

# 东方红智选三年持有期混合型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                      |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 东方红智选三年持有混合                                                                                                                                          |
| 基金主代码      | 013294                                                                                                                                               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置三年锁定持有期（红利再投资除外）                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2021 年 11 月 3 日                                                                                                                                      |
| 报告期末基金份额总额 | 1,640,415,811.89 份                                                                                                                                   |
| 投资目标       | 本基金通过对宏观经济形势、行业发展趋势和企业基本面的深入研究，挖掘出质地优秀、估值合理的上市公司，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       | 本基金将动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态、消费价格指数等市场指标，全面评估上述各种关键指标，并预测其变动趋势。从而对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。通过定性和定量指标的分析，在目标收益条件下，追求风险最小化， |

|             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |               |
|-------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|
|             | <p>最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。</p> <p>本基金对内地股票及港股通标的股票主要遵循“自下而上”的个股投资策略，利用基金管理人投研团队的资源，对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出价格低估、质地优秀、未来预期成长性良好，符合转型期中国经济发展趋势的上市公司股票进行投资。</p> <p>在债券投资方面，基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。</p> <p>除上述投资策略外，本基金投资策略还包括可转换债券、可分离交易可转债和可交换债的投资策略，债券等其他固定收益类投资策略，资产支持证券投资策略，股指期货投资策略，国债期货投资策略，股票期权投资策略，参与融资业务策略等。</p> |               |
| 业绩比较基准      | $\text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{恒生指数收益率（经汇率估值调整）} \times 20\% + \text{中国债券总指数收益率} \times 20\%$                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |               |
| 风险收益特征      | <p>本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期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       | 中国农业银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |               |
| 下属分级基金的基金简称 | 东方红智选三年持有混合 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 东方红智选三年持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013294                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 013295        |

|                 |                        |                    |
|-----------------|------------------------|--------------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1, 551, 272, 731. 60 份 | 89, 143, 080. 29 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日） |                  |
|-----------------|-------------------------------------|------------------|
|                 | 东方红智选三年持有混合 A                       | 东方红智选三年持有混合 C    |
| 1. 本期已实现收益      | -47, 222, 718. 60                   | -2, 752, 859. 52 |
| 2. 本期利润         | -82, 243, 837. 73                   | -4, 752, 174. 21 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0. 0530                            | -0. 0533         |
| 4. 期末基金资产净值     | 1, 083, 357, 023. 63                | 61, 840, 307. 86 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0. 6984                             | 0. 6937          |

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

东方红智选三年持有混合 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      | -7. 05%  | 0. 93%    | -3. 58%    | 0. 76%        | -3. 47%  | 0. 17% |
| 过去六个月      | -13. 05% | 0. 92%    | -6. 78%    | 0. 72%        | -6. 27%  | 0. 20% |
| 过去一年       | -12. 32% | 1. 06%    | -0. 32%    | 0. 86%        | -12. 00% | 0. 20% |
| 自基金合同生效起至今 | -30. 16% | 1. 11%    | -17. 76%   | 0. 92%        | -12. 40% | 0. 19% |

