

东方红核心优选一年定期开放混合型证券  
投资基金  
2022 年第 1 季度报告

2022 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 4 月 22 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 2022 年 4 月 20 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。

本基金于 2020 年 10 月 23 日增加 C 类份额并开放申购，本报告中本基金 C 类份额“基金合同生效日”特指 2020 年 10 月 23 日，C 类份额的首日基金份额净值同当日 A 类份额的基金份额净值，为 1.1602。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东方红核心优选定开混合
基金主代码	006353
基金运作方式	契约型，定期开放式，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式
基金合同生效日	2018 年 10 月 9 日
报告期末基金份额总额	1,226,820,061.96 份
投资目标	本基金在严格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。
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	沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×80%。

风险收益特征	<p>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。</p> <p>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。</p>	
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	东方红核心优选定开混合 A	东方红核心优选定开混合 C
下属分级基金的交易代码	006353	010292
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 128, 494, 280. 69 份	98, 325, 781. 27 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（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日）	
	东方红核心优选定开混合 A	东方红核心优选定开混合 C
1. 本期已实现收益	7, 958, 300. 37	600, 802. 98
2. 本期利润	-18, 561, 263. 39	-1, 700, 451. 01
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0164	-0. 0173
4. 期末基金资产净值	1, 387, 182, 553. 42	120, 338, 504. 14
5. 期末基金份额净值	1. 2292	1. 2239

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

东方红核心优选定开混合 A

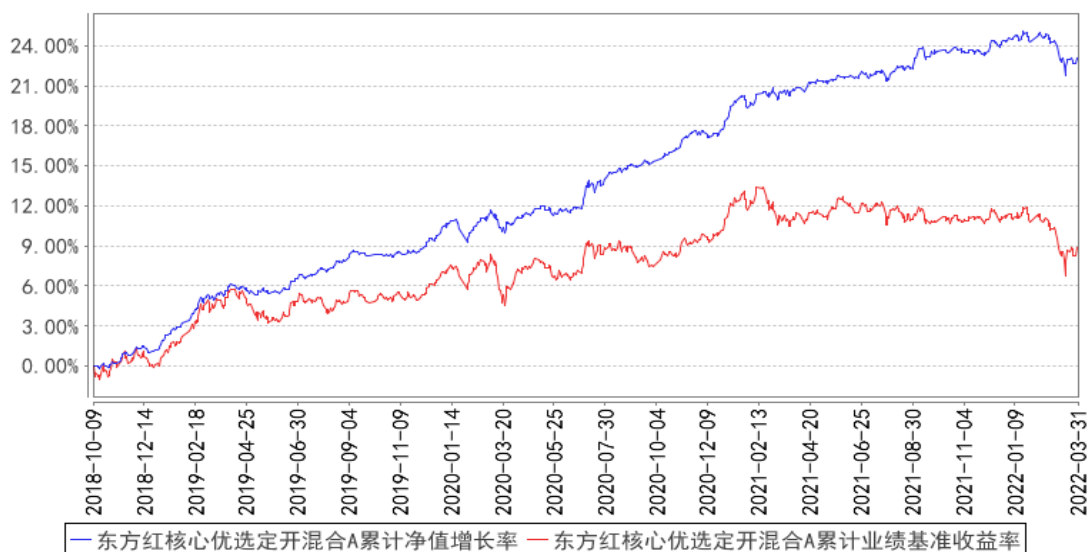
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.32%	0.20%	-2.42%	0.33%	1.10%	-0.13%
过去六个月	-0.50%	0.16%	-1.93%	0.25%	1.43%	-0.09%
过去一年	1.86%	0.14%	-2.04%	0.23%	3.90%	-0.09%
过去三年	16.37%	0.14%	3.37%	0.24%	13.00%	-0.10%
自基金合同生效起至今	22.92%	0.14%	8.74%	0.24%	14.18%	-0.10%

