

---

# 东方红货币市场基金 2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 14 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 2021 年 1 月 12 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。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东方红货币
基金主代码	005056
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 25 日
报告期末基金份额总额	11,930,832,568.99 份
投资目标	在本金安全的前提下，确保基金资产的高流动性，追求超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较	当期银行活期存款利率（税后）

基准					
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。				
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司				
基金托管人	中国工商银行股份有限公司				
下属分级基金的基金简称	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 C	东方红货币 D	东方红货币 E
下属分级基金的交易代码	005056	005057	007864	007865	005058
报告期末下属分级基金的份额总额	31,617,473.85份	9,192,970,005.38份	2,572,566,635.14份	112,331,038.51份	21,347,416.11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（2020年10月1日-2020年12月31日）				
	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 C	东方红货币 D	东方红货币 E
1. 本期已实现收益	193,616.08	66,953,118.30	16,765,672.22	419,064.44	165,907.88
2. 本期利润	193,616.08	66,953,118.30	16,765,672.22	419,064.44	165,907.88
3. 期末基金资产净值	31,617,473.85	9,192,970,005.38	2,572,566,635.14	112,331,038.51	21,347,416.11

注：（1）东方红货币 A、东方红货币 B、东方红货币 C、货币 D 与东方红货币 E 适用不同的销售服务费率。

（2）本基金收益分配为按日结转份额。

（3）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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5842%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.4960%	0.0008%
过去六个月	1.0653%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	0.8889%	0.0010%
过去一年	2.0370%	0.0011%	0.3510%	0.0000%	1.6860%	0.0011%
过去三年	7.9692%	0.0022%	1.0510%	0.0000%	6.9182%	0.0022%
自基金合同生效起至今	9.4573%	0.0024%	1.1747%	0.0000%	8.2826%	0.0024%

东方红货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6451%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.5569%	0.0008%
过去六个月	1.1875%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	1.0111%	0.0010%
过去一年	2.2826%	0.0011%	0.3510%	0.0000%	1.9316%	0.0011%
过去三年	8.7495%	0.0022%	1.0510%	0.0000%	7.6985%	0.0022%
自基金合同生效起至今	10.3413%	0.0024%	1.1747%	0.0000%	9.1666%	0.0024%

东方红货币 C

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5845%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.4963%	0.0008%
过去六个月	1.0654%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	0.8890%	0.0010%
过去一年	2.0375%	0.0011%	0.3510%	0.0000%	1.6865%	0.0011%
自基金合同生效起至今	2.7903%	0.0011%	0.4641%	0.0000%	2.3262%	0.0011%

东方红货币 D

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6226%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.5344%	0.0008%
过去六个月	1.1423%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	0.9659%	0.0010%
自基金合同生效起至今	1.4488%	0.0011%	0.2388%	0.0000%	1.2100%	0.0011%

