

东方红匠心甄选一年持有期混合型  
证券投资基金  
2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 17 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 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 东方红匠心甄选一年持有混合   |
| 基金主代码      | 008990  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2020 年 2 月 25 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 2,978,428,698.58 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努力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 $\times$ 8% + 恒生指数收益率 $\times$ 2% + 中债综合指数收益率 $\times$ 90%   |
| 风险收益特征     | 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。<br>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      | 中国建设银行股份有限公司  |

## § 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 (2020 年 4 月 1 日-2020 年 6 月 30 日) |
|-----------------|--------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 22,420,359.88                        |
| 2. 本期利润         | 31,536,039.97                        |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0106                               |
| 4. 期末基金资产净值     | 3,000,867,248.65                     |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0075                               |

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 本报告期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<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 1.06%      | 0.12%         | 0.14%          | 0.14%                 | 0.92% | -0.02% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.75%      | 0.14%         | -0.40%         | 0.16%                 | 1.15% | -0.02% |

#### 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

东方红匠心甄选一年持有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



注：1、本基金合同于 2020 年 2 月 25 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2020 年 2 月 25 日至 2020 年 8 月 24 日，至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 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 |        |   |
| 胡伟 | 上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募固定收益投资部总经理、本基金基金经理 | 2020 年 6 月 3 日 | -    | 16 年   | 上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、公募固定收益投资部总经理、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。中南财经政法大学金融学学士。历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<br>债券交易员，<br>固定收益部基<br>金经理、副总<br>监、总监，总<br>经理助理。具<br>备证券投资基<br>金从业资格。<br>中国国籍。  |
| 王佳骏 | 本基金基金<br>经理 | 2020 年 2 月 25 日 | - | 5 年 | 2019 年 08 月<br>至今任东方红<br>核心优选一年<br>定期开放混合<br>型证券投资基金<br>基金经理、<br>2020 年 01 月<br>至今任东方红<br>安鑫甄选一年<br>持有期混合型<br>证券投资基金<br>基金经理、<br>2020 年 02 月<br>至今任东方红<br>匠心甄选一年<br>持有期混合型<br>证券投资基金<br>基金经理、<br>2020 年 03 月<br>至今任东方红<br>均衡优选两年<br>定期开放混合<br>型证券投资基金<br>基金经理。<br>帝国理工学院<br>金融学硕士。<br>历任国信证券<br>股份有限公司<br>助理分析师，<br>上海东方证券<br>资产管理有限<br>公司私募固定<br>收益投资部投<br>资支持高级经<br>理。具备证券<br>投资基金从业 |

|  |  |  |  |  |          |
|--|--|--|--|--|----------|
|  |  |  |  |  | 资格。中国国籍。 |
|--|--|--|--|--|----------|

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。

## 4.2 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》的规定。

### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

债券方面,二季度随着疫情得到有效防控,我国经济的韧性与活力逐步体现。在央行加强货币政策逆周期调节的努力下,市场流动性保持充裕,信贷和社融明显增长,创新的多种货币政策工具也直达终端,更好的服务实体经济。标志性的 10Y 国债收益率上行 25bp 至 2.82%,此前过于

乐观的债券定价水平得到一定程度修正，预计债券的票息价值未来将逐渐得到体现。本季度组合维持了较短的久期，较好的规避了收益率上行冲击。展望后市，在市场达成新的均衡水平过程中，组合仍维持投资级信用债的配置为主，以获取票息为目的，并适度拉长组合久期。我们也将继续发挥团队信用研究的传统优势，坚持自下而上的个体研究，着重调研具有竞争优势的产业龙头和政策支持地区的城投债，努力为持有人获取长期、稳健的回报。

权益方面，二季度市场整体表现较好，上证综指上涨 8.52%，创业板表现更加突出，创业板指二季度上涨 30.25%。随着新冠疫情的逐步缓解，市场也出现了相应的修复。在流动性宽松的环境下，一些长期成长空间较为广阔的公司估值水平出现了较为明显的提升。展望未来，随着疫情带来的不确定性逐渐消退，在疫情不会二次爆发的情景下，宏观环境将逐渐回归正常路径。目前市场估值分化较大，未来我们仍然坚持价值投资理念，自下而上精选估值合理的优质公司进行配置，重点关注一些估值水平处于历史低位、股息回报率已经较高的大盘蓝筹公司。

