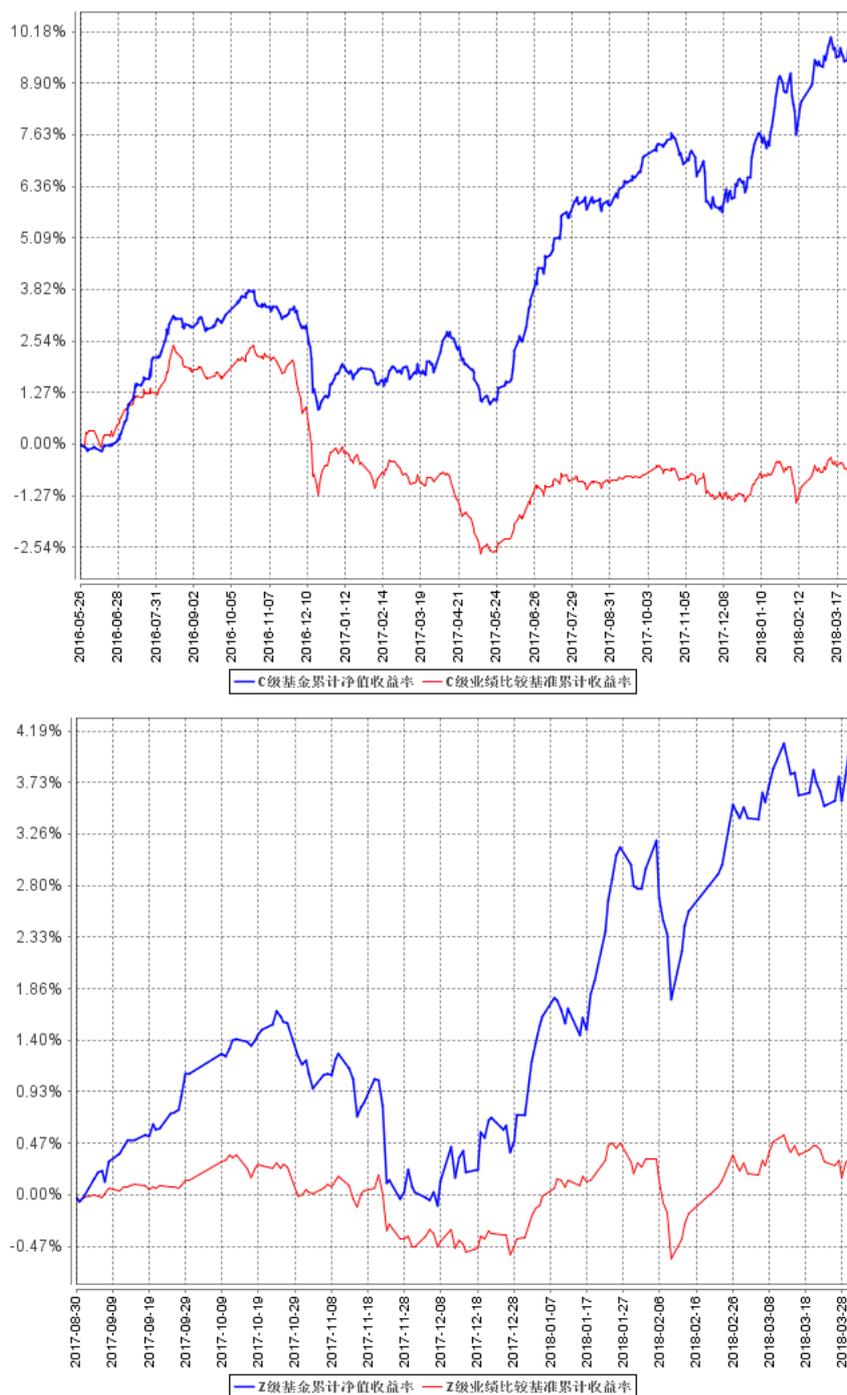
东方红汇阳债券 Z

| 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 | 3.32% | 0.21% | 0.72% | 0.11% | 2.60% | 0.10% |

注：过去三个月指 2018 年 1 月 1 日—2018 年 3 月 31 日。

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





注：(1)截止日期为 2017 年 12 月 31 日。

(2) 本基金管理人于 2017 年 8 月 28 日发布公告《关于东方红汇阳债券型证券投资基金增加基金份额类别的公告》，决定自 2017 年 8 月 29 日增加 Z 类基金份额类别（代码：005008）。