东方红核心优选定开混合 C

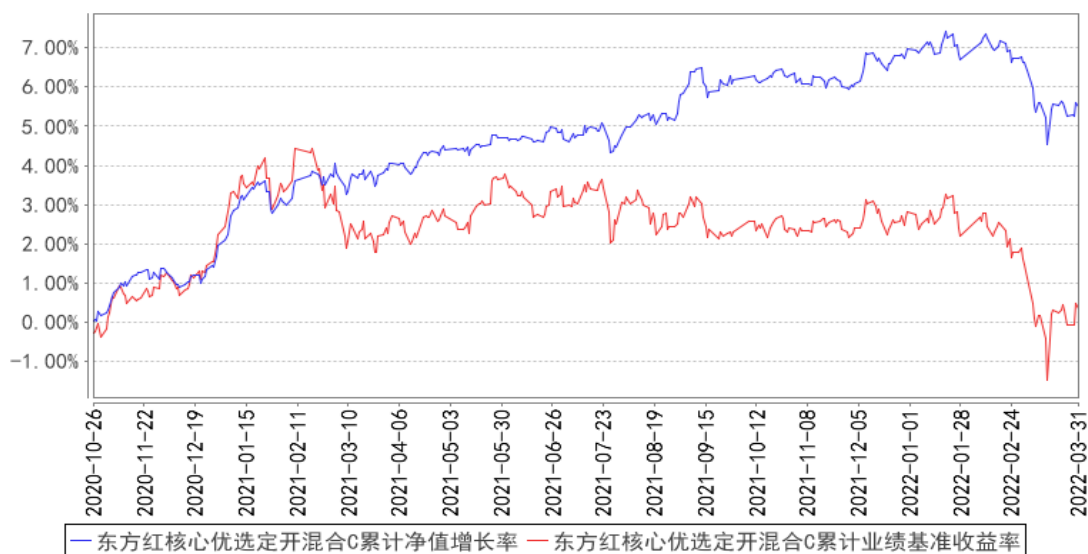
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.39%	0.20%	-2.42%	0.33%	1.03%	-0.13%
过去六个月	-0.64%	0.16%	-1.93%	0.25%	1.29%	-0.09%
过去一年	1.55%	0.14%	-2.04%	0.23%	3.59%	-0.09%
自基金合同生效（2020年10月23日）起至今	5.49%	0.14%	0.17%	0.24%	5.32%	-0.10%

### 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

东方红核心优选定开混合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



东方红核心优选定开混合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		
徐觅	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2018年10月9日	-	14年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2016年12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08月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2017年08月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、

				<p>2017 年 09 月至今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、2017 年 09 月至 2020 年 05 月任东方红货币市场基金基金经理、2018 年 03 月至今任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、2018 年 05 月至今任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018 年 10 月至今任东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至今任东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 07 月至今任东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金经理。复旦大学工商管理硕士。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投资经理。具备证券投资基金从业资格。</p>	
王佳骏	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2019 年 8 月 16 日	-	6 年	<p>上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2019 年 08 月至今任东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至今任东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 02 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 03 月至今任东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 07 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、2021 年 05 月至今任东方红锦和甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 03 月至今任东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。帝国理工学院金融学硕士。曾任国信证券股份有限公司助理分析师，上海东方证券资产管理有限公司投资支持高级经理。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

债券方面，在去年底的中央经济工作会议定调稳经济的基调下，开年伊始央行就宣布下调 LPR 基准利率积极配合，流动性保持合理充裕。房住不炒的政策方针下，稳增长的重要抓手基建开始发力，各地陆续宣布开工投资一批重点项目，按月公布的信贷和社融数据也都保持了波动上行的态势，宽货币向宽信用的传导初见成效。综合考虑稳增长的长期目标和流动性的短期充裕，组合在上年末增配了 2-3Y 期限投资级的信用债，并提高杠杆水平，随着降息落地陆续止盈。展望未来，我们将维持投资级信用债配置为主的策略，以获取票息为目的，关注和评估行业调整带来的风险和机会，随着收益率水平的调整适度拉长久期和提高杠杆，努力为持有人获取长期、稳健的回报。

股票方面，在国内地产销售疲软、疫情反复、海外地缘政治冲突和美联储加息等多重因素影响下，2022 年 1 季度权益市场表现不佳，沪深 300 指数下跌 14.5%，创业板指下跌 20%，仅红利

指数收涨，当季上涨 7.2%。报告期内，随着市场的调整，主要股指的估值均回落至历史中值附近，宏观经济边际上也有所变化，例如社融增速触底回升、多个城市放松地产限购政策等，因此组合的权益仓位水平相较于 2021 年 4 季度有所上升。结构上，相较于 2021 年 4 季度而言，随着短期估值进一步上行，组合减持了煤炭、电力等板块；另一方面，组合在报告期内增持了一些估值逐步调整至合理区间，同时公司基本面较为优质的公司，主要集中在电子、医药、化工等板块，对于金融、地产、建筑等原有持仓仍然维持配置。

转债方面，受股市调整和转债估值压缩的双重影响，转债市场在 2022 年 1 季度表现不佳，中证转债指数下跌 8.4%。报告期内，尽管转债市场有所调整，但是整体估值水平仍然处于历史偏高区间，因此组合内转债持仓水平依然较低，但我们依旧对转债市场保持关注，积极研究个券的基本面，储备潜在投资品种。

#### 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 1.2292 元， 份额累计净值为 1.2292 元；C 类份额净值为 1.2239 元， 份额累计净值为 1.2239 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-1.32%，同期业绩比较基准收益率为-2.42%；C 类份额净值增长率为-1.39%，同期业绩比较基准收益率为-2.42%。

#### 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	189,369,189.59	8.87
	其中：股票	189,369,189.59	8.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,897,120,514.01	88.81
	其中：债券	1,897,120,514.01	88.81
	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	49,400,304.94	2.31
8	其他资产	148,586.57	0.01
9	合计	2,136,038,595.11	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 26,474,553.21 元人民币，占期末基金资产净值比例 1.76%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	101,116,961.02	6.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,050,642.00	0.27
E	建筑业	11,183,144.00	0.74
F	批发和零售业	46,993.02	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,658,301.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,520,700.66	0.30
J	金融业	20,785,220.70	1.38
K	房地产业	14,600,227.20	0.97
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	166,897.32	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	4,749,797.36	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,752.10	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	162,894,636.38	10.81