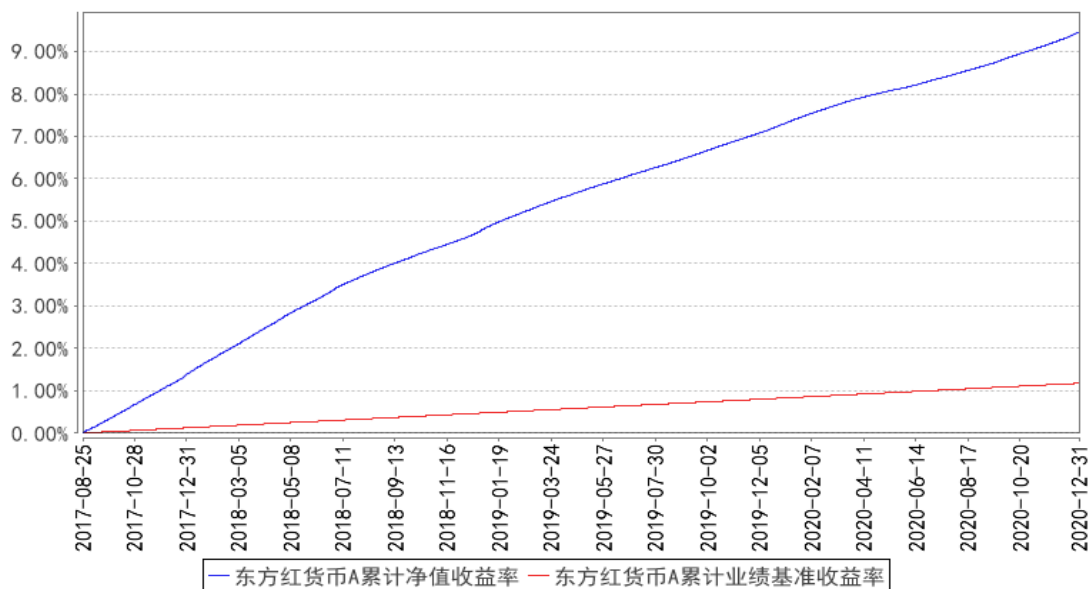
东方红货币 E

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6222%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.5340%	0.0008%
过去六个月	1.1415%	0.0010%	0.1764%	0.0000%	0.9651%	0.0010%
过去一年	2.1903%	0.0011%	0.3510%	0.0000%	1.8393%	0.0011%
过去三年	8.4560%	0.0022%	1.0510%	0.0000%	7.4050%	0.0022%
自基金合同生效起至今	10.0092%	0.0024%	1.1747%	0.0000%	8.8345%	0.0024%

