

东方红策略精选灵活配置混合型发起式证
券投资基金
2023 年第 4 季度报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 东方红策略精选混合 |
| 基金主代码 | 001405 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 5 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 719,590,309.23 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。 |
| 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 | 同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率+1.5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，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。 |
| 基金管理人 | 上海东方证券资产管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

| | | |
|-----------------|------------------|------------------|
| 下属分级基金的基金简称 | 东方红策略精选混合 A | 东方红策略精选混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001405 | 001406 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 300,920,385.20 份 | 418,669,924.03 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|----------------|
| | 东方红策略精选混合 A | 东方红策略精选混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | 516,928.94 | -35,167.39 |
| 2. 本期利润 | -5,141,960.94 | -5,814,551.25 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0152 | -0.0127 |
| 4. 期末基金资产净值 | 416,320,290.34 | 537,822,666.08 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.3835 | 1.2846 |

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

东方红策略精选混合 A

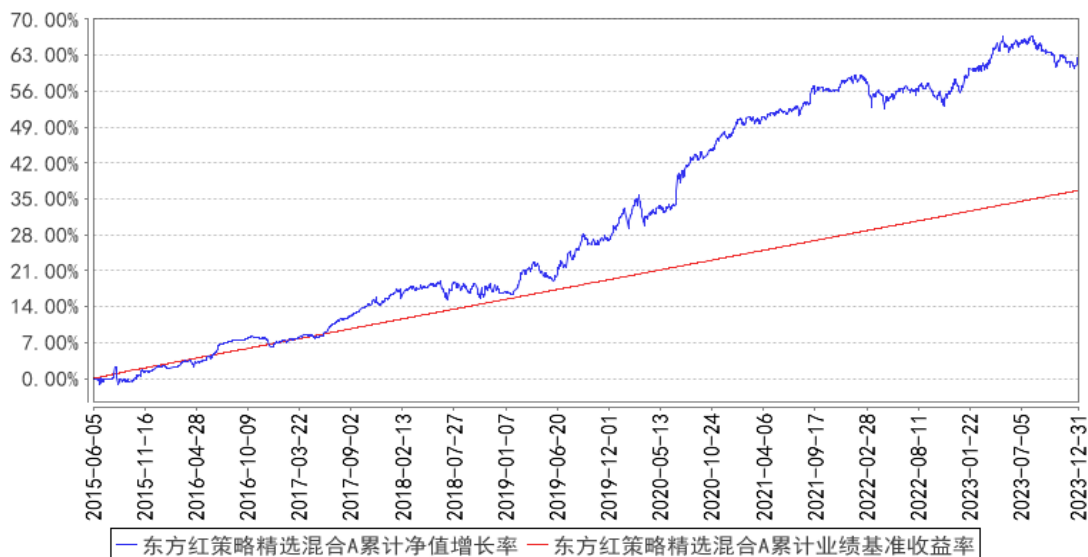
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.62% | 0.22% | 1.07% | 0.01% | -1.69% | 0.21% |
| 过去六个月 | -1.81% | 0.21% | 2.14% | 0.01% | -3.95% | 0.20% |
| 过去一年 | 3.42% | 0.23% | 4.25% | 0.01% | -0.83% | 0.22% |
| 过去三年 | 9.26% | 0.24% | 12.75% | 0.01% | -3.49% | 0.23% |
| 过去五年 | 39.19% | 0.27% | 21.26% | 0.01% | 17.93% | 0.26% |
| 自基金合同生效起至今 | 62.46% | 0.25% | 36.64% | 0.01% | 25.82% | 0.24% |

