

# 东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金

## 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 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。

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	东方红战略精选混合
基金主代码	003044
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 8 月 30 日
报告期末基金份额总额	3,028,808,293.22 份
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略，在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+沪深 300 指数收益率×10%。
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。本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交

	易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方红战略精选混合 A	东方红战略精选混合 C
下属分级基金的交易代码	003044	003045
报告期末下属分级基金的份额总额	2,611,183,262.77 份	417,625,030.45 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）	
	东方红战略精选混合 A	东方红战略精选混合 C
1. 本期已实现收益	28,050,412.69	4,814,282.38
2. 本期利润	51,879,802.92	9,156,635.76
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0258	0.0228
4. 期末基金资产净值	3,411,966,377.93	534,948,542.02
5. 期末基金份额净值	1.3067	1.2809

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 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

东方红战略精选混合 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	1.92%	0.12%	0.91%	0.17%	1.01%	-0.05%

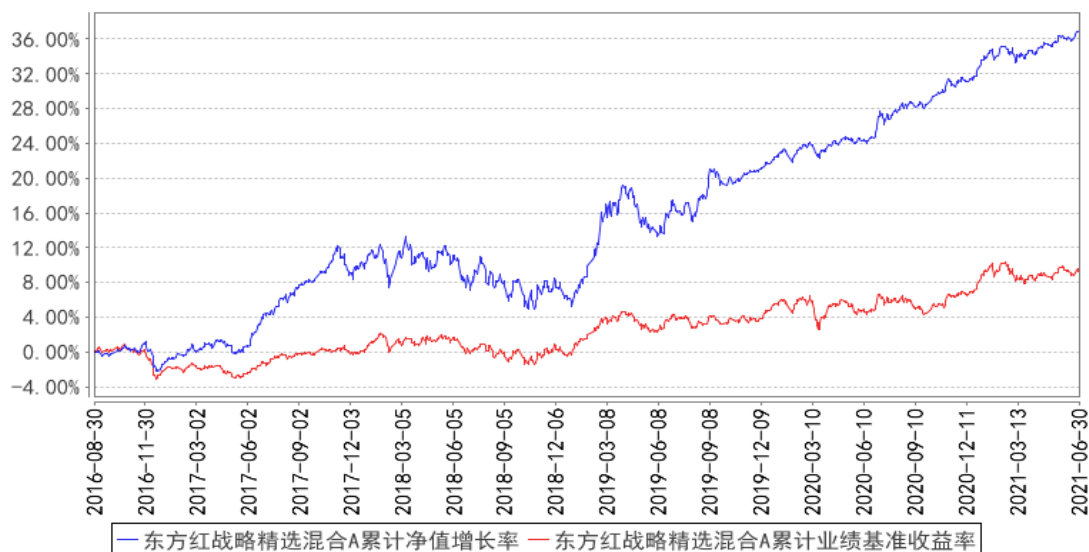
过去六个月	3.31%	0.17%	1.28%	0.23%	2.03%	-0.06%
过去一年	9.81%	0.18%	4.17%	0.22%	5.64%	-0.04%
过去三年	25.95%	0.33%	8.94%	0.23%	17.01%	0.10%
自基金合同生效起至今	36.99%	0.33%	9.35%	0.21%	27.64%	0.12%

东方红战略精选混合 C

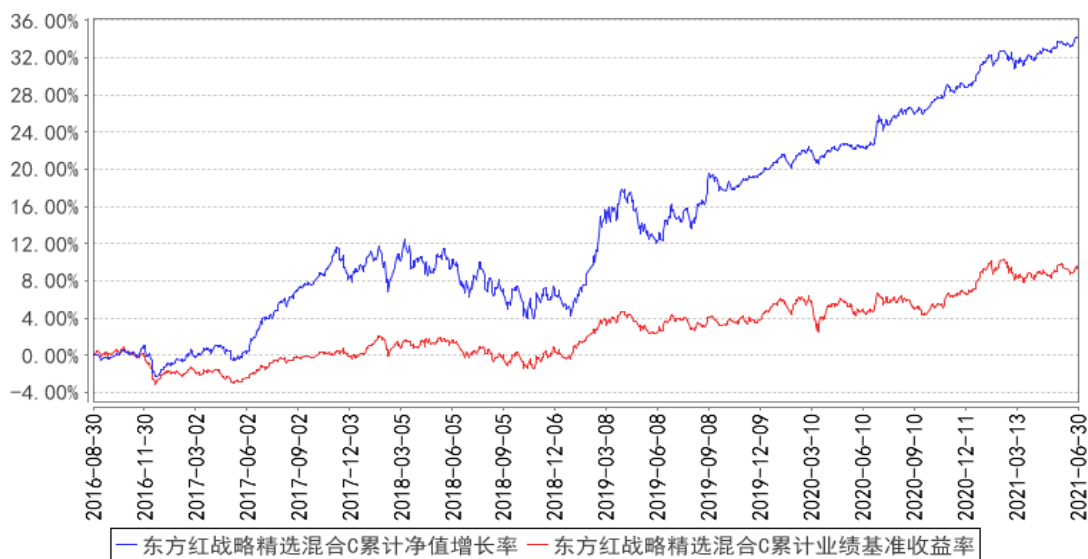
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.81%	0.12%	0.91%	0.17%	0.90%	-0.05%
过去六个月	3.11%	0.17%	1.28%	0.23%	1.83%	-0.06%
过去一年	9.37%	0.18%	4.17%	0.22%	5.20%	-0.04%
过去三年	24.44%	0.33%	8.94%	0.23%	15.50%	0.10%
自基金合同生效起至今	34.32%	0.33%	9.35%	0.21%	24.97%	0.12%

