

东方红收益增强债券型证券投资基金

2024 年第 1 季度报告

2024 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 04 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方红收益增强债券
基金主代码	001862
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	306,838,829.19 份
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。另外，本基金可投资于股票、存托凭证、权证等权益类资产，基金管理人将运用定性分析和定量分析相结合的方法选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资，强化基金的获利能力，提高预期收益水

	平，以期达到收益增强的效果。	
业绩比较基准	中债综合指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方红收益增强债券 A	东方红收益增强债券 C
下属分级基金的交易代码	001862	001863
报告期末下属分级基金的份额总额	223,548,069.29 份	83,290,759.90 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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）	
	东方红收益增强债券 A	东方红收益增强债券 C
1. 本期已实现收益	-7,326,905.99	-1,891,721.57
2. 本期利润	-2,767,706.95	-165,208.19
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0129	-0.0032
4. 期末基金资产净值	234,534,342.91	85,706,554.41
5. 期末基金份额净值	1.0491	1.0290

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

东方红收益增强债券 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	0.10%	0.71%	1.55%	0.11%	-1.45%	0.60%

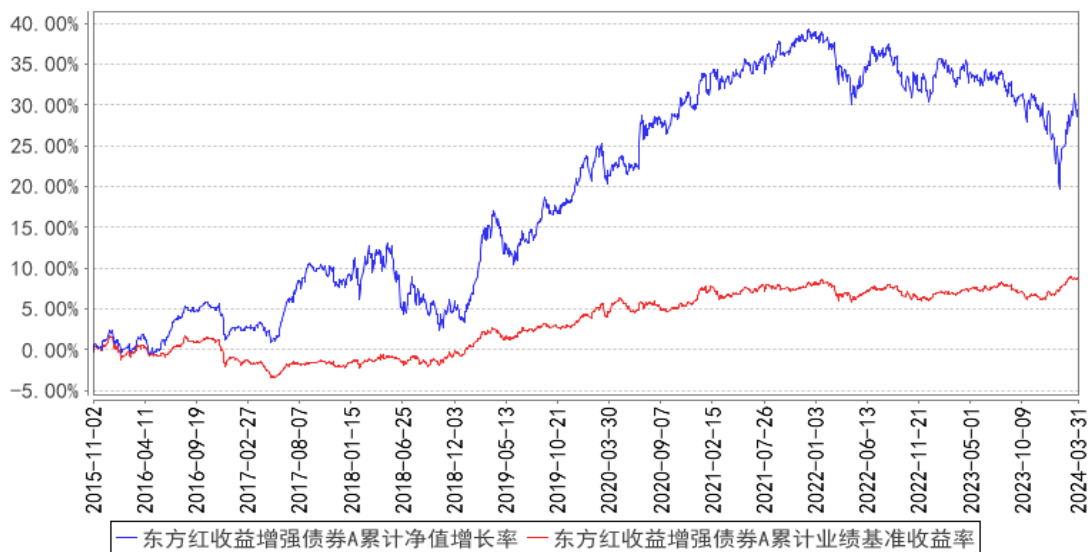
过去六个月	-1.26%	0.57%	1.58%	0.10%	-2.84%	0.47%
过去一年	-3.55%	0.45%	1.54%	0.09%	-5.09%	0.36%
过去三年	-2.72%	0.37%	2.03%	0.11%	-4.75%	0.26%
过去五年	12.41%	0.37%	6.12%	0.12%	6.29%	0.25%
自基金合同 生效起至今	29.35%	0.38%	8.76%	0.13%	20.59%	0.25%

