

# 东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金

## 2022 年第 4 季度报告

2022 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 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 2023 年 1 月 18 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 2022 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	2,411,596,456.63 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	2,047,324,607.41 份	364,271,849.22 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 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 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	-18,016,252.81	-4,741,772.45
2. 本期利润	5,784,502.73	398,246.67
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0027	0.0008
4. 期末基金资产净值	2,648,474,413.55	459,175,563.26
5. 期末基金份额净值	1.2936	1.2605

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	0.22%	0.21%	1.28%	0.34%	-1.06%	-0.13%

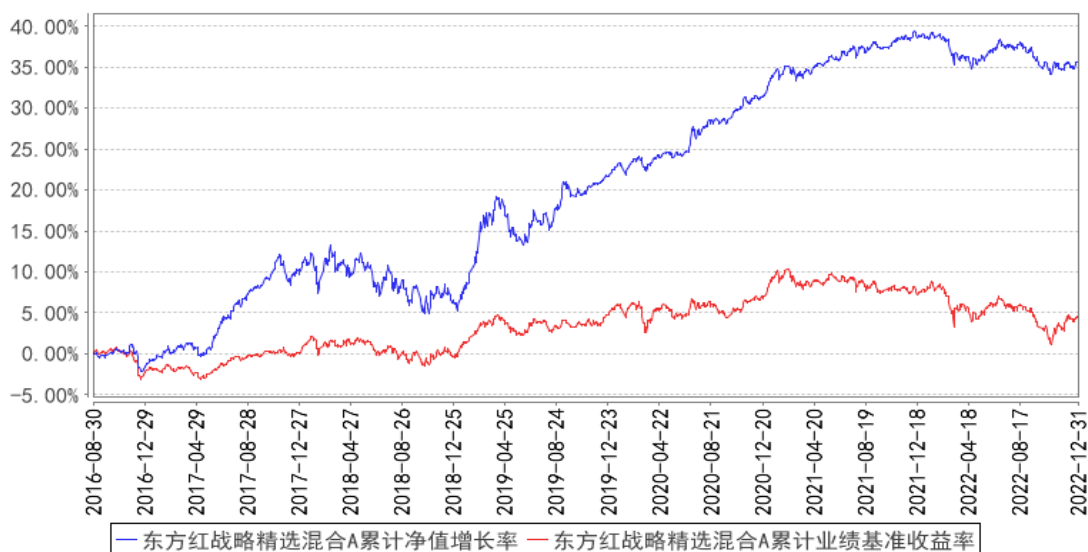
过去六个月	-1.97%	0.18%	-2.08%	0.28%	0.11%	-0.10%
过去一年	-2.44%	0.20%	-3.08%	0.31%	0.64%	-0.11%
过去三年	11.06%	0.18%	-0.75%	0.26%	11.81%	-0.08%
过去五年	23.02%	0.32%	4.31%	0.25%	18.71%	0.07%
自基金合同 生效起至今	35.62%	0.30%	4.55%	0.23%	31.07%	0.07%

东方红战略精选混合 C

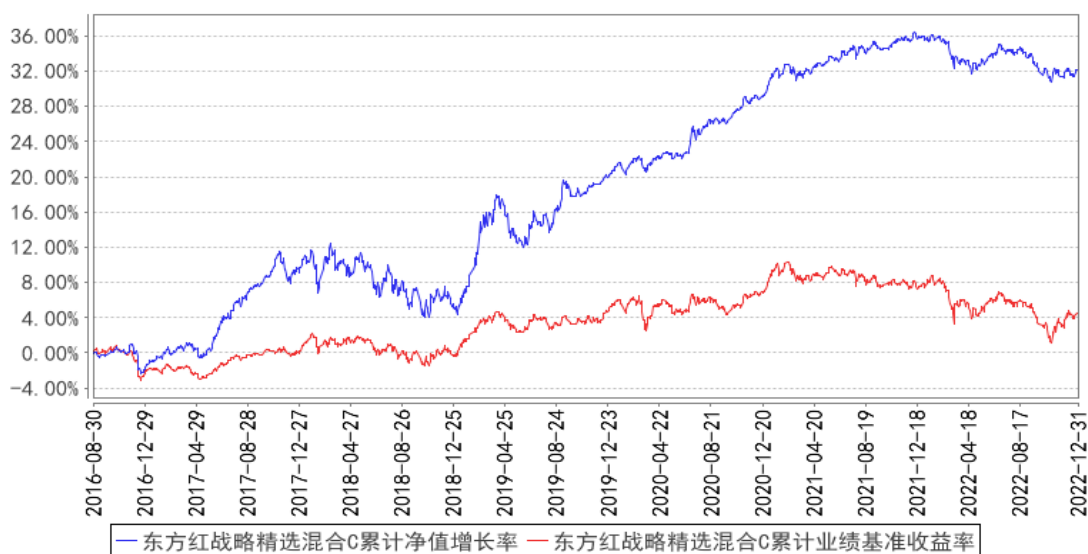
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.13%	0.21%	1.28%	0.34%	-1.15%	-0.13%
过去六个月	-2.17%	0.19%	-2.08%	0.28%	-0.09%	-0.09%
过去一年	-2.83%	0.20%	-3.08%	0.31%	0.25%	-0.11%
过去三年	9.73%	0.18%	-0.75%	0.26%	10.48%	-0.08%
过去五年	20.58%	0.32%	4.31%	0.25%	16.27%	0.07%
自基金合同 生效起至今	32.18%	0.30%	4.55%	0.23%	27.63%	0.07%

