

---

# 东方红货币市场基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 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：2021 年 7 月 8 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 7 月 6 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 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	11,862,292,832.72 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	30,838,448.10份	8,023,166,468.55份	3,401,167,215.70份	391,798,644.21份	15,322,056.16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（2021年4月1日-2021年6月30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	174,242.66	65,767,563.12	18,890,344.99	2,648,787.90	96,941.57
2. 本期利润	174,242.66	65,767,563.12	18,890,344.99	2,648,787.90	96,941.57
3. 期末基金资产净值	30,838,448.10	8,023,166,468.55	3,401,167,215.70	391,798,644.21	15,322,056.16

注：（1）东方红货币 A、东方红货币 B、东方红货币 C、东方红货币 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	0.5315%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.4442%	0.0005%
过去六个月	1.0935%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	0.9199%	0.0006%
过去一年	2.1704%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	1.8204%	0.0008%
过去三年	7.0255%	0.0013%	1.0510%	0.0000%	5.9745%	0.0013%
自基金合同生效起至今	10.6542%	0.0023%	1.3482%	0.0000%	9.3060%	0.0023%

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	0.5920%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.5047%	0.0005%
过去六个月	1.2140%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	1.0404%	0.0006%
过去一年	2.4159%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	2.0659%	0.0008%
过去三年	7.7997%	0.0013%	1.0510%	0.0000%	6.7487%	0.0013%
自基金合同生效起至今	11.6808%	0.0023%	1.3482%	0.0000%	10.3326%	0.0023%

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	0.5318%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.4445%	0.0005%
过去六个月	1.0938%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	0.9202%	0.0006%
过去一年	2.1709%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	1.8209%	0.0008%
自基金合同生效起至今	3.9146%	0.0010%	0.6377%	0.0000%	3.2769%	0.0010%

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	0.5694%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.4821%	0.0005%
过去六个月	1.1691%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	0.9955%	0.0006%
过去一年	2.3247%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	1.9747%	0.0008%
自基金合同生效起至今	2.6348%	0.0010%	0.4123%	0.0000%	2.2225%	0.0010%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

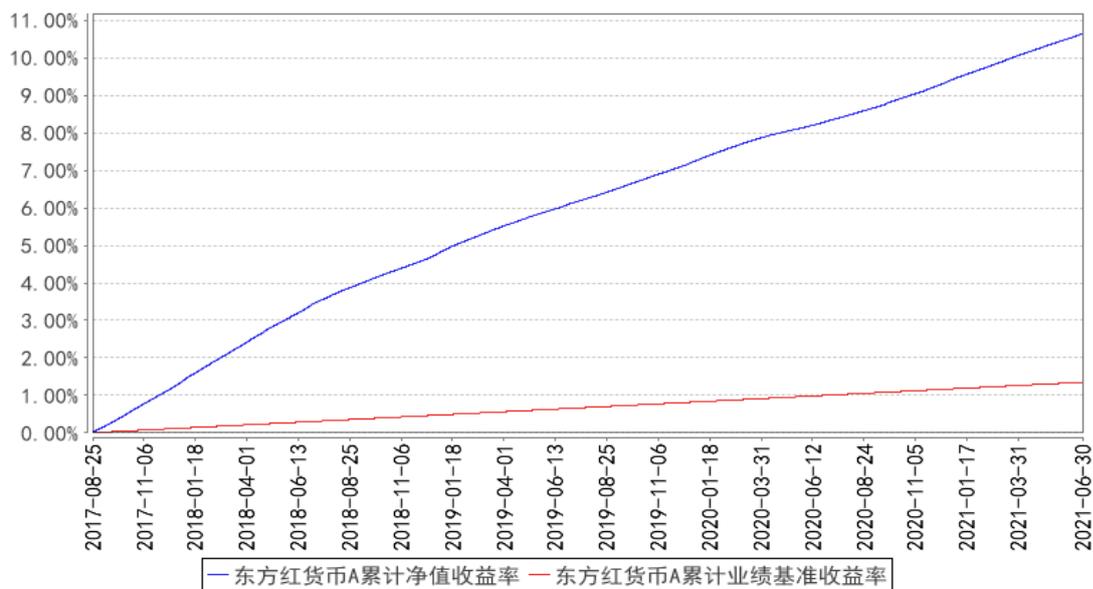
东方红货币 E

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	0.5694%	0.0005%	0.0873%	0.0000%	0.4821%	0.0005%
过去六个月	1.1688%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	0.9952%	0.0006%
过去一年	2.3236%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	1.9736%	0.0008%
过去三年	7.5085%	0.0013%	1.0510%	0.0000%	6.4575%	0.0013%
自基金合同生效起至今	11.2949%	0.0023%	1.3482%	0.0000%	9.9467%	0.0023%

