

东方红均衡优选两年定期开放混合型证券
投资基金
2023 年第 1 季度报告

2023 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：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红均衡优选定开混合
场内简称	东证均衡
基金主代码	169108
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	2020 年 3 月 13 日
报告期末基金份额总额	722,821,346.87 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	本基金主要投资于固定收益类资产，本基金的投资策略将结合基金每两年开放一次，在封闭期封闭运作，在开放期内有大规模申购赎回的流动性需求的特点，做好流动性管理，在临近开放期和开放期内，更多的关注组合资产的流动性；在封闭期内，充分发挥封闭运作的优势，做一些长久期匹配。 基于本基金每满两年开放一次，除开放期外封闭运作的特点，基金管理人在临近开放期和开放期内将重点关注基金资产的流动性和变现能力，分散投资，做好流动性管理以应对开放期投资者的赎回需求。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*15%+恒生指数收益率*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。 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。

基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§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 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	8,521,136.87
2. 本期利润	15,423,464.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0213
4. 期末基金资产净值	740,335,505.64
5. 期末基金份额净值	1.0242

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。

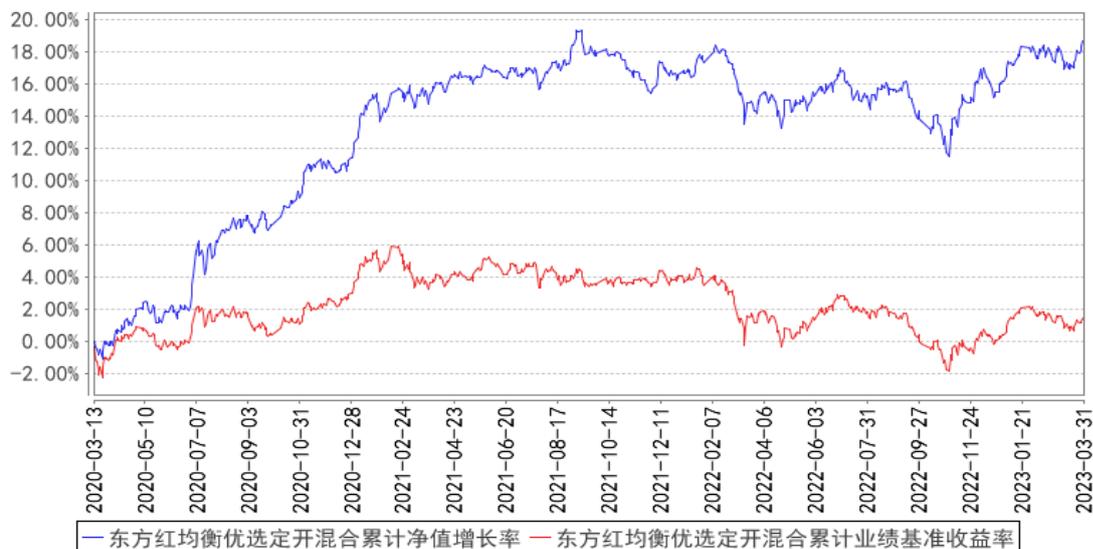
3.2 基金净值表现

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

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	2.12%	0.25%	1.12%	0.18%	1.00%	0.07%
过去六个月	4.40%	0.33%	1.74%	0.24%	2.66%	0.09%
过去一年	3.39%	0.30%	-0.07%	0.24%	3.46%	0.06%
过去三年	18.73%	0.28%	2.54%	0.24%	16.19%	0.04%
自基金合同 生效起至今	18.63%	0.28%	1.49%	0.24%	17.14%	0.04%

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

东方红均衡优选定开混合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		
陈觉平	上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部副总经理、基金经理	2020年3月13日	-	11年	上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部副总经理、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、2020年01月至今任东方红鑫裕两年定期开放信用债债券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08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、2020年08月至2021年12月任东方红鑫安39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、2020年10月至今任东方红明鉴优选两年定期开放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。复旦大学理学硕士。曾任上海新世纪资信评估服务有限公司债券评级部债券分析师，中国太平洋人寿保险股份有限公司资产管理中心信用研究员，上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益投资部研究员，上海东方证券资产管理有限公司信用研究员。具备证券投资基金从业资格。
王佳骏	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2020 年 3 月 13 日	-	7 年	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、2023 年 01 月至今任东方红锦惠甄选 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。