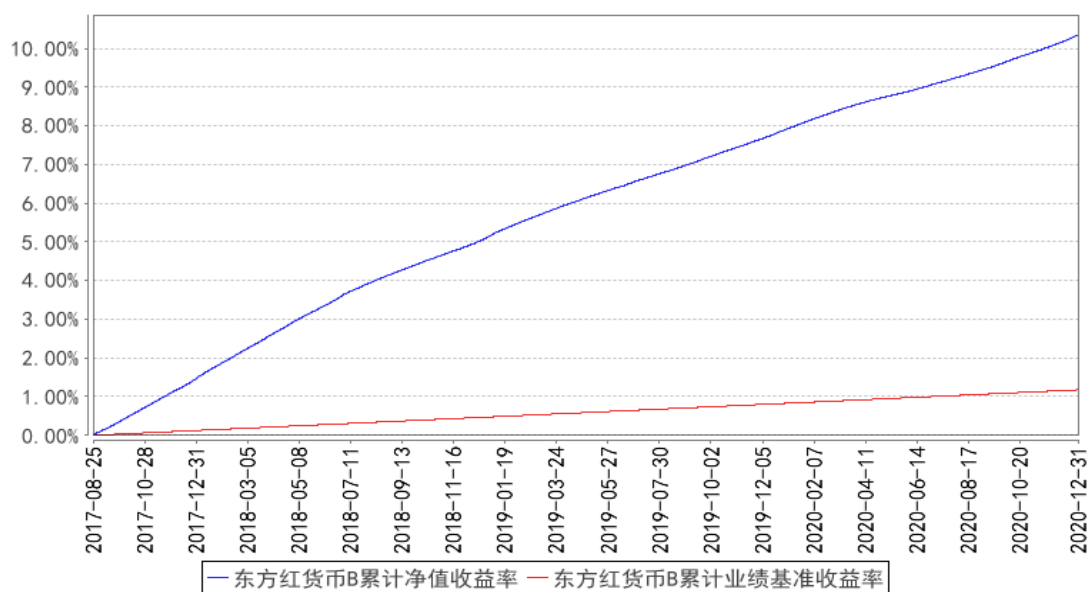
注：本基金收益分配按日结转份额。

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

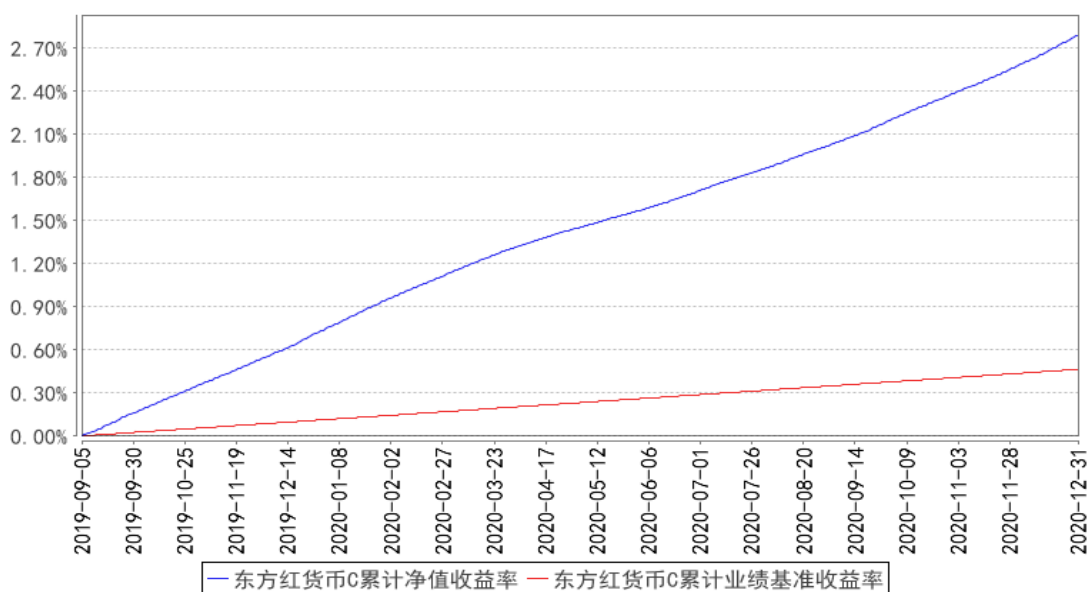
东方红货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



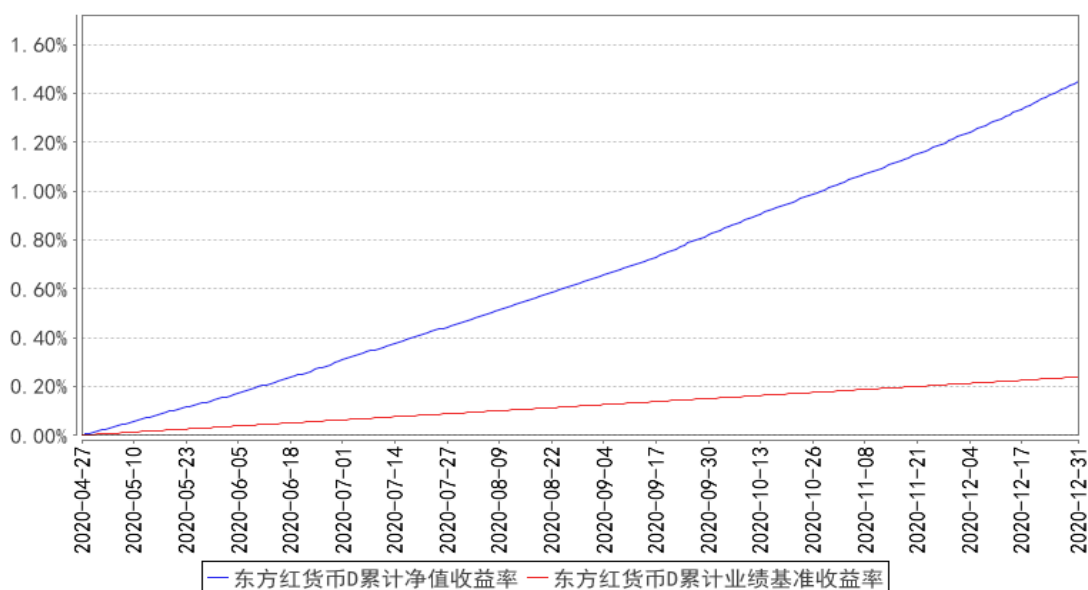
东方红货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