单位：人民币元

§ 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 | | |
| 孔令超 | 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理。 | 2016 年 8 月 5 日 | - | 7 年 | 硕士，曾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员，现任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红目标优选定开混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 徐觅 | 东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型 | 2017 年 8 月 31 日 | - | 11 年 | 本科，曾任长信基金管理有限责任公司基金事务部基金会计、交易管理部债券交易员，广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员，富国基金管理有限公司固定收益部基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司私募固定收益投资部投资经理。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兼任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红益鑫纯债债券、东方红货币、东方红目 |

| | | | | | |
|----|---|-----------------|---|------|--|
| | 证券投资基金、东方红货币市场基金、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。 | | | | 标优选定开混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |
| 饶刚 | 上海东方证券资产管理有限公司副总经理、兼任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红目标优 | 2016 年 7 月 28 日 | - | 19 年 | 硕士，曾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兼任东方红策略精选混合、东方红汇阳债券、东方红汇利债券、东方红目标优选定开混合、东方红创新优选定开混合基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | 选三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基金经理。 | | | | |
|--|--|--|--|--|--|

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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，无损害基金份额持有人利益的行为，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 报告期内基金投资策略和运作分析

债券方面，去年我们关注的因素仍未改变：金融去杠杆稳步推进，双支柱调控框架持续发力。一行三会元旦后即发布《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》，继续严控金融机构杠杆；与之呼应的是，公开市场新增一项操作工具——临时准备金动用安排（CRA），并在春节前采用，客观上起到了维护银行体系流动性合理稳定的作用。显示出宏观审慎和货币政策二者的配合已达到相机抉择、应付自如的水平。此外，2 月份工业增加值和固定资产投资高出市场预期，和不断升温的中美贸易摩擦，都额外增加了债券市场面临的不确定性。展望后市，单边的行情可能告一段落，市场的波动性将增大。我们将从策略上进行合理的应对，在行情波动中保持定力，保持短久期和适度杠杆的配置思路，自下而上的精选个券，提升组合票息收益，努力为持有人获取长期、稳健的回报。

权益方面，一季度全球宏观环境发生了较大变化。伴随开年各个主要经济体经济数据的相对疲软，全球共振复苏的预期开始受到挑战，而贸易战的升温也给经济环境带来的更多的不确定性。在这种环境下，前期由于预期过于一致而带来的拥挤交易开始被打破，美股出现较大幅度调整，而债券收益率也转为震荡下行。在这种宏观背景下，国内股票市场也呈现出了与之一致的走势，一季度沪深 300 指数下跌 3.28%，而创业板指上涨 8.43%。行业上与经济相关的周期类行业表现较差，而新兴产业整体涨幅靠前。从投资策略来看，本产品依据对宏观变化的判断，在配置上做出了预先调整。展望二季度，从整体上来看，今年股票投资的不确定性要高于去年，但目前一些股票估值仍然处于合理区间，具备长期投资价值。我们仍然坚持价值投资理念，注重自下而上精选个股。主要关注估值合理、基本面稳健的消费类价值股；业绩高增长、估值合理的细分子行业的成长龙头；以及一些行业处于底部，有望出现反转的优质行业龙头公司。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 3 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.0668 元，份额累计净值为 1.1068 元，C 类份额净值为 1.0582 元，份额累计净值为 1.0982 元，Z 类份额净值为 1.0672 元，份额累计净值为 1.0872 元。报告期内 A 类份额净值增长率为 3.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.72%，C 类份额净值增长率为 3.20%，同期业绩比较基准收益率为 0.72%，Z 类份额净值增长率为 3.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.72%。