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

一季度债券市场波动幅度明显收窄，10 年期国债收益率从年初 2.82%上行至 1 月底 2.93%，而后有所下行，围绕 2.85%中枢窄幅震荡，3 年期 AAA 高等级信用债则由年初 3.17%上行至最高 3.21%，而后震荡下行收至季末 3.07%，全季度下行约 10bp，表现强于利率；此外，3 年期 AA 城投债由年初 4.20%快速下行至季末 3.42%位置，收益率下行接近 80bp，下行幅度显著超越市场平均水平。从基本面角度看，市场于一季度围绕国内经济复苏的主线，反复交易其预期的强弱，前三个月国内 PMI 读数分别录得 50.1、52.6 与 51.9，持续高于荣枯线，此外信贷投放方面，新增人民币贷款当月同比增加值前两月分别超 7000 亿与 9000 亿，规模及占比显著超出市场预期，同时核心一二线市场楼市与土地市场出现明显环比改善迹象，因此 1、2 两月债市环境有所顺风。从监管政策角度看，一季度《商业银行资本管理办法》征求意见稿出台，银行同业存单以及二级资本债等风险权重占用调整，对中长期资产定价的预期有所影响；在国务院机构改革中，中国证监会调整为国务院直属机构、在中国银保监会基础上组建国家金融监管总局、发改委企业债发行审核职能划出等调整方案，可能对后续金融监管改革以及深化地方金融监管体制改革等产生重要影响。

但与此同时我们也关注到，国内流动性环境在季末分层的特殊时期以外，总体仍然保持宽裕，央行也于 3 月中旬宣布于月底降准 25bp，释放中长期流动性约 5500 亿；机构行为方面，理财破净压力大幅缓解、债券配置力度加大，包括险资在内机构重新转为债券重要购买力量；地产方面，

部分二线非核心片区以及广大三四线城市楼市与土地市场表现仍弱，库存去化压力高，房价回升预期不强，社融数据中居民中长贷情况表现欠佳，居民部门资产负债表修复情况仍需观察。上述因素的叠加，导致了市场对于利率大幅上行调整的担忧减弱，结构性资产荒局面再度出现，其中中等偏弱资质的城投债收益率在一二级联动的模式下大幅下行，城投等级利差大幅压缩，目前 3 年期 AA 城投债与产业债的利差已倒挂超 20bp，幅度超过去年全年最高水平；短久期票息资产也被迅速挖掘，利差快速回落至历史中低分位数水平。

债券操作方面，我们于年初理财赎回影响尚未完全消退时便看好后续信用债市场的修复，因此在信用利差仍较高的时点，对短久期票息资产与中长期高等级资产进行增配，期间亦加大了对高等级银行二永债的研究与配置力度，整体收获了较好的市场修复收益；此外，我们针对部分区域景气度以及产业链景气度良好的主体进行了择优配置，对组合收益进行了一定程度的增厚；最后，我们也对高债券存量及占比的区域与平台进行适当规避，为后续潜在的市场调整做好防守准备。

展望后市，市场对于复苏强度的可持续性已有分歧，二季度经济指标的读数受低基数效应影响显著，短期冲高的确定性较大；但另一方面，地市楼市在不同城市间以及同城不同区域间的分化相当显著，中低能级城市及片区库存去化压力大，全国范围内的地产企稳回升难度较高，居民资产负债表的修复仍留待观察，复苏强度仍难一蹴而就。海外方面，年内外部环境复杂，市场对外需趋弱形成相对一致的预期，海外订单的回落与景气度下行预期将可能对出口、就业以及制造业投资产生重要影响，内外需的企稳仍需政策层面给予较大力度支持。城投方面，年初全国性的平台债务摸排已完成，但后续推出大规模债务置换可能性低，平台融资环境仍持续受到限制，城市间、区域间以及平台间的分化仍在加大，我们将继续对区域景气度高、产业链布局结构合理、人口有持续净流入、金融资源充沛的城市与区域进行重点跟踪与配置，而对于债券存量规模大、占比高的区域与主体保持谨慎。配置方向上，高等级中等久期信用品种仍有配置价值，部分景气度稳定的产业与平台有增厚收益的挖掘价值，银行二永债的低信用风险与相对利差表现决定了其仍是市场重要的交易与配置品种，总体而言，现阶段国内债券市场机会高于风险，但也需持续关注尾部区域及平台债务风险的暴露与处置。

股票方面，回顾 1 季度，国内经济边际改善，地产销售企稳回升，同时持续高增的信贷投放有望推动后续经济进一步复苏；海外在通胀震荡回落和区域银行危机演绎下，美联储加息预期进一步下行。在有利的宏观环境下，股市在 1 季度表现较好，沪深 300 和恒生指数分别上涨 4.63% 和 3.13%。但从节奏和结构上来看，月度之间的差异极大：1 月份市场呈全面反弹行情，2 月份则是小市值板块跑赢，3 月份市场风格进一步分化，仅 AI 主题和央企板块表现突出。报告期内，考

考虑到未来宏观环境仍然较为有利，市场整体估值也未出现大幅上行，组合权益仓位仍然维持在产品定位的偏高区间。结构上和 2022 年 4 季度末差异不大，有所调整的是减持了短期涨幅较大，估值修复较多的通信运营商、建筑等板块的标的，略微增加了一些储能相关的新能源标的。

转债方面，受股市向好和债券收益率回落双重利好影响，转债在 1 季度表现也较好，中证转债指数上涨 3.53%，转债市场整体估值较 2022 年年底有明显反弹。报告期内，考虑到正股性价比仍然高于转债，转债仓位仍然较低，以偏债银行转债为主，但组合中继续基于量化策略分散配置了一些估值具有吸引力的个券。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.0242 元，份额累计净值为 1.1842 元；本报告期间基金份额净值增长率为 2.12%，同期业绩比较基准收益率为 1.12%。