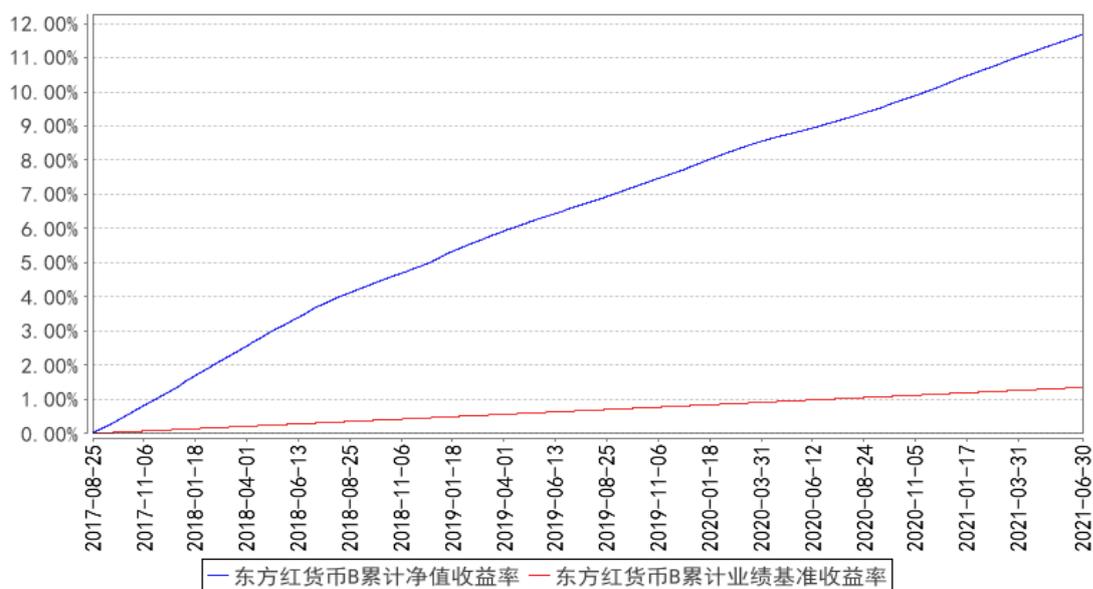
注：本基金收益分配按日结转份额。

### 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

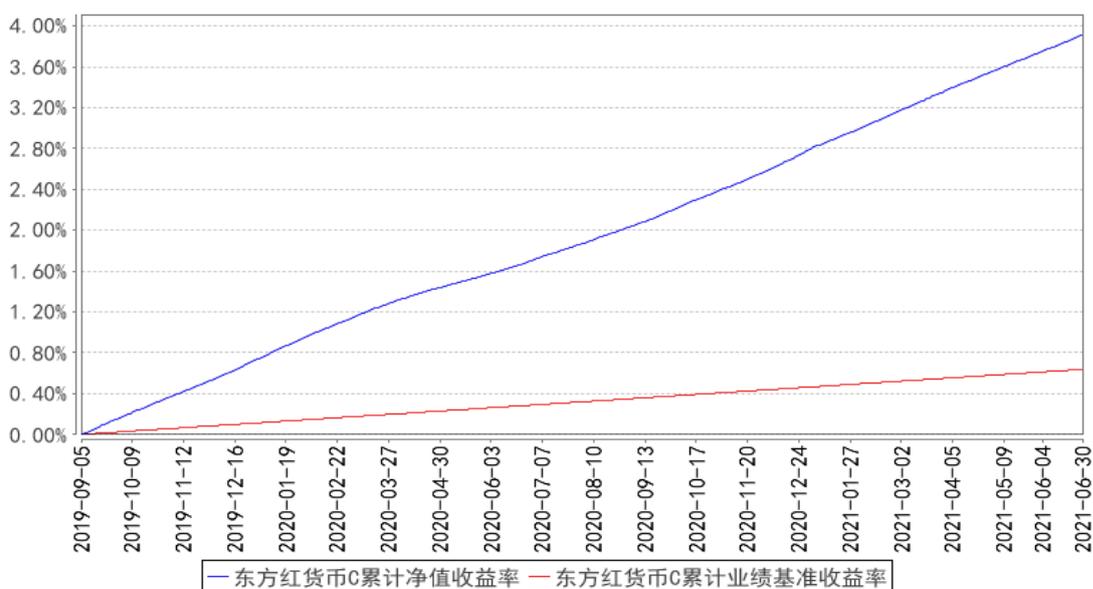
东方红货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