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 | 96,014,370.73 | 9.21 |
| | 其中：股票 | 96,014,370.73 | 9.21 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 904,232,448.60 | 86.71 |
| | 其中：债券 | 904,232,448.60 | 86.71 |
| | 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 | 23,911,526.70 | 2.29 |
| 8 | 其他资产 | 18,623,041.36 | 1.79 |
| 9 | 合计 | 1,042,781,387.39 | 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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,079,000.00 | 0.23 |
| B | 采矿业 | 5,808,000.00 | 0.63 |
| C | 制造业 | 45,958,953.00 | 4.98 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 14,873,180.93 | 1.61 |
| E | 建筑业 | 2,598,000.00 | 0.28 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,184,000.00 | 0.56 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,984,036.80 | 0.86 |
| J | 金融业 | 11,529,200.00 | 1.25 |
| 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 | - | - |
| 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 | 96,014,370.73 | 10.40 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 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 | 600011 | 华能国际 | 1,279,939 | 8,793,180.93 | 0.95 |
| 2 | 600066 | 宇通客车 | 350,000 | 7,826,000.00 | 0.85 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 450,000 | 7,510,500.00 | 0.81 |
| 4 | 600027 | 华电国际 | 1,600,000 | 6,080,000.00 | 0.66 |
| 5 | 600547 | 山东黄金 | 200,000 | 5,808,000.00 | 0.63 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 200,000 | 5,698,000.00 | 0.62 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 7 | 002470 | 金正大 | 500,000 | 4,325,000.00 | 0.47 |
| 8 | 300408 | 三环集团 | 160,000 | 3,860,800.00 | 0.42 |
| 9 | 300036 | 超图软件 | 180,000 | 3,738,600.00 | 0.40 |
| 10 | 600029 | 南方航空 | 350,000 | 3,643,500.00 | 0.39 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 5,001,000.00 | 0.54 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 152,782,500.00 | 16.54 |
| | 其中：政策性金融债 | 79,012,000.00 | 8.56 |
| 4 | 企业债券 | 494,615,278.00 | 53.56 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,012,000.00 | 1.08 |
| 6 | 中期票据 | 30,171,000.00 | 3.27 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 211,650,670.60 | 22.92 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 904,232,448.60 | 97.91 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 180201 | 18 国开 01 | 500,000 | 50,065,000.00 | 5.42 |
| 2 | 143081 | 17 长电 01 | 400,000 | 39,560,000.00 | 4.28 |
| 3 | 136367 | 16 国君 G1 | 300,000 | 29,424,000.00 | 3.19 |
| 4 | 136830 | 16 中信 G1 | 300,000 | 29,298,000.00 | 3.17 |
| 5 | 136501 | 16 天风 01 | 300,000 | 29,292,000.00 | 3.17 |

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

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

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

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金对国债期货的投资以套期保值，回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债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) | 风险指标说明 |
|-------------------|----------|----------|---------------|--------------|--------------|
| 0T1806 | 10年期国债期货 | 100 | 93,730,000.00 | 1,492,850.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | 1,000,214.71 |
| 国债期货投资本期收益(元) | | | | | -392,264.71 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | 1,000,214.71 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期国债期货投资在一定程度上对冲了利率波动的风险，符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金持有的 16 中信 G1 (代码：136830) 发行主体中信证券股份有限公司 (以下简称“公司”) 2017 年 05 月 25 日公告，因公司未按照规定为司度 (上海) 贸易有限公司提供融资融券服务，收到中国证券监督管理委员会的《行政处罚事先告知书》(2017 第 57 号)，拟决定对公司采取责令改正，给予警告，没收违法所得人民币 61,655,849.78 元，并处以人民币 308,279,248.90 元罚款的行政监管措施。

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九名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,849,924.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 14,007,590.54 |
| 5 | 应收申购款 | 1,765,526.56 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 18,623,041.36 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1 | 132006 | 16 皖新 EB | 24,787,500.00 | 2.68 |
| 2 | 132004 | 15 国盛 EB | 13,137,929.70 | 1.42 |
| 3 | 128010 | 顺昌转债 | 3,673,939.50 | 0.40 |
| 4 | 110032 | 三一转债 | 3,455,400.00 | 0.37 |
| 5 | 132007 | 16 凤凰 EB | 2,831,118.90 | 0.31 |
| 6 | 120001 | 16 以岭 EB | 2,462,156.80 | 0.27 |

5.10.5 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未存在流通受限情况。

5.10.6 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 | 东方红汇阳债券 A | 东方红汇阳债券 C | 东方红汇阳债券 Z |
|-------------------------------|----------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 414,935,325.90 | 202,481,973.15 | 13,694,285.45 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 225,301,567.32 | 52,002,708.39 | 69,898,236.95 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 53,017,979.71 | 52,804,835.79 | 5,235,149.46 |
| 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 | 587,218,913.51 | 201,679,845.75 | 78,357,372.94 |

注：

本基金管理人于 2017 年 8 月 28 日发布公告《关于东方红汇阳债券型证券投资基金增加基金份额类别的公告》，决定自 2017 年 8 月 29 日增加 Z 类基金份额类别（代码：005008）。

§ 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

本报告期，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 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

本基金本报告期单一投资者持有基金份额比例无达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§ 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汇阳债券型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红汇阳债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红汇阳债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红汇阳债券型证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 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：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 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

2018 年 4 月 23 日