### 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

东方红战略精选混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红战略精选混合C累计净值增长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		
纪文静	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2016年8月30日	-	14年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2015年07月至今任东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2015年07月至今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、2015年07月至今任东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理、2015年07月至2017年09月任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2015年10月至今任东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(原东方红纯债债券型发起式证券投资基金)基金经理、2015年11月至今任东方红收益增强债券型证券投资基金基金经理、2015年11月至今任东方红信用债债券型证券投资基金基金经理、2016年05月至今任东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、2016年05月至2017年08月任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2016年06月至2017年08月任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016年08月至今任东方红战略

					<p>精选沪港深混合型证券投资基金基金经理、2016 年 09 月至今任东方红价值精选混合型证券投资基金基金经理、2016 年 11 月至今任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、2017 年 04 月至今任东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至 2018 年 11 月任东方红货币市场基金基金经理。江苏大学经济学硕士。曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理，德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理。具备证券投资基金从业资格。</p>
胡伟	上海东方证券资产管理有限公司总经理助理、董事总经理兼任公募固定收益投资部总经理及固定收益研究部总经理、基金经理	2020 年 5 月 13 日	-	16 年	<p>上海东方证券资产管理有限公司总经理助理、董事总经理，兼任公募固定收益投资部总经理及固定收益研究部总经理，基金经理，2020 年 05 月至今任东方红收益增强债券型证券投资基金基金经理、2020 年 05 月至今任东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金经理、2020 年 06 月至今任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 06 月至今任东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 09 月至今任东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、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。中南财经政法大学经济学学士。曾任珠海市商业银行资金营运部债券交易员，华富基金管理有限公司债券交易员，固定收益部基金经理、副总监、总监，总经理助理。具备证券投资基金从业资格。</p>

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

## 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

权益方面，二季度市场有所反弹，结构性分化较大，上证综指二季度上涨 4.34%，创业板指上涨 26.05%。宏观环境上，大宗商品价格继续上涨，通胀水平超出市场预期。但整体上市场并没有太明显的反应，投资者更多还是相信复苏和通胀是脉冲式的，而非趋势性的。展望未来，市场的估值水平或仍将分化，我们仍将寻找有业绩支撑的优质公司。鉴于目前的资产各类估值水平，本产品一方面仍然主要配置于一些估值水平处于历史低位、股息回报率已经较高的大盘蓝筹公司；另一方面一些成长性行业的估值水平有所回落，本产品也会坚持价值投资理念，从中选择一些估值合理的优秀新兴行业公司进行配置。

转债方面，二季度随着权益市场的上涨，转债市场有所回暖，二季度中证转债指数上涨 4.45%。一季度转债市场波动较大，本产品增持了部分转债价格较为低估的品种。二季度一些转债品种估值逐渐修复，还有一部分转债绝对价格水平也逐渐满足换股条件，为本产品贡献了一定的收益。目前转债市场仍在扩容过程中，整体新券水平仍然处在相对合理的区间，本产品仍然坚持绝对收益的投资思路，结合公司本身的资质以及转债的估值定价水平，精选一些优质转债进行配置。

债券方面，二季度资金面维持了超预期的宽松，虽然经济指标整体表现良好、PPI 数据不断

走高，债券收益率仍然出现了一波下行，十年国债一度下行至 3.04%。6 月开始，资金面受到半年末因素的扰动，债券市场有所调整，十年国债最终收于 3.08%。展望三季度，债券收益率或仍维持震荡走势。一方面通胀高位的持续性或不确定，另一方面地方债三季度供给放量，再叠加美联储退出宽松的预期增强，都可能成为市场的扰动因素。国常会提出的降准，更多还是针对经济修复不均衡的问题，总的货币环境仍然是维持稳定。因此票息仍然是组合的收益来源。组合操作上仍以配置优质信用债、参与利率债交易为主，关注波动中的配置及交易机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金 A 类份额净值为 1.3067 元, 份额累计净值为 1.3567 元; C 类份额净值为 1.2809 元, 份额累计净值为 1.3309 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 1.92%, 同期业绩比较基准收益率为 0.91%;C 类份额净值增长率为 1.81%, 同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