东方红收益增强债券 C

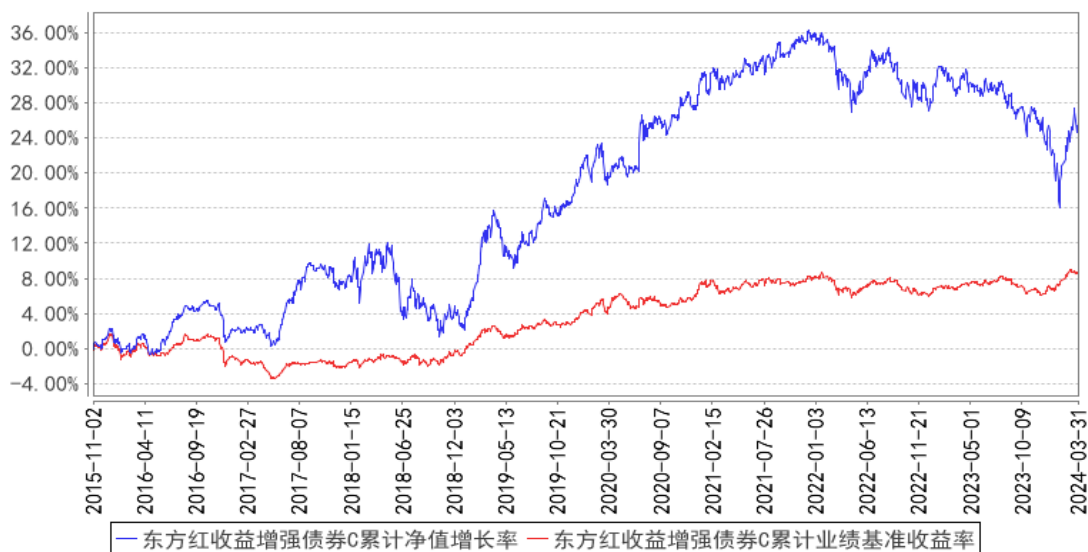
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.02%	0.71%	1.55%	0.11%	-1.53%	0.60%
过去六个月	-1.46%	0.57%	1.58%	0.10%	-3.04%	0.47%
过去一年	-3.93%	0.45%	1.54%	0.09%	-5.47%	0.36%
过去三年	-3.87%	0.37%	2.03%	0.11%	-5.90%	0.26%
过去五年	10.15%	0.37%	6.12%	0.12%	4.03%	0.25%
自基金合同 生效起至今	25.39%	0.38%	8.76%	0.13%	16.63%	0.25%

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

东方红收益增强债券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



东方红收益增强债券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监	2024年3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

	理、基金经理				<p>方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2018 年 03 月至 2024 年 01 月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、2024 年 03 月至今任东方红收益增强债券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。</p>
纪文静	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、基金经理	2015 年 11 月 2 日	2024 年 3 月 5 日	16 年	<p>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、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 2023 年 04 月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 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 2024 年 03 月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</p>

					<p>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、2023 年 03 月至今任东方红共赢甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2023 年 09 月至今任东方红 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。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>
胡伟	上海东方证券资产管理有限公司副总经理、基金经理	2020 年 5 月 13 日	2024 年 3 月 5 日	19 年	<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 2024 年 03 月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 2024 年 03 月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</p>

					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可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的 5% 的交易共 1 次，为指数投资组合因跟踪指数需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度权益市场震荡分化，上证指数上涨 2.23%，本产品持仓上进行了一定幅度的调整。在权益的投资风格上，仍会延续产品前期以成长性行业为主的特点，但在行业上会相对更为分散，一季度降低了电子、计算机和医药等之前重仓行业的配置比例，增加了传媒、高端制造、轻工等其他行业的配置。

债券投资方面，本产品延续了之前的投资方向，主要以投资可转债为主。一季度的转债估值水平继续出现了一定幅度的压缩，目前的估值水平已经具备较好的投资价值。本产品维持了较高的转债配置比例，一季度在结构上进行了一些调整，减持了一些偏债性的金融类转债，增持了一些电力设备、TMT 等制造业公司转债。

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 1.0491 元，份额累计净值为 1.2791 元；C 类份额净值为 1.0290 元，份额累计净值为 1.2430 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 0.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.55%；C 类份额净值增长率为 0.02%，同期业绩比较基准收益率为 1.55%。

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	58,569,846.05	14.53
	其中：股票	58,569,846.05	14.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	261,412,761.54	64.84
	其中：债券	261,412,761.54	64.84
	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	58,499,379.38	14.51
8	其他资产	24,675,565.24	6.12
9	合计	403,157,552.21	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	43,096,146.05	13.46
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,133,100.00	3.79
J	金融业	1,309,600.00	0.41
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	906,000.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	1,125,000.00	0.35
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	58,569,846.05	18.29

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	688111	金山办公	15,000	4,365,000.00	1.36
2	300750	宁德时代	18,000	3,422,880.00	1.07
3	601689	拓普集团	50,000	3,159,500.00	0.99
4	603529	爱玛科技	100,000	3,119,000.00	0.97
5	002960	青鸟消防	200,000	2,994,000.00	0.93
6	002078	太阳纸业	200,000	2,912,000.00	0.91
7	605155	西大门	200,000	2,788,000.00	0.87
8	300604	长川科技	80,000	2,688,000.00	0.84
9	301087	可孚医疗	80,000	2,658,400.00	0.83
10	688025	杰普特	50,063	2,420,546.05	0.76

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	29,910,481.93	9.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	231,502,279.61	72.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	261,412,761.54	81.63