转债方面，二季度转债的估值水平有所压缩。目前转债的整体估值水平相对合理，结构差异较大，未来转债市场主要以自下而上、精选个券为主，选择一些估值相对合理的优质公司转债进行配置。

#### 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 1.0075 元，份额累计净值为 1.0075 元；本报告期内基金份额净值增长率为 1.06%，业绩比较基准收益率为 0.14%。

#### 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    | 333,747,743.13   | 11.10        |
|    | 其中：股票   | 333,747,743.13   | 11.10        |
| 2  | 基金投资    | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资  | 2,576,673,141.80 | 85.71        |
|    | 其中：债券   | 2,526,738,141.80 | 84.04        |
|    | 资产支持证券  | 49,935,000.00    | 1.66         |
| 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      | 69,318,250.66    | 2.31   |
| 8 | 其他资产              | 26,673,881.49    | 0.89   |
| 9 | 合计                | 3,006,413,017.08 | 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 81,221,843.44 元人民币,

占期末基金资产净值比例 2.71%。

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              | 156,536,206.98 | 5.22         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32      | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 19,817,539.00  | 0.66         |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,394,677.00   | 0.11         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 9,598,435.77   | 0.32         |
| J  | 金融业              | 36,338,308.12  | 1.21         |
| K  | 房地产业             | 16,144,064.00  | 0.54         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 6,033,424.00   | 0.20         |
| 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          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 4,650,478.50   | 0.15         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 252,525,899.69 | 8.42         |

### 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(%) |
|-----------|---------------|--------------|
| A 基础材料    | -             | -            |
| B 消费者非必需品 | 28,168,764.30 | 0.94         |

|          |               |      |
|----------|---------------|------|
| C 消费者常用品 | -             | -    |
| D 能源     | 18,704,273.39 | 0.62 |
| E 金融     | -             | -    |
| F 医疗保健   | -             | -    |
| G 工业     | 9,751,099.88  | 0.32 |
| H 信息科技   | -             | -    |
| I 电信服务   | 24,597,705.87 | 0.82 |
| J 公用事业   | -             | -    |
| K 房地产    | -             | -    |
| 合计       | 81,221,843.44 | 2.71 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

### 5.3 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  | 600887 | 伊利股份 | 722,461   | 22,490,210.93 | 0.75         |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 339,100   | 20,274,789.00 | 0.68         |
| 3  | 01088  | 中国神华 | 1,689,500 | 18,704,273.39 | 0.62         |
| 4  | 00700  | 腾讯控股 | 38,000    | 17,306,764.99 | 0.58         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 1,057,834 | 16,692,620.52 | 0.56         |
| 6  | 000002 | 万科A  | 617,600   | 16,144,064.00 | 0.54         |
| 7  | 600741 | 华域汽车 | 724,722   | 15,066,970.38 | 0.50         |
| 8  | 601186 | 中国铁建 | 1,599,100 | 13,400,458.00 | 0.45         |
| 9  | 601688 | 华泰证券 | 645,827   | 12,141,547.60 | 0.40         |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 393,300   | 11,936,655.00 | 0.40         |

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      | 787,610,264.00   | 26.25        |
|    | 其中：政策性金融债 | 131,363,000.00   | 4.38         |
| 4  | 企业债券      | 659,682,470.00   | 21.98        |
| 5  | 企业短期融资券   | 179,616,000.00   | 5.99         |
| 6  | 中期票据      | 19,928,000.00    | 0.66         |
| 7  | 可转债(可交换债) | 486,726,407.80   | 16.22        |
| 8  | 同业存单      | 393,175,000.00   | 13.10        |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 2,526,738,141.80 | 84.20        |