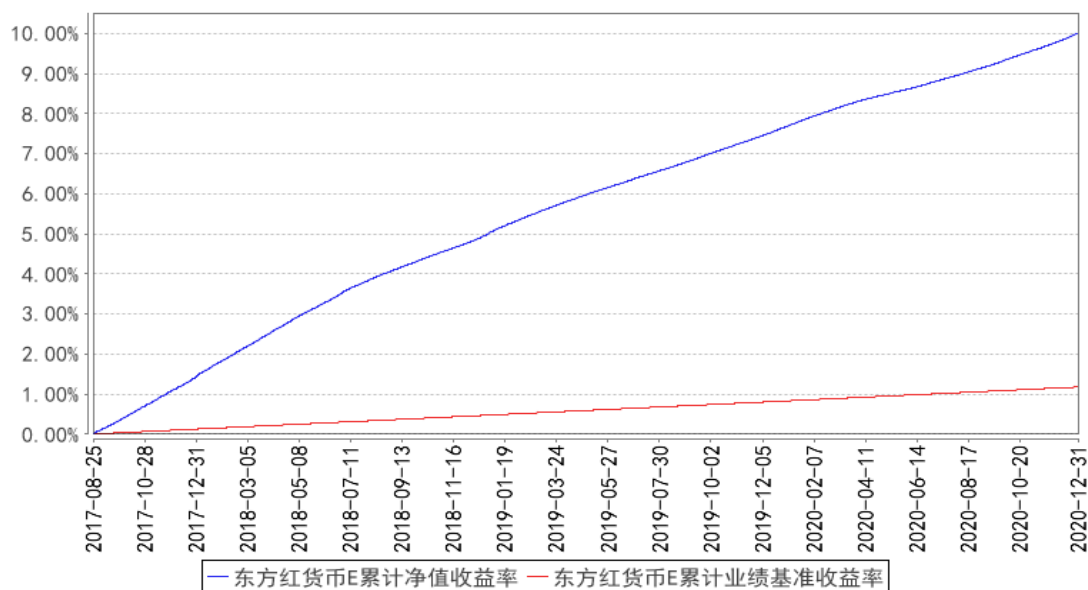
东方红货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红货币D累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红货币E累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：截止日期为 2020 年 12 月 31 日。

## § 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		
高德勇	上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益	2020年5月11日	-	13年	上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理、2020年05月至今任东方红货币市场基金基金经理。南京大学理学学士。曾任上海农商银行金融市场部货币市场科负责人、国泰君安证券股

	投资部副 总经理、 本基金基 金经理				份有限公司资金同业部金融同业总监、华鑫证券销售交易部部门总经理。具备证券投资基金从业资格。
丁锐	本基金基 金经理	2018 年 11 月 23 日	-	8 年	2018 年 11 月至今任东方红货币市场基金基金经理、2020 年 07 月至今任东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、2020 年 08 月至今任东方红优质甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 09 月至今任东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。牛津大学理学硕士。曾任交通银行股份有限公司资产管理业务中心投资经理，交银施罗德基金管理有限公司专户投资部投资经理助理，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助理。具备证券投资基金从业资格。
李燕	本基金基 金经理	2017 年 10 月 25 日	-	19 年	2017 年 10 月至今任东方红货币市场基金基金经理。东北财经大学金融学硕士。曾任国信证券股份有限公司电子商务部职员，富国基金管理有限公司运营部基金会计、基金会计主管、总监助理、副总监，上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部业务总监。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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