东方红策略精选混合 C

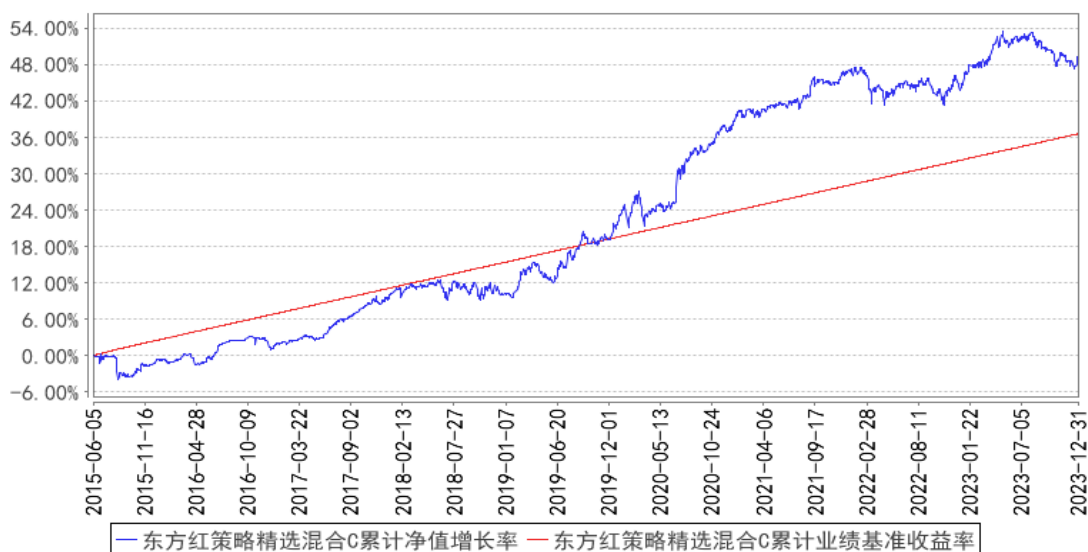
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.75% | 0.22% | 1.07% | 0.01% | -1.82% | 0.21% |
| 过去六个月 | -2.06% | 0.21% | 2.14% | 0.01% | -4.20% | 0.20% |
| 过去一年 | 2.91% | 0.23% | 4.25% | 0.01% | -1.34% | 0.22% |
| 过去三年 | 7.63% | 0.24% | 12.75% | 0.01% | -5.12% | 0.23% |
| 过去五年 | 35.59% | 0.27% | 21.26% | 0.01% | 14.33% | 0.26% |
| 自基金合同生效起至今 | 49.31% | 0.25% | 36.64% | 0.01% | 12.67% | 0.24% |

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

东方红策略精选混合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



东方红策略精选混合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 | | |
| 孔令超 | 上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部总经理、基金经理 | 2016年8月5日 | - | 12年 | 上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部总经理、基金经理，2016年08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、2016年08月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016年08月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、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06月至今任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018年06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、2018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、2019年09月至今任东方红聚利债券型证券投资基金基金经理、2020年01月至2021年12月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。北京大学金融学硕士。曾任平安证券有限责任公司总部综合研究所 |

| | | | | | |
|----|--------------------|-----------|---|-----|--|
| | | | | | 策略研究员,国信证券股份有限公司经济研究所策略研究研究员。具备证券投资基金从业资格。 |
| 徐觅 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理 | 2017年9月5日 | - | 16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2023年04月任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2017年08月至2023年04月任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、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2022年11月任东方红益丰纯债债券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。2023年11月至今任东方红90天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理。2023年12月至今任东方红季鑫90天持有期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。 |

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，本着诚实守信、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

2023 年四季度权益市场表现相对较弱，上证指数下跌 4.36%。四季度市场延续了之前的下跌趋势，但开始出现一些积极信号，包括财政端政策更加积极，以及下半年名义增速企稳下，企业利润开始见底回升。目前市场表现已经隐含了对于 2024 年较为悲观的预期，在这种环境下，我们对于未来的权益市场表现更为乐观，因此在四季度对组合的权益配置比例进行了上调。在行业结构上，过去两年我们一直强调关注两类机会，一类是以金融、电力、运营商等为代表的传统行业龙头，另一类是以传媒计算机为代表的一些成长行业。但展望未来，随着宏观环境的变化以及相关公司估值水平的下降，除了上述两类机会外，我们也会逐渐开始关注以消费、高端制造为代表的一些核心优质公司。

债券方面，2023 年四季度收益率先升后降，10 年国债收益率季初位于 2.66%，中间受增发国债和资金空转的舆论影响两次触及 2.71%高点，后得益于财政资金投放和存款利率下调的利好刺激，最终年末收益率下行至 2.55%的全年低点。本季度中央财政显著发力，增发国债 1 万亿元，赤字率预计从 3%上调至 3.8%左右。货币政策方面，市场年内降准预期一度较高，但央行最终通过加大 MLF 投放的形式投放资金，1.45 万亿的单月发行量和 8000 亿的净投放量均创历史新高，市