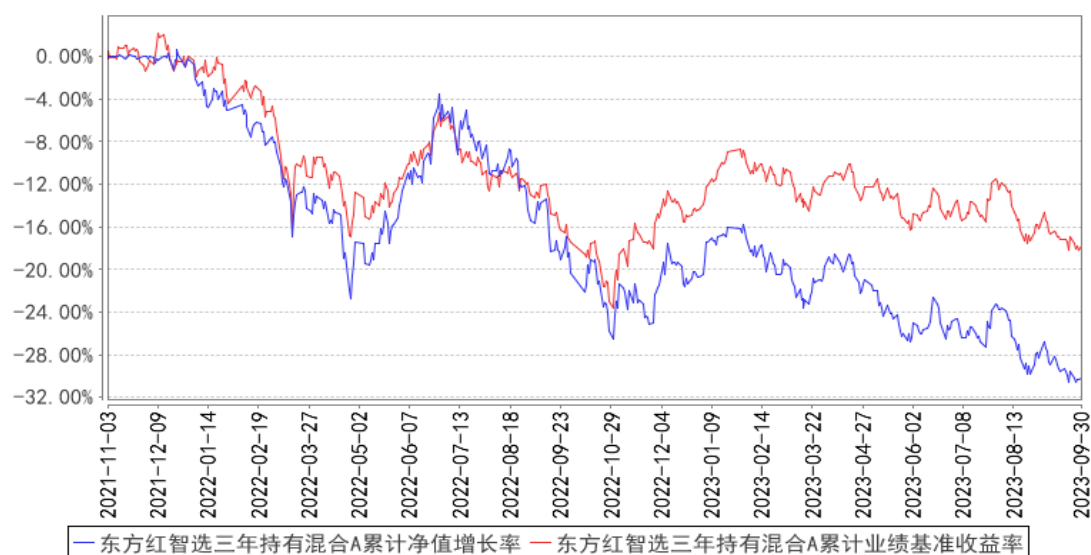
东方红智选三年持有混合 C

| 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

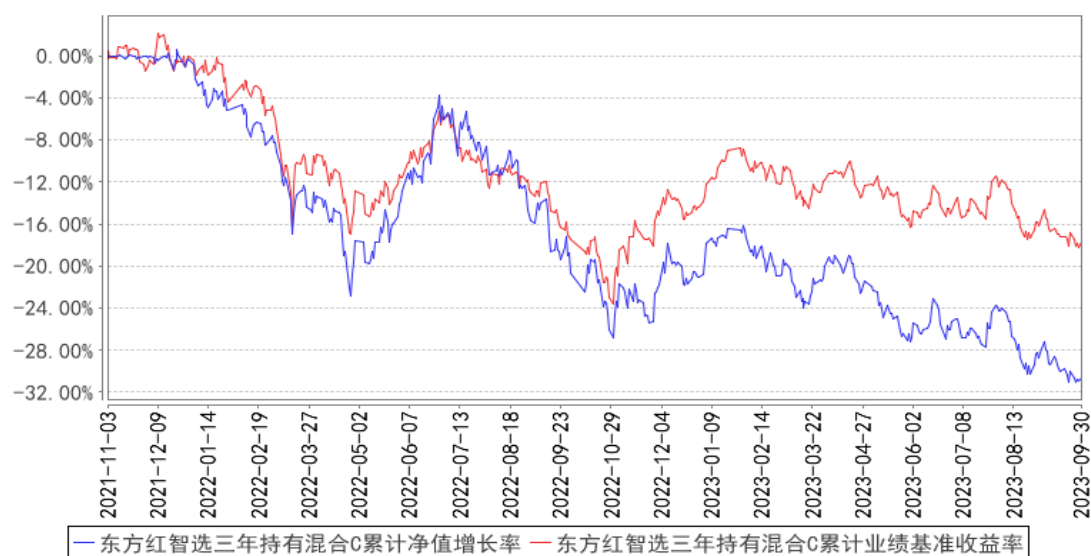
|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三个月      | -7.15%  | 0.93% | -3.58%  | 0.76% | -3.57%  | 0.17% |
| 过去六个月      | -13.21% | 0.92% | -6.78%  | 0.72% | -6.43%  | 0.20% |
| 过去一年       | -12.63% | 1.06% | -0.32%  | 0.86% | -12.31% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | -30.63% | 1.11% | -17.76% | 0.92% | -12.87% | 0.19% |

### 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率变动的比较

东方红智选三年持有混合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



东方红智选三年持有混合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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 秦绪文 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理 | 2021 年 11 月 3 日 | -    | 16 年   | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2016 年 01 月至 2017 年 04 月任东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017 年 01 月至今任东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金（原东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金））基金经理、2018 年 04 月至今任东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2021 年 11 月至今任 东方红智选三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 12 月至 2023 年 02 月任东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理、2022 年 09 月至今任东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。香港大学工商管理硕士。曾任平安证券有限公司证券研究所分析师，东方证券证券研究所董事、汽车行业分析师，上海东方证券资产管理有限公司行业研究员。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遵规守信情况的说明

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

2023 年三季度，沪深 300 指数累计下跌 3.98%，中证 1000 指数累计下跌 7.92%，中小综指累计下跌 7.42%，创业板指数累计下跌 9.53%。

2023 年三季度，从细分行业板块角度看，八个细分行业板块录得上涨，三个细分行业上涨幅度相对较大，分别是：非银金融（5.62%）、煤炭（5.26%）、石油石化（4.37%）；二十三个细分行业板块下跌，其中四个行业下跌幅度超过 10%，分别是电力设备（-15.68%）、传媒（-15.58%）、计算机（-11.71%）、通信（-10.65%）。

三季度，中央政治局会议对宏观经济和资本市场工作作出重要部署。指出中国房地产行业已经进入全新的发展阶段，明确提出“要活跃资本市场，提振投资者信心”。随后央行、住建部和各级地方政府陆续出台了促进房地产行业健康发展的鼓励政策，以及化解各级地方政府债务的政策；证监会出台了一系列利好资本市场的政策。同时，9 月份 PMI 重回荣枯线以上。宏观经济最差的阶段大概率已经过去。