2020 年四季度虽然海外疫情有所恶化，国内仍有零星疫情出现，国内经济基本面依然进一步好转。在海外需求及他国供应不足的带动下，尽管人民币持续升值，出口同比依旧超预期增长；投资方面，虽基建投资增速低于预期，但制造业投资持续好转，地产投资增速维持较高水平；消费需求继续恢复，但同比增速依旧偏弱。受食品价格及基数影响，四季度 CPI 同比明显回落，PPI 虽逐月回升，但仍未转正。随着经济基本面的好转，货币政策逐步回归常态，央行主要通过 OMO+MLF 向市场投放流动性，货币市场利率呈先上后下走势，前半季度在银行压降结构性存款、财政投放时间错位、利率债发行等因素影响下，银行超储率偏低，资金面整体较为紧张，同业存单发行利率不断攀升并明显高于 MLF 利率，后半季度受永煤债券违约、人民币快速升值等因素影响，央行加大流动性投放力度，稳定市场预期，货币市场利率快速、明显下行，年末资金面始终保持超预期的宽松状态。

操作上，本报告期内，本基金在做好流动性管理的前提下，充分把握货币市场利率的波动，灵活调整组合杠杆水平，并在关键时点拉长组合久期，为投资者获取了较为稳健的回报。

展望 2021 年一季度，剔除基数影响的各项经济指标预计将继续改善。受益于海外疫苗接种后需求改善，出口有望保持进一步改善态势；内需方面，固定资产投资在制造业和地产建安投资带动下，有望继续回升；同时消费在经济和就业的改善下将进一步修复；但就经济政策而言，尚需观察经济增长是否能回归潜在增速并持续。通胀方面，虽然大宗商品价格上涨明显，一季度 PPI 同比可能转正，冬季寒冷及春节影响，CPI 环比可能有所回升，但两者预计依然将处于低位，通胀短期难以对政策造成掣肘。同时，一季度海外疫情依然难以得到全面控制，全球货币宽松预计持续，人民币汇率仍将处于上升通道。因此，一季度货币政策预计仍将保持稳定，资金面整体仍将维持较为宽松的状态，货币市场利率围绕公开市场操作利率波动。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 类的基金份额净值收益率为 0.5842%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；

B 类的基金份额净值收益率为 0.6451%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；E 类的基金份额净值收益率为 0.6222%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；C 类的基金份额净值收益率为 0.5845%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%；D 类的基金份额净值收益率为 0.6226%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

#### 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	固定收益投资	6,161,959,462.81	50.53
	其中：债券	6,141,959,462.81	50.37
	资产支持证券	20,000,000.00	0.16
2	买入返售金融资产	3,467,129,612.01	28.43
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	2,531,425,858.58	20.76
4	其他资产	34,377,888.03	0.28
5	合计	12,194,892,821.43	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	3.88	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值 比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	246,339,356.19	2.06
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	33.46	2.17
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	27.25	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	27.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	102.03	2.17

### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	79,064,117.07	0.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	569,806,417.35	4.78
	其中：政策性金融债	569,806,417.35	4.78
4	企业债券	12,017,968.93	0.10
5	企业短期融资券	938,715,142.18	7.87

6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,542,355,817.28	38.07
8	其他	-	-
9	合计	6,141,959,462.81	51.48
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112015573	20 民生银行 CD573	2,000,000	194,264,464.69	1.63
2	112009030	20 浦发银行 CD030	1,500,000	149,603,454.47	1.25
3	200308	20 进出 08	1,400,000	139,751,383.42	1.17
4	012004145	20 光明 SCP007	1,000,000	99,922,739.28	0.84
5	112015504	20 民生银行 CD504	1,000,000	99,751,197.36	0.84
6	112003078	20 农业银行 CD078	1,000,000	99,738,401.76	0.84
7	112003076	20 农业银行 CD076	1,000,000	99,735,637.16	0.84
8	112010472	20 兴业银行 CD472	1,000,000	99,686,271.38	0.84
9	112015093	20 民生银行 CD093	1,000,000	99,534,919.67	0.83
10	112086910	20 徽商银行 CD071	1,000,000	99,533,859.71	0.83

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0488%
报告期内偏离度的最低值	0.0066%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0161%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 5.8 报告期末按摊余成本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	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	168208	兴港 2A	200,000	20,000,000.00	0.17