#### 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	457,704,397.69	11.43
	其中: 股票	457,704,397.69	11.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,370,109,294.90	84.18
	其中: 债券	3,368,158,294.90	84.13
	资产支持证券	1,951,000.00	0.05
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	80,000,160.00	2.00
	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	17,494,230.17	0.44
8	其他资产	78,013,927.13	1.95
9	合计	4,003,322,009.89	100.00

注: 1、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 63,625,320.95 元人民币, 占期末基金资产净值比例 1.61%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。



## 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	4,698,681.00	0.12
C	制造业	283,193,623.76	7.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.13
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.00
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	30,477.64	0.00
J	金融业	86,060,023.68	2.18
K	房地产业	14,276,476.00	0.36
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	483,080.50	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	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	394,079,076.74	9.98

### 5.2.2 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（人民币）	占基金资产净值比例（%）
00 能源	10,308,740.20	0.26
01 原材料	0.00	0.00
02 工业	0.00	0.00
03 可选消费	20,983,266.41	0.53
04 主要消费	8,438,299.20	0.21
05 医药卫生	0.00	0.00
06 金融地产	0.00	0.00
07 信息技术	9,335,777.46	0.24
08 电信业务	9,894,114.48	0.25
09 公用事业	4,665,123.20	0.12
合计	63,625,320.95	1.61

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 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	002415	海康威视	375,026	24,189,177.00	0.61
2	300122	智飞生物	126,500	23,621,345.00	0.60
3	002475	立讯精密	495,000	22,770,000.00	0.58
4	002304	洋河股份	95,800	19,849,760.00	0.50
5	300750	宁德时代	33,900	18,129,720.00	0.46
6	600031	三一重工	600,100	17,444,907.00	0.44
7	600887	伊利股份	472,952	17,418,822.16	0.44
8	601166	兴业银行	845,580	17,376,669.00	0.44
9	002459	晶澳科技	351,500	17,223,500.00	0.44
10	601012	隆基股份	184,100	16,355,444.00	0.41

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 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	234,406,000.00	5.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	723,407,900.00	18.33
	其中：政策性金融债	281,688,000.00	7.14
4	企业债券	981,826,792.00	24.88
5	企业短期融资券	470,654,000.00	11.92
6	中期票据	130,920,000.00	3.32
7	可转债（可交换债）	244,175,602.90	6.19
8	同业存单	582,768,000.00	14.77
9	其他	-	-
10	合计	3,368,158,294.90	85.34

#### 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	042100225	21 电网 CP004	1,200,000	120,024,000.00	3.04
2	112823	19 深投 02	1,100,000	110,561,000.00	2.80

3	190203	19 国开 03	1,000,000	100,780,000.00	2.55
4	042100183	21 电网 CP001	1,000,000	100,170,000.00	2.54
5	112103017	21 农业银行 CD017	1,000,000	97,120,000.00	2.46

### 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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值 比例（%）
1	061605001	16 沪公积金 1A	100,000	1,951,000.00	0.05

### 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

注：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

注：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股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行股指期货投资。

#### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

## 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资。

## 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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

本基金持有的兴业银行（代码：601166）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 19 国开 03（代码：190203 IB）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。

本基金持有的中信转债（代码：113021 SH）发行主体中信银行股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务、保存客户身份资料和交易记录、报送大额交易报告和可疑交易报告，以及与身份不明的客户进行交易的行为于 2021 年 2 月 5 日被中国人民银行罚款 2890 万元。

本基金持有的 21 农业银行 CD017（代码：112103017 IB）发行主体中国农业银行股份有限公司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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	132,616.29
2	应收证券清算款	6,686,341.34
3	应收股利	1,178,672.00
4	应收利息	38,138,926.54
5	应收申购款	31,877,370.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,013,927.13

### 5.11.4 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	113021	中信转债	86,567,400.00	2.19
2	132015	18 中油 EB	34,643,322.50	0.88
3	110053	苏银转债	26,699,200.00	0.68
4	113037	紫银转债	9,286,331.70	0.24
5	113033	利群转债	5,713,404.00	0.14
6	132014	18 中化 EB	5,203,568.40	0.13
7	128107	交科转债	4,885,200.00	0.12
8	110045	海澜转债	4,465,200.00	0.11
9	127020	中金转债	4,388,000.00	0.11
10	110073	国投转债	4,308,400.00	0.11
11	132007	16 凤凰 EB	2,895,435.00	0.07
12	110063	鹰 19 转债	2,359,800.00	0.06
13	132017	19 新钢 EB	1,476,079.00	0.04

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 5.11.6 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	东方红战略精选混合 A	东方红战略精选混合 C
报告期期初基金份额总额	1,642,087,493.92	378,256,880.98
报告期期间基金总申购份额	1,132,046,629.11	134,738,176.97
减：报告期期间基金总赎回份额	162,950,860.26	95,370,027.50
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	2,611,183,262.77	417,625,030.45

## § 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

注：本报告期，本基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 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：本基金本报告期内未发生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战略精选沪港深混合型证券投资基金的文件；

- 2、《东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红战略精选沪港深混合型证券投资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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 7 月 21 日