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	203,349,946.83	23.48
	其中：股票	203,349,946.83	23.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	629,956,840.40	72.74
	其中：债券	629,956,840.40	72.74
	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	29,727,064.66	3.43
8	其他资产	3,052,497.93	0.35
9	合计	866,086,349.82	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 31,146,628.93 元人民币，占期末基金资产净值比例 4.21%。

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	2,047,000.00	0.28
B	采矿业	7,578,757.20	1.02
C	制造业	94,889,163.47	12.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,156,171.60	0.56
E	建筑业	9,610,810.12	1.30
F	批发和零售业	4,701,112.28	0.63
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	5,043,607.38	0.68
J	金融业	31,083,525.00	4.20
K	房地产业	12,855,777.00	1.74
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	30,449.85	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	162,432.19	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	44,511.81	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	172,203,317.90	23.26

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	12,633,607.10	1.71
30 主要消费	-	-
35 医药卫生	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 通信服务	18,513,021.83	2.50
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	31,146,628.93	4.21

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	00700	腾讯控股	33,632	11,358,642.98	1.53
2	002493	荣盛石化	700,000	10,591,000.00	1.43
3	601186	中国铁建	1,058,100	9,533,481.00	1.29
4	002475	立讯精密	304,900	9,241,519.00	1.25
5	601658	邮储银行	1,969,700	9,159,105.00	1.24
6	600887	伊利股份	314,056	9,145,310.72	1.24
7	300122	智飞生物	111,000	9,094,230.00	1.23
8	000002	万科 A	517,100	7,880,604.00	1.06
9	601318	中国平安	171,500	7,820,400.00	1.06
10	00941	中国移动	128,500	7,154,378.85	0.97

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	10,495,965.55	1.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	133,852,635.07	18.08
	其中：政策性金融债	52,747,027.40	7.12
4	企业债券	189,217,748.57	25.56
5	企业短期融资券	80,802,569.08	10.91
6	中期票据	112,816,732.61	15.24
7	可转债（可交换债）	102,771,189.52	13.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	629,956,840.40	85.09

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	210210	21 国开 10	500,000	52,747,027.40	7.12
2	072210149	22 招商证券 CP010	500,000	50,517,961.64	6.82
3	110059	浦发转债	320,000	33,975,495.89	4.59
4	2128051	21 工商银行二级 02	300,000	30,373,839.45	4.10
5	102281691	22 中电投 MTN023	300,000	30,236,426.30	4.08

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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，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；上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海市

市场监督管理局、国家外汇管理局上海市分局的处罚；招商证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会、中国银行保险监督管理委员会、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	51,267.05
2	应收证券清算款	3,001,230.88
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	3,052,497.93

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	110059	浦发转债	33,975,495.89	4.59
2	132022	20 广版 EB	23,878,881.10	3.23
3	113021	中信转债	13,872,104.39	1.87
4	113052	兴业转债	10,135,328.77	1.37
5	113042	上银转债	7,414,189.04	1.00
6	113606	荣泰转债	2,278,906.85	0.31
7	123132	回盛转债	1,142,880.82	0.15
8	113044	大秦转债	1,129,167.12	0.15
9	123113	仙乐转债	768,644.30	0.10
10	127051	博杰转债	571,487.67	0.08
11	110067	华安转债	546,525.34	0.07
12	127024	盈峰转债	435,238.03	0.06
13	110080	东湖转债	350,243.84	0.05
14	123157	科蓝转债	323,751.78	0.04
15	127034	绿茵转债	321,005.59	0.04
16	123115	捷捷转债	303,001.44	0.04

17	113637	华翔转债	290,753.77	0.04
18	127049	希望转 2	289,878.77	0.04
19	113609	永安转债	253,881.10	0.03
20	123133	佩蒂转债	251,883.01	0.03
21	127045	牧原转债	249,399.78	0.03
22	113045	环旭转债	244,973.64	0.03
23	113600	新星转债	240,012.60	0.03
24	123146	中环转 2	235,053.97	0.03
25	127033	中装转 2	234,627.12	0.03
26	113641	华友转债	229,043.12	0.03
27	110064	建工转债	227,114.25	0.03
28	128125	华阳转债	219,433.97	0.03
29	123150	九强转债	205,426.23	0.03
30	118013	道通转债	190,793.34	0.03
31	128081	海亮转债	190,201.03	0.03
32	123141	宏丰转债	189,894.12	0.03
33	128119	龙大转债	189,664.84	0.03
34	110084	贵燃转债	185,646.16	0.03
35	123044	红相转债	175,423.36	0.02
36	110085	通 22 转债	123,771.56	0.02
37	110062	烽火转债	120,004.52	0.02

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

报告期期初基金份额总额	722,821,346.87
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	722,821,346.87

§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均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红均衡优选两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红均衡优选两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。

上海东方证券资产管理有限公司

2023 年 4 月 21 日