场日常流动性整体仍然保持充裕，但月末关键时点发生剧烈波动。受财政资金下拨滞后、年末商业银行资本管理办法落地等短期因素影响，银行同业存单利率持续走高，一度带动收益率曲线走平，国债 10-1 年期限利差创 2020 年以来新低，中短期限债券配置价值凸显。本季度组合维持投资级信用债配置为主的策略，12 月随着资金面转松，将期限 3-5 年的银行二级资本债置换为 1 年内品种，缩短了产品久期至略低于中枢水平。

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 1.3835 元，份额累计净值为 1.5735 元；C 类份额净值为 1.2846 元，份额累计净值为 1.4546 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-0.62%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%；C 类份额净值增长率为-0.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.07%。

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 | 282,651,961.31 | 25.09 |
| | 其中：股票 | 282,651,961.31 | 25.09 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 813,819,672.81 | 72.25 |
| | 其中：债券 | 813,819,672.81 | 72.25 |
| | 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 | 24,756,824.61 | 2.20 |
| 8 | 其他资产 | 5,188,080.48 | 0.46 |
| 9 | 合计 | 1,126,416,539.21 | 100.00 |

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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 | 4,012,000.00 | 0.42 |
| B | 采矿业 | 30,593,260.00 | 3.21 |
| C | 制造业 | 130,691,630.10 | 13.70 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 14,245,000.00 | 1.49 |
| E | 建筑业 | 11,466,160.00 | 1.20 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,981.41 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 44,804,876.05 | 4.70 |
| J | 金融业 | 40,488,500.00 | 4.24 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,993,984.46 | 0.21 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,342,569.29 | 0.46 |
| 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 | 282,651,961.31 | 29.62 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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 | 601658 | 邮储银行 | 4,000,000 | 17,400,000.00 | 1.82 |
| 2 | 688111 | 金山办公 | 50,025 | 15,817,905.00 | 1.66 |
| 3 | 600011 | 华能国际 | 1,850,000 | 14,245,000.00 | 1.49 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 970,000 | 12,086,200.00 | 1.27 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 72,000 | 11,754,720.00 | 1.23 |
| 6 | 002555 | 三七互娱 | 574,900 | 10,813,869.00 | 1.13 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 380,000 | 10,165,000.00 | 1.07 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 230,000 | 9,269,000.00 | 0.97 |
| 9 | 600941 | 中国移动 | 90,000 | 8,953,200.00 | 0.94 |
| 10 | 002493 | 荣盛石化 | 850,000 | 8,797,500.00 | 0.92 |

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 | 13,068,027.40 | 1.37 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 448,249,658.56 | 46.98 |
| | 其中：政策性金融债 | 92,536,431.69 | 9.70 |
| 4 | 企业债券 | 264,747,041.66 | 27.75 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 61,223,628.41 | 6.42 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 26,531,316.78 | 2.78 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 813,819,672.81 | 85.29 |

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 | 175812 | 21 宁港 01 | 600,000 | 61,526,120.55 | 6.45 |
| 2 | 1928009 | 19 农业银行二级 04 | 500,000 | 51,775,355.19 | 5.43 |
| 3 | 230206 | 23 国开 06 | 500,000 | 50,646,967.21 | 5.31 |
| 4 | 115804 | 23 国君 G8 | 500,000 | 50,388,328.77 | 5.28 |
| 5 | 230205 | 23 国开 05 | 400,000 | 41,889,464.48 | 4.39 |

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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

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、中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚，国泰君安证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行上海分行的处罚，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚，中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

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

本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 | 72,825.45 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,662,691.32 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 452,563.71 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,188,080.48 |

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 | 113052 | 兴业转债 | 20,071,363.36 | 2.10 |
| 2 | 110059 | 浦发转债 | 6,459,953.42 | 0.68 |

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 | 东方红策略精选混合 A | 东方红策略精选混合 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 414,329,550.74 | 533,317,214.53 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 42,966,586.64 | 24,229,050.20 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 156,375,752.18 | 138,876,340.70 |
| 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 | 300,920,385.20 | 418,669,924.03 |

§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

单位：份

| 项目 | 东方红策略精选混合 A | 东方红策略精选混合 C |
|--------------------------|---------------|-------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 3.32 | - |

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总 份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总 份额比例(%) | 发起份额承 诺持有期限 |
|-------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,000.00 | 1.39 | 10,000,000.00 | 1.39 | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 1.39 | 10,000,000.00 | 1.39 | 3年 |

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《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合同》；
- 3、《东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红策略精选灵活配置混合型发起式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。

10.2 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。

10.3 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

2024 年 1 月 22 日