### 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑买入时的溢价和折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

### 5.9.2 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

本基金持有的 20 浦发银行 CD030（代码：112009030）的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司因同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；延迟支付同业投资资金吸收存款；为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保等违法违规行为，于 2020 年 8 月 10 日被上海银保监局责令改正并处罚款共计 2100 万元。

本基金持有的 20 民生银行 CD573（代码：112015573）、20 民生银行 CD504（代码：112015504）、20 民生银行 CD093（代码：112015093）的发行主体中国民生银行股份有限公司因违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资；为“四证”不全的房地产项目提供融资等 30 项违法违规行为，于 2020 年 7 月 14 日被中国银保监会处没收违法所得 296.47 万元，罚款 10486.47 万元，罚没合计 10782.94 万元。

本基金持有的 20 农业银行 CD078（代码：112003078）、20 农业银行 CD076（代码：112003076）发行主体中国农业银行股份有限公司因可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、部分可回溯视频质检结果未反馈给保险公司、可回溯资料不符合监管规定等行为，于 2020 年 3 月 9 日被银保监会处以罚款 50 万元；因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在资金交易信息漏报严重、信贷资产转让业务漏报、贸易融资业务漏报等 6 项违法违规行为，于 2020 年 4 月 22 日被银保监会处以罚款 230 万元；因“两会一层”境外机构管理履职不到位，国别风险管理不满足监管要求，信贷资金被挪用作保证金，未将集团成员纳入集团客户统一授信管理，于 2020 年 4 月 22 日被银保监会处以罚款 200 万元；因向关系人发放信用贷款、批量处置不良资产未公告、批量处置不良资产未向监管部门报告等 24 项违法违规行为，于 2020 年 7 月 13 日被银保监会没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元；因收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费），于 2020 年 12 月 7 日被银保监会处没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元。

本基金持有的 20 兴业银行 CD472（代码：112010472）的发行主体兴业银行股份有限公司因同业投资用途不合规等七项违法违规行为，于 2020 年 8 月 31 日被中国银保监会福建监管局没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元；因无证机构提供转接清算服务，

且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定等五项违法违规行为于 2020 年 9 月 4 日受到中国人民银行福州中心支行的警告处分，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处罚款 13,824,431.23 元。

本基金持有的 20 徽商银行 CD071（代码：112086910）的发行主体徽商银行股份有限公司因同业业务专营部门管理不到位、信贷资产非真实转让等违法违规行为，于 2020 年 9 月 30 日被安徽银保监局罚款 290 万元；因贷备案类账户开立未及时备案、个人银行账户开立未备案等违法违规行为，于 2020 年 8 月 7 日被中国人民银行合肥中心支行警告，并处罚款 49.5 万元。

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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,042.94
2	应收证券清算款	12,213,472.88
3	应收利息	22,135,247.23
4	应收申购款	27,124.98
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	34,377,888.03

### 5.9.4 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	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 C	东方红货币 D	东方红货币 E
报告期	40,893,380.00	8,751,371,356.50	2,431,036,604.21	36,138,194.72	38,873,857.55

初基金 份额总 额					
报告 期期 间基 金总 申购 份额	63,400,804.6 9	12,018,907,740.8 1	15,304,426,587.4 8	374,682,487.7 2	12,775,923.4 3
报告 期期 间基 金总 赎回 份额	72,676,710.8 4	11,577,309,091.9 3	15,162,896,556.5 5	298,489,643.9 3	30,302,364.8 7
报告 期期 末基 金份 额总 额	31,617,473.8 5	9,192,970,005.38	2,572,566,635.14	112,331,038.5 1	21,347,416.1 1

--	--	--	--	--	--

## § 7 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：本基金本报告期内无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、中国证监会批准设立东方红货币市场基金的文件；
- 2、《东方红货币市场基金基金合同》；
- 3、《东方红货币市场基金托管协议》；
- 4、东方红货币市场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  
2021 年 1 月 14 日