### 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公募固定收益投资部总	2016年8月30日	-	15年	上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部总经理、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

	<p>经理、基金经理</p>			<p>07 月至 2022 年 11 月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 2021 年 12 月任东方红 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 2021 年 12 月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>
<p>胡伟</p>	<p>上海东方证券资产管理有限公司副总经理、基金经理</p>	<p>2020 年 5 月 13 日</p>	<p>-</p>	<p>18 年</p> <p>上海东方证券资产管理有限公司副总经理、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、2021 年 07 月至今任 东方红安盈甄选一</p>

					<p>年持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 01 月至今任东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 02 月至今任东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 05 月至今任东方红民享甄选一年持有期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、上海东方证券资产管理有限公司总经理助理。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，四季度上证综指上涨 2.14%，沪深 300 上涨 1.75%，创业板指上涨 2.53%，中证 800 上涨 1.96%。商贸零售、消费者服务、传媒、医药、计算机、非银涨超 10%，而煤炭、电新、石油石化、汽车等跌幅居前。11 月受到地产政策及防疫政策调整的影响，市场对疫后经济复苏的预期升温。11 月初之后汇率也见顶回落，市场情绪较前期明显好转。展望 2023 年一季度，我们认为权益资产仍将有较好的表现，一方面在出口下滑的背景下，扩大内需的必要性进一步提升，政策面持续发力可期；另一方面，疫情防控政策调整之后，随着感染高峰逐步过去，疫情进入平稳期，消费的修复或可期。此外，从企业盈利角度来看，去年受到疫情及经济下行压力等冲击，多数企业盈利表现不佳，后期盈利增速有望修复。再考虑到海外货币政策紧缩的压力将进一步缓解，市场情绪的压制因素进一步解除。同时，前期港股受到国内及海外双重因素影响，下跌幅度较大，随着上述利好因素逐步体现，我们也更看好港股未来的机会。本产品操作上维持了股票资产的配置比例，并增加了港股在组合中的占比，结构上关注处于周期底部、盈利有望改善的中游制造业企业的机会，关注因疫情受损的消费板块修复的机会，以及前期调整较多的一些行业景气度较高的优质公司。

转债方面，四季度中证转债指数下跌 2.48%。转债一方面受到 10 月权益市场进一步下探的影响，另一方面受到 11 月中旬开始的债券市场调整以及 12 月的理财赎回影响，表现相对较弱。转债估值有所压缩，回到了正常偏低的水平，但股票性价比仍然优于转债。本产品操作上后续仍然会对市场保持密切跟踪，关注市场变化，适时精选一些优质转债进行配置，尤其关注估值合理的新上市标的。

债券方面，四季度收益率出现了大幅调整。11 月受到地产政策和疫情防控政策调整的影响，市场对经济的悲观预期有所转变，无风险利率上行，十年国债一度跌至 2.91%。而信用债 12 月受到理财赎回的影响抛售压力较大，调整幅度明显大于利率债，3 年 AAA 跌至 3.56%，调整幅度达 100BP。展望 2023 年一季度，前期交易情绪带来的市场超跌将有所修复。在此基础上，我们认为债券市场短期或维持震荡走势，但需要防止后期调整的压力。一方面，随着疫情平稳之后，经济数据或明显改善，市场将从前期“定价预期”切换到“定价现实”；另一方面需要关注 2023 年 3 月两会召开后稳增长政策的陆续落地给经济带来的正向推动。考虑到货币政策大概率仍然保持稳定宽松，价格中枢较去年虽有所抬升，但目前资产价格相对资金成本仍有息差空间。因此本产品在 12 月市场下跌中，积极增加了配置，获取了超跌修复的收益。后期操作上则以票息策略为主，关注未来市场调整后带来的配置机会。