### 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（%）
10 能源	5,089,100.00	0.34
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	5,801,250.92	0.38
30 主要消费	-	-

35 医药卫生	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 通信服务	15,584,202.29	1.03
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	26,474,553.21	1.76

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	000002	万科 A	502,968	9,631,837.20	0.64
2	600887	伊利股份	241,840	8,921,477.60	0.59
3	002415	海康威视	199,350	8,173,350.00	0.54
4	601668	中国建筑	1,465,100	7,970,144.00	0.53
5	00700	腾讯控股	26,100	7,920,825.39	0.53
6	601318	中国平安	161,800	7,839,210.00	0.52
7	00941	中国移动	174,500	7,663,376.90	0.51
8	002475	立讯精密	232,900	7,382,930.00	0.49
9	601166	兴业银行	357,100	7,381,257.00	0.49
10	002493	荣盛石化	499,500	7,142,850.00	0.47

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。

### 5.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	582,684,687.95	38.65
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	504,440,324.22	33.46
5	企业短期融资券	384,226,677.26	25.49
6	中期票据	50,893,300.82	3.38
7	可转债（可交换债）	177,897,087.32	11.80
8	同业存单	196,978,436.44	13.07
9	其他	-	-
10	合计	1,897,120,514.01	125.84

### 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	185040	21 兴业 S3	1,000,000	100,834,153.42	6.69
2	149736	21 申证 D5	1,000,000	100,699,632.88	6.68

3	112105229	21 建设银行 CD229	1,000,000	98,507,435.62	6.53
4	112106308	21 交通银行 CD308	1,000,000	98,471,000.82	6.53
5	132015	18 中油 EB	778,470	81,117,384.47	5.38

## 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

注：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

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：本基金本报告期末未进行股指期货投资。

### 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将根据风险管理的原则、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将根据风险管理的原则，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违规办理内保外贷业务、未按规定报送财务会计报告等违法违规行为，被国家外汇管理局福建省分局于 2021 年 7 月 21 日处以责令改正、警告、没收违法所得和罚款共计 300 余万元；因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定被中国人民银行于 2021 年 8 月 13 日罚款 5 万元；因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在十四项违法违规行为，于 2022 年 3 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 350 万元。

本基金持有的腾讯控股（代码：00700）的发行主体腾讯控股有限公司因共计 28 起违法实施经营者集中案件，于 2021 年 4 月 28 日、2021 年 7 月 6 日、2021 年 7 月 24 日、2021 年 11 月 13 日、2021 年 11 月 15 日、2021 年 11 月 16 日、2021 年 11 月 17 日、2021 年 11 月 18 日、2021 年 12 月 31 日被国家市场监管总局处以罚款，单起案件罚款 50 万元。

本基金持有的 21 招证 G6（代码：188481 SH）的发行主体招商证券股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告于 2021 年 5 月 26 日被中国人民银行深圳市中心支行罚款 1,730,000 元。

本基金持有的 21 兴业 S3（代码：185040 SH）发行主体兴业证券股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务于 2021 年 7 月 14 日被中国人民银行福州中心支行处以 43 万元罚款。

本基金持有的 21 交通银行 CD308（代码：112106308 IB）的发行主体交通银行股份有限公司因理财业务和同业业务制度不健全等二十三项违规行为，于 2021 年 7 月 13 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 4100 万元；因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行处以罚款 62 万元；因未按规定办理内存外贷业务、未按规定办理服务贸易项下海运费支出业务等八项违规行为，于 2021 年 10 月 20 日被国家外汇管理局上海市分局给予警告，处罚款 340 万元人民币，没收违法所得 823166.01 元人民币；因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在十五项违法违规行为，于 2022 年 3 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 420 万元。

本基金持有的 21 建设银行 CD229（代码：112105229 IB）的发行主体中国建设银行股份有限公司因占压财政存款或资金、违反账户管理规定的行为于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行处

以警告并处罚款 388 万元；因监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在十七项违法违规行为，于 2022 年 3 月 21 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 470 万元。

本基金持有的 20 银河 G3 (代码：175482 SH) 发行主体中国银河证券股份有限公司因未经著作权人许可通过网络传播其作品于 2021 年 8 月 5 日被北京市文化和旅游局罚款 2000 元并处以警告。

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	148,586.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	148,586.57

### 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	132015	18 中油 EB	81,117,384.47	5.38
2	132009	17 中油 EB	42,017,698.63	2.79
3	113021	中信转债	25,870,489.30	1.72
4	113037	紫银转债	25,377,225.70	1.68
5	113042	上银转债	1,953,507.79	0.13

### 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	东方红核心优选定开混合 A	东方红核心优选定开混合 C
报告期期初基金份额总额	1,128,494,280.69	98,325,781.27
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	1,128,494,280.69	98,325,781.27

## § 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核心优选一年定期开放混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红核心优选一年定期开放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

2022 年 4 月 22 日