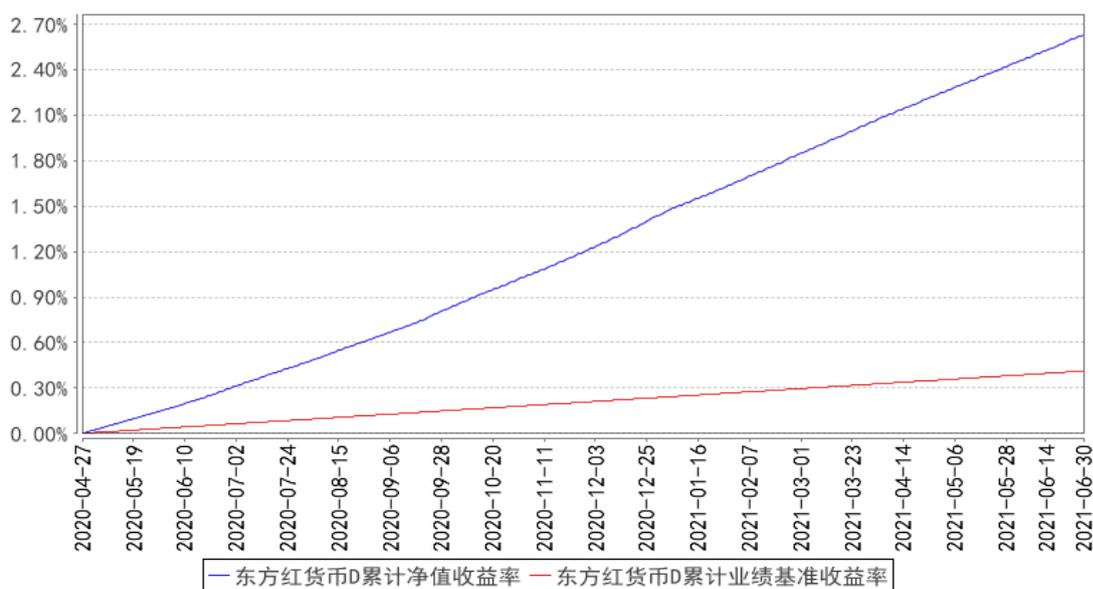
东方红货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