#### 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 1.2936 元, 份额累计净值为 1.3436 元; C 类份额净值为 1.2605 元, 份额累计净值为 1.3105 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 0.22%, 同期业绩比较基准收益率为 1.28%;C 类份额净值增长率为 0.13%, 同期业绩比较基准收益率为 1.28%。

#### 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	481,313,134.65	12.69
	其中: 股票	481,313,134.65	12.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,186,270,300.03	84.02
	其中: 债券	3,185,434,901.63	84.00
	资产支持证券	835,398.40	0.02
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	1,895,275.63	0.05
8	其他资产	122,876,297.78	3.24
9	合计	3,792,355,008.09	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 90,901,710.69 元人民币, 占期末基金资产净值比例 2.93%。

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	299,371,810.74	9.63

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		-
E	建筑业		-
F	批发和零售业		-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,173,552.00	0.49
H	住宿和餐饮业		-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	483,624.50	0.02
J	金融业	50,722,609.67	1.63
K	房地产业	6,542,900.00	0.21
L	租赁和商务服务业	17,952,093.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	52,566.35	0.00
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	106,663.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合		-
	合计	390,411,423.96	12.56

### 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	-	-
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	44,572,547.64	1.43
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	-	-
40 金融	12,173,286.60	0.39
45 信息技术	-	-
50 通信服务	34,155,876.45	1.10
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	90,901,710.69	2.93

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	600426	华鲁恒升	668,410	22,157,791.50	0.71
2	300059	东方财富	1,073,986	20,835,328.40	0.67
3	002028	思源电气	529,600	20,241,312.00	0.65
4	601100	恒立液压	315,326	19,912,836.90	0.64

5	00700	腾讯控股	62,112	18,531,251.85	0.60
6	603218	日月股份	888,400	18,034,520.00	0.58
7	601888	中国中免	83,100	17,952,093.00	0.58
8	300750	宁德时代	43,800	17,231,796.00	0.55
9	601658	邮储银行	3,667,500	16,943,850.00	0.55
10	002475	立讯精密	529,707	16,818,197.25	0.54

注：对于同时在 A+H 股上市股票，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	98,636,243.09	3.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,185,010,439.48	38.13
	其中：政策性金融债	387,540,482.19	12.47
4	企业债券	933,407,143.34	30.04
5	企业短期融资券	132,410,323.28	4.26
6	中期票据	264,621,810.96	8.52
7	可转债（可交换债）	255,938,543.09	8.24
8	同业存单	315,410,398.39	10.15
9	其他	-	-
10	合计	3,185,434,901.63	102.50

#### 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	210203	21 国开 03	1,000,000	104,778,493.15	3.37
2	152956	21 亦庄 02	1,000,000	101,577,041.10	3.27
3	220208	22 国开 08	1,000,000	101,256,602.74	3.26
4	188813	21 中证 16	1,000,000	100,853,397.26	3.25
5	220216	22 国开 16	1,000,000	99,888,356.16	3.21

#### 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	835,398.40	0.03

#### 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

本基金投资的前十名证券发行主体中，中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚；国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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	130,175.17
2	应收证券清算款	122,630,455.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	115,667.28
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	122,876,297.78

### 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	90,042,110.68	2.90
2	113052	兴业转债	47,559,534.85	1.53
3	113011	光大转债	36,613,931.51	1.18
4	132015	18 中油 EB	35,837,585.98	1.15
5	113037	紫银转债	9,074,455.56	0.29
6	110053	苏银转债	6,185,852.06	0.20
7	127020	中金转债	4,508,679.45	0.15
8	110045	海澜转债	4,377,203.29	0.14
9	113033	利群转债	4,249,309.59	0.14
10	110073	国投转债	4,201,669.04	0.14
11	123096	思创转债	3,967,989.04	0.13
12	127032	苏行转债	3,613,745.11	0.12
13	113641	华友转债	2,213,526.58	0.07
14	113042	上银转债	2,107,308.21	0.07
15	127061	美锦转债	1,064,883.29	0.03

### 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	2,183,544,997.93	522,828,846.14
报告期期间基金总申购份额	1,041,861.09	15,300,112.46
减：报告期期间基金总赎回份额	137,262,251.61	173,857,109.38
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	2,047,324,607.41	364,271,849.22

## § 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、中国证监会准予注册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

2023 年 1 月 20 日