从市场表现来看，三季度主题切换较快，表明市场真正的投资主线依然模糊。我认为，中国的经济增长模式很难回到过去：去全球化使得各个国家纷纷建立自己的供应链体系，中国的制造业出口面临的贸易摩擦将增多；房地产行业需求不足，一方面拖累了房地产产业链的景气度，也拖累了地方政府的财政收入的增长，从而影响地方政府基建投资的能力。

我认为，中国经济进入高质量发展阶段。选股思路必须要适应宏观经济发展的阶段特征，适应新形势，开拓新思路。未来一段时间，我将重点关注已经进入稳定增长阶段、竞争结构稳定、资本开支停滞、竞争有序的行业内投资标的。

## 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 0.6984 元,份额累计净值为 0.6984 元;C 类份额净值为 0.6937 元,份额累计净值为 0.6937 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-7.05%,同期业绩比较基准收益率为-3.58%;C 类份额净值增长率为-7.15%,同期业绩比较基准收益率为-3.58%。

## 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              | 1,046,540,083.48 | 91.25        |
|    | 其中:股票             | 1,046,540,083.48 | 91.25        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 60,257,213.11    | 5.25         |
|    | 其中:债券             | 60,257,213.11    | 5.25         |
|    | 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      | 39,844,196.86    | 3.47         |
| 8  | 其他资产              | 269,437.17       | 0.02         |
| 9  | 合计                | 1,146,910,930.62 | 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 156,262,816.73 元人民币,占期末基金资产净值比例 13.65%。

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      | 35,334,693.00 | 3.09         |



|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业              | 733,845,669.63 | 64.08 |
| 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      | 4,866,290.00   | 0.42  |
| H | 住宿和餐饮业           | —              | —     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 49,908,434.12  | 4.36  |
| J | 金融业              | 39,229,620.00  | 3.43  |
| 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       | —              | —     |
| 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          | 27,092,560.00  | 2.37  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | —              | —     |
| S | 综合               | —              | —     |
|   | 合计               | 890,277,266.75 | 77.74 |

## 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 | 80,871,349.43  | 7.06         |
| 30 主要消费 | 2,056,131.00   | 0.18         |
| 35 医药卫生 | —              | —            |
| 40 金融   | —              | —            |
| 45 信息技术 | —              | —            |
| 50 通信服务 | 73,335,336.30  | 6.40         |
| 55 公用事业 | —              | —            |
| 60 房地产  | —              | —            |
| 合计      | 156,262,816.73 | 13.65        |

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 | 261,000   | 73,335,336.30 | 6.40         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 36,000    | 64,747,800.00 | 5.65         |
| 3  | 600066 | 宇通客车 | 3,546,800 | 46,924,164.00 | 4.10         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 898,800   | 40,392,072.00 | 3.53 |
| 5  | 02333  | 长城汽车 | 4,406,500 | 37,766,789.55 | 3.30 |
| 6  | 002028 | 思源电气 | 687,979   | 35,554,754.72 | 3.10 |
| 7  | 300750 | 宁德时代 | 174,420   | 35,412,492.60 | 3.09 |
| 8  | 601699 | 潞安环能 | 1,860,700 | 35,334,693.00 | 3.09 |
| 9  | 601100 | 恒立液压 | 543,700   | 34,742,430.00 | 3.03 |
| 10 | 000807 | 云铝股份 | 2,268,200 | 34,249,820.00 | 2.99 |

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      | 60,257,213.11 | 5.26         |
|    | 其中：政策性金融债 | 60,257,213.11 | 5.26         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 60,257,213.11 | 5.26         |

#### 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  | 230304 | 23 进出 04 | 600,000 | 60,257,213.11 | 5.26         |

#### 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原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。

## 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将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。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

本基金持有的前十名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   | 269,150.56 |
| 2  | 应收证券清算款 | —          |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | 286.61     |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 其他      | —          |
| 8  | 合计      | 269,437.17 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 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                        | 东方红智选三年持有混合 A    | 东方红智选三年持有混合 C |
|---------------------------|------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,550,429,815.18 | 89,022,867.28 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 842,916.42       | 120,213.01    |
| 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               | 1,551,272,731.60 | 89,143,080.29 |

### §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智选三年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红智选三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红智选三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红智选三年持有期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 10 月 25 日