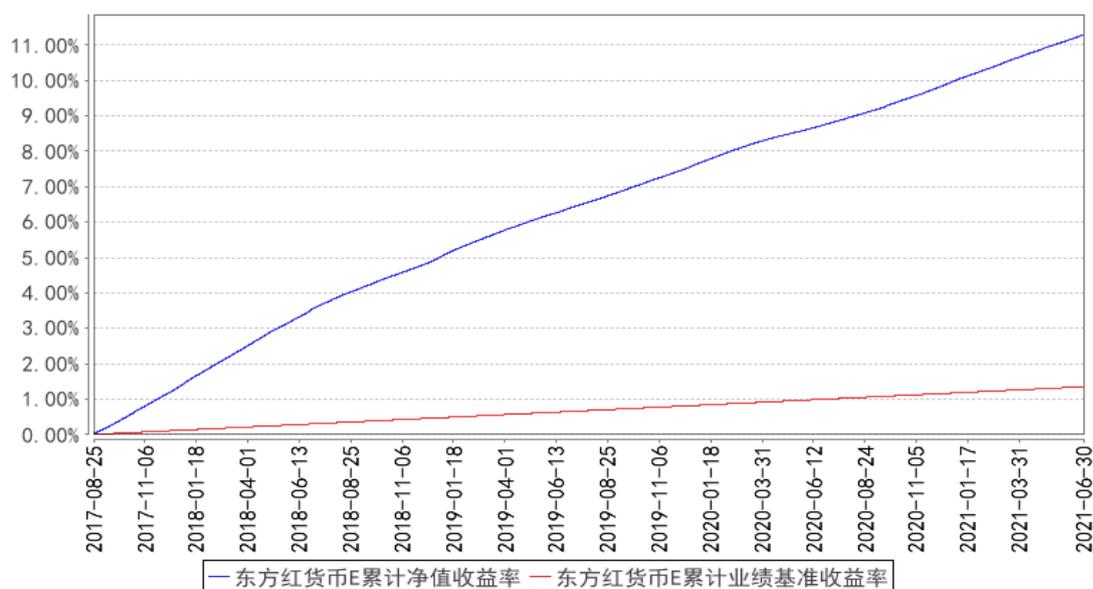
东方红货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



## § 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		
李燕	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2017年10月25日	-	20年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，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。
丁锐	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2018 年 11 月 23 日	-	8 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，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投资经理助理。具备证券投资基金从业资格。
高德勇	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2020 年 5 月 11 日	-	13 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2020 年 05 月至今任东方红货币市场基金基金经理、2021 年 01 月至今任东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年二季度，国内经济延续复苏格局，但复苏斜率较一季度边际放缓。工业生产及出口延续强劲增长，地产投资韧性较强，消费继续稳步修复。但是由于收入，尤其是中低收入群体并未完全修复，消费修复依然低于预期。二季度通胀问题受到市场较大关注，全球经济复苏、供需失衡的背景下，大宗商品价格大幅攀升，叠加基数原因，PPI 同比逐月抬升至 9%的高位；同时非食品价格上涨导致 CPI 同比也有所上行，但受猪肉价格下跌的影响，CPI 同比依然维持在较低位置。但央行认为 PPI 的上行是主要是短期的、输入性因素造成的，国内不存在长期通胀的基础，因此，二季度货币政策依然保持稳健，但资金面的平稳状态超出市场预期，货币市场利率围绕政策利率窄幅波动，仅季末略显收紧，短端利率较一季度有所下行。

操作上，本报告期内，本基金操作较为稳健，整体久期及杠杆维持中性偏低水平，资金面较为平稳的情况下，在做好流动性管理的基础上，资产端采取相对匀速的配置策略，为投资者获取了较为稳健的回报。

展望三季度，随着主要经济体疫苗接种比例的提升，全球经济将逐步正常化，国内经济预计将延续平稳修复态势，但复苏动能可能进一步减弱。投资增速有下行压力，高企的原材料价格对制造业投资将产生负面影响；优质项目不足、非传统基建领域对专项债资金的分流，将对基建投资反弹构成压力；地产投资韧性虽强，但受房贷政策收紧、集中供地政策等影响，存在边际走弱的可能。海外工业生产逐步恢复，同时服务将替代商品成为后续海外消费修复的主力，导致出口可能边际走弱。制约消费复苏的收入等因素依然存在，消费复苏依然面临阻力。通胀方面，供需失衡格局短期难以改善，PPI 同比预计仍将维持较高水平；猪肉价格可能还有下跌空间，且三季度 CPI 基数有所抬升，CPI 预计将继续低位运行。另外，三季度须密切关注美联储有关货币政策正常化的进程表述。因此，考虑经济增长、通胀、海外三方面因素，预计三季度货币政策将继续保持稳健，进一步收紧和放松的概率均较低，但政府债发行提速等因素可能对资金面造成扰动，导致资金面的波动恐有所加大。

#### 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 0.5315%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%；B 类的基金份额净值收益率为 0.5920%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%；E 类的基金份额净值收益率为 0.5694%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%；C 类的基金份额净值收益率为 0.5318%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%；D 类的基金份额净值收益率为 0.5694%，同期业绩比较基准收益率为 0.0873%。