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	110079	杭银转债	125,000	13,957,236.30	4.36
2	113052	兴业转债	130,000	13,543,168.49	4.23
3	127089	晶澳转债	130,000	13,477,445.48	4.21
4	118031	天 23 转债	123,000	12,447,785.34	3.89
5	113641	华友转债	104,960	10,790,658.67	3.37

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动	风险指标说明
----	----	----------	---------	--------	--------

				(元)	
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
国债期货投资本期收益 (元)					154,526.20
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					8,750.00

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期国债期货投资在一定程度上对冲了利率波动的风险,符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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,南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局江苏省分局的处罚,杭州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浙江监管局的处罚,兴业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上海监管局的处罚。

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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	53,595.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,621,969.62
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	24,675,565.24

5.10.4 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	110079	杭银转债	13,957,236.30	4.36
2	113052	兴业转债	13,543,168.49	4.23
3	127089	晶澳转债	13,477,445.48	4.21
4	118031	天 23 转债	12,447,785.34	3.89
5	113641	华友转债	10,790,658.67	3.37
6	110073	国投转债	10,765,010.96	3.36
7	111010	立昂转债	10,675,123.29	3.33
8	113050	南银转债	10,387,903.51	3.24
9	113043	财通转债	9,813,193.15	3.06
10	110081	闻泰转债	8,756,054.93	2.73
11	113021	中信转债	7,505,256.16	2.34
12	113060	浙 22 转债	6,847,231.78	2.14
13	123107	温氏转债	6,169,493.15	1.93
14	113059	福莱转债	6,142,746.58	1.92
15	118042	奥维转债	5,558,894.57	1.74
16	123178	花园转债	5,305,677.98	1.66
17	118024	冠宇转债	5,277,212.33	1.65
18	118033	华特转债	5,255,602.74	1.64
19	113623	凤 21 转债	5,073,777.84	1.58
20	118034	晶能转债	4,727,775.21	1.48
21	113636	甬金转债	4,288,044.93	1.34
22	113667	春 23 转债	3,594,193.15	1.12
23	123158	宙邦转债	3,450,147.95	1.08
24	123208	孩王转债	3,372,376.62	1.05
25	113655	欧 22 转债	3,147,057.53	0.98
26	127032	苏行转债	3,061,397.26	0.96
27	110062	烽火转债	2,866,335.62	0.90
28	127074	麦米转 2	2,655,843.07	0.83
29	123170	南电转债	2,277,044.38	0.71
30	118036	力合转债	2,238,042.74	0.70
31	123010	博世转债	2,159,871.23	0.67
32	123113	仙乐转债	2,155,610.96	0.67
33	118037	上声转债	2,147,137.53	0.67
34	113652	伟 22 转债	2,080,036.16	0.65
35	113643	风语转债	1,778,630.14	0.56
36	113648	巨星转债	1,470,184.38	0.46
37	113669	景 23 转债	1,117,280.27	0.35
38	123210	信服转债	1,093,030.68	0.34
39	123121	帝尔转债	1,085,138.36	0.34
40	113542	好客转债	1,083,186.85	0.34
41	118035	国力转债	1,060,526.58	0.33

42	127066	科利转债	1,059,799.96	0.33
43	128134	鸿路转债	1,058,420.55	0.33
44	123162	东杰转债	1,035,992.88	0.32
45	123154	火星转债	1,028,519.18	0.32
46	118032	建龙转债	1,018,763.01	0.32
47	127073	天赐转债	924,125.40	0.29
48	123211	阳谷转债	669,978.41	0.21
49	118025	奕瑞转债	616,146.99	0.19
50	123104	卫宁转债	567,663.01	0.18
51	127051	博杰转债	518,772.84	0.16
52	123145	药石转债	382,049.00	0.12
53	113654	永 02 转债	203,433.78	0.06
54	113579	健友转债	29,191.77	0.01
55	113632	鹤 21 转债	18,397.74	0.01

5.10.5 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。

5.10.6 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	东方红收益增强债券 A	东方红收益增强债券 C
报告期期初基金份额总额	282,991,483.00	52,213,845.78
报告期期间基金总申购份额	70,903,108.29	34,329,410.83
减：报告期期间基金总赎回份额	130,346,522.00	3,252,496.71
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	223,548,069.29	83,290,759.90

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20240101-20240331	70,860,527.68	0.00	0.00	70,860,527.68	23.0937
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额集中度较高的情况，可能存在巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力；基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金份额集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。							

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收益增强债券型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红收益增强债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红收益增强债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红收益增强债券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

2024 年 4 月 22 日