### 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  | 136722    | 16 石化 02       | 1,500,000 | 150,510,000.00 | 5.02         |
| 2  | 132015    | 18 中油 EB       | 1,400,000 | 140,000,000.00 | 4.67         |
| 3  | 132009    | 17 中油 EB       | 1,222,550 | 122,633,990.50 | 4.09         |
| 4  | 190203    | 19 国开 03       | 1,000,000 | 101,390,000.00 | 3.38         |
| 5  | 012001769 | 20 光大集团 SCP014 | 1,000,000 | 99,600,000.00  | 3.32         |

### 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  | 2089082 | 20 上和 1A1 | 500,000 | 49,935,000.00 | 1.66         |

### 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,以获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将根据风险管理原则,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,以获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

本基金持有的华泰证券(代码: 601688. SH)发行主体华泰证券股份有限公司因未履行客户身份识别义务、未按规定报送可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易的行为,于 2020 年 2 月 10 日被中国人民银行处以罚款 1010 万元。

本基金持有的 16 中油 01(代码: 136164. SH)发行主体中国石油天然气股份有限公司因下属广东广州销售分公司地埋式贮油罐未采取地下油罐防渗措施,且未根据穗环领导小组办[2019]47 号文的要求在 2019 年 6 月前完成地下油罐改造工作,于 2019 年 9 月 24 日被广州市生态环境局处以罚款 8 万元。

本基金持有的 20 中信银行 CD091(代码: 112008091. IB)发行主体中信银行股份有限公司因违规发放土地储备贷款,受托支付不符合监管规定,信托消费贷款业务开展不审慎,流动资金贷款被挪用于股权投资等 18 项行为,于 2020 年 2 月 20 日被北京银保监局责令改正,并处以罚款合计 2020 万元;因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在理财产品数量漏报、信贷资产转让业务漏报、贸易融资业务漏报等 6 项违法违规行为,于 2020 年 4 月 20 日被银保监会处以罚款 160 万元;因在未经客户本人授权的情况下,向第三方提供个人银行账户交易明细,于 2020 年 5 月 9 日被中国银保监会消费者权益保护局采取立案调查的措施。

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 | 478,992.55 |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 25,552.07     |
| 3 | 应收股利    | 1,610,146.54  |
| 4 | 应收利息    | 24,559,190.33 |
| 5 | 应收申购款   | —             |
| 6 | 其他应收款   | —             |
| 7 | 待摊费用    | —             |
| 8 | 其他      | —             |
| 9 | 合计      | 26,673,881.49 |

#### 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 | 140,000,000.00 | 4.67         |
| 2  | 132009 | 17 中油 EB | 122,633,990.50 | 4.09         |
| 3  | 132006 | 16 皖新 EB | 64,860,000.00  | 2.16         |
| 4  | 132007 | 16 凤凰 EB | 50,241,120.00  | 1.67         |
| 5  | 132012 | 17 巨化 EB | 20,300,000.00  | 0.68         |
| 6  | 110047 | 山鹰转债     | 4,312,400.00   | 0.14         |
| 7  | 110056 | 亨通转债     | 3,569,700.00   | 0.12         |
| 8  | 110031 | 航信转债     | 3,236,100.00   | 0.11         |
| 9  | 110052 | 贵广转债     | 2,161,800.00   | 0.07         |
| 10 | 113549 | 白电转债     | 2,138,566.00   | 0.07         |
| 11 | 128049 | 华源转债     | 2,046,892.80   | 0.07         |
| 12 | 110063 | 鹰 19 转债  | 1,598,550.00   | 0.05         |
| 13 | 127007 | 湖广转债     | 1,240,759.58   | 0.04         |
| 14 | 128084 | 木森转债     | 1,224.30       | 0.00         |

#### 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        | 2,978,428,698.58 |
| 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 | 2,978,428,698.58 |

## § 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匠心甄选一年持有混合基金的文件;
- 2、《东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金托管协议》;
- 4、报告期内在规定媒介上披露的各项公告;
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、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: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 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.dfhsm.com](http://www.dfhsm.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2020 年 7 月 21 日