#### 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	6,101,681,482.85	47.67
	其中：债券	6,101,681,482.85	47.67
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,663,830,090.89	20.81
	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	3,800,146,751.28	29.69
4	其他资产	234,160,400.64	1.83
5	合计	12,799,818,725.66	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	1.50	
	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	932,038,933.97	7.86
	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	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

#### 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	32.44	7.86
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	11.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	29.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	21.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.93	7.86

#### 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限超过 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	681,231,869.30	5.74
	其中：政策性金融债	681,231,869.30	5.74

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1, 230, 206, 742. 64	10. 37
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4, 190, 242, 870. 91	35. 32
8	其他	-	-
9	合计	6, 101, 681, 482. 85	51. 44
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	112198383	21 宁波银行 CD092	2, 000, 000	199, 702, 030. 18	1. 68
2	112182646	21 宁波银行 CD158	2, 000, 000	198, 937, 873. 95	1. 68
3	112115090	21 民生银行 CD090	1, 500, 000	149, 051, 357. 22	1. 26
4	200314	20 进出 14	1, 200, 000	120, 183, 601. 47	1. 01
5	180212	18 国开 12	1, 100, 000	110, 318, 105. 93	0. 93
6	112109212	21 浦发银行 CD212	1, 100, 000	109, 370, 905. 80	0. 92
7	200216	20 国开 16	1, 000, 000	100, 050, 933. 96	0. 84
8	112182883	21 徽商银行 CD082	1, 000, 000	99, 863, 219. 87	0. 84
9	112006167	20 交通银行 CD167	1, 000, 000	99, 661, 341. 88	0. 84
10	112010339	20 兴业银行 CD339	1, 000, 000	99, 659, 830. 90	0. 84

### 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	0.0353%
报告期内偏离度的最低值	0.0154%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0275%

#### 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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 21 浦发银行 CD212（代码：112109212）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；因 2016 年 5 月至 2019 年 1 月未按规定开展代销业务，于 2021 年 4 月 23 日被上海银保监局责令改正，并处罚款共计 760 万元。

本基金持有的 20 兴业银行 CD339（代码：112010339）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；因资金营运中心 2017 年 7 月至 2019 年 6 月间黄金租赁业务严重违反审慎经营规则于 2020 年 8 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正，并处罚款人民币 50 万元。因为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 21 民生银行 CD090（代码：112115090）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 18 国开 12（代码：180212）、20 国开 16（代码：200216）的发行主体国家开发银行因为违规的政府购买服务项目提供融资、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况等 24 项违法违规行为，于 2020 年 12 月 25 日被中国银保监会处罚款 4880 万元；因违规开展外汇交易、违反银行交易记录管理规定，于 2020 年 11 月 10 日被国家外汇管理局北京外汇管理部分别处以 60 万元罚款。

本基金持有的 21 徽商银行 CD082（代码：112182883）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。

本基金持有的 21 宁波银行 CD158（代码：112182646）、21 宁波银行 CD092（代码：112198383）的发行主体宁波银行股份有限公司因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位于 2020 年 10 月 16 日被宁波银保监局处以罚款人民币 30 万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分；因代理销售保险不规范于 2021 年 6 月 10 日被宁波银保监局处以罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分

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	应收证券清算款	7,024.39
3	应收利息	34,084,516.78
4	应收申购款	200,068,859.47
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	234,160,400.64

### 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	45,714,166.38	9,891,191,542.23	3,283,415,773.02	362,820,867.92	17,474,589.71

期初基金份额总额					
报告期期间基金总申购份额	40,284,838.61	6,428,890,253.85	17,413,684,704.89	2,321,391,343.92	4,362,834.65
报告期期间基金总赎回份额	55,160,556.89	8,296,915,327.53	17,295,933,262.21	2,292,413,567.63	6,515,368.20
报告期末基金份额总额	30,838,448.10	8,023,166,468.55	3,401,167,215.70	391,798,644.21	15,322,056.16

额					
---	--	--	--	--	--

## § 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、中国证监会准予注册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 7 月 8 日