

东方红中证全指指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：华夏银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 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	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55

7.8 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贵金属投资明细	55
7.9 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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
11.1 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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红中证全指指数增强型证券投资基金	
基金简称	东方红中证全指指数增强	
基金主代码	025911	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 16 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	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	47,963,306.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	东方红中证全指指数增强 A	东方红中证全指指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	025911	025912
报告期末下属分级 基金的份额总额	29,056,751.47 份	18,906,555.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金属于指数增强型基金，力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。 本基金以中证全指指数为标的指数，按照标的指数的成份股及其权重初步构建基金股票投资组合。本基金将综合考虑组合与业绩比较基准的跟踪误差、行业偏离、交易成本等因素，对投资组合进行优化。在标的指数成份股及备选成份股的基础上，使用量化投资的方法，优先选择成份股和非成份股中综合评估较高的股票，对指数中的股票权重进行调整，以达到指数增强的目的。 本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票

	期权投资策略、国债期货投资策略、融资投资策略、参与转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上,力争获得超越业绩比较基准的收益,具有与标的指数相似的风险收益特征。 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周陶	赵伟婧
	联系电话	021-53952888	(010) 85237681
	电子邮箱	service@dfham.com	zhaoweiying@hxb.com.cn
客户服务电话		4009200808	95577
传真		021-63326381	(010) 85238680
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005)
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005)
邮政编码		200010	100005
法定代表人		杨斌	杨书剑

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上海东方证券资产管理有限公司	上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
-----------	-------------------------------------

据和指标	东方红中证全指指数增强 A	东方红中证全指指数增强 C
本期已实现收益	6,363,603.93	4,387,466.14
本期利润	5,244,052.65	4,851,021.47
加权平均基金份额本期利润	0.0920	0.1097
本期加权平均净值利润率	8.90%	10.64%
本期基金份额净值增长率	6.29%	6.07%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026年6月30日)	
期末可供分配利润	1,921,130.63	1,204,496.93
期末可供分配基金份额利润	0.0661	0.0637
期末基金资产净值	30,977,882.10	20,111,052.26
期末基金份额净值	1.0661	1.0637
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.61%	6.37%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

东方红中证全指指数增强 A

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去三个月	7.90%	1.16%	11.53%	1.30%	-3.63%	-0.14%
过去六个月	6.29%	1.14%	10.19%	1.26%	-3.90%	-0.12%
自基金合同生效起 至今	6.61%	1.09%	13.24%	1.22%	-6.63%	-0.13%

东方红中证全指指数增强 C

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 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	7.79%	1.16%	11.53%	1.30%	-3.74%	-0.14%
过去六个月	6.07%	1.14%	10.19%	1.26%	-4.12%	-0.12%
自基金合同生效起 至今	6.37%	1.09%	13.24%	1.22%	-6.87%	-0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

东方红中证全指指数增强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



东方红中证全指指数增强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



- 注：1、本基金合同于 2025 年 12 月 16 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 2025 年 12 月 16 日起至 2026 年 06 月 15 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。公司管理的公募基金类型涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、指数型基金、货币型基金、QDII 基金、FOF 基金和公募 REITs 基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戎逸洲	上海东方证券资产	2025 年 12 月 16	-	11 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2019 年 11 月至今任东方红中证竞争

	管理有限公司基金 经理	日			力指数发起式证券投资基金基金经理、 2023 年 09 月至今任东方红中证东方红优 势成长指数发起式证券投资基金基金经 理、2025 年 08 月至今任东方红中证港股 通高股息投资指数型证券投资基金基金经 理、2025 年 11 月至今任东方红上证科创 板综合指数增强型证券投资基金基金经 理、2025 年 11 月至今任东方红中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、2025 年 12 月至今任东方红中证全指指数增强 型证券投资基金基金经理。福特汉姆大学 理学硕士。曾任上海东方证券资产管理有 限公司量化研究员。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（转型基金为初始基金合同生效日），“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。

4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
戎逸洲	公募基金	6	1,703,383,470.19	2019 年 11 月 29 日
	私募资产管理计划	3	158,148,218.84	2025 年 1 月 13 日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	1,861,531,689.03	-

注：戎逸洲管理的 1 只单一产品已于 2026 年 2 月 11 日离任。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，东方红中证全指指数增强 A 上涨 6.29%。报告期内，A 股市场结构分化较为明显，科技成长、高景气方向阶段性表现突出，市场风格快速切换，投资机会主要集中于少数热点板块。在此市场环境下，量化指数增强策略面临一定挑战。基金所采用的量化模型基于长期有效的风险溢价规律构建，通过对估值、盈利质量、成长性、市场行为等多维因子的综合分析进行选股和组合优化。其中，低估值、低波动等因子在 A 股市场长期投资实践中展现出较好的有效性，但在由产业趋势、市场情绪及资金偏好驱动的极致风格行情中，相关因子可能出现阶段性表现偏弱的情况。报告期内，年初跨年行情以及 5 月、6 月期间，市场风险偏好显著提升，高贝塔、高弹性资产表现突出，而价值风格阶段性承压，组合超额收益受到一定影响。与此同时，市场风格的极致演绎往往伴随着资金再平衡和风格再均衡的过程，部分热点板块在经历快速上涨后，其风险收益特征已发生一定变化。在此背景下，基金在投资运作中始终坚持长期有效的量化投资框架和纪律化投资原则，保持组合风格稳定，不因短期市场热点而大幅调整策略暴露，并持续推进因子研究、模型迭代和组合优化，力争获取来源稳定、可持续的超额收益。

4.4.2 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 1.0661 元，份额累计净值为 1.0661 元；C 类份额净值为 1.0637 元，份额累计净值为 1.0637 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 6.29%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%；C 类份额净值增长率为 6.07%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，国内经济延续“温和修复、价格拐点初现”的组合。价格端延续回暖趋势，4、5 月 CPI 同比均上涨 1.2%，核心 CPI 同比上涨 1.2%和 1.1%。PPI 在需求侧边际改善与部分上游资源品涨价带动下，同比上涨 2.8%和 3.9%，价格拐点初步确认。生产端表现平稳，1—5 月规模以上

工业增加值同比增长 5.4%，社会消费品零售总额同比增长 1.4%，固定资产投资同比下降 4.1%。6 月制造业 PMI 录得 50.3%，已连续第四个月处于扩张区间，显示企业生产经营活动总体保持平稳。

货币与信用环境方面，上半年金融数据继续呈现“总量平稳、结构分化”的特征。2026 年前五个月社会融资规模增量累计为 17.48 万亿元，5 月末社融存量同比增长 7.7%，M2 同比增长 8.6%；人民币贷款余额同比增长 5.5%，前五个月新增人民币贷款 9.11 万亿元，整体仍呈现“政府发力、信贷偏弱”的格局。

投资层面，二季度市场基本告别一季度末的“缩圈”试探，进入“强者恒强、弱者出清”的极致结构市。从 A 股内部表现看，科技方向在二季度也经历了“去伪存真”的缩圈过程，具备真实订单落地以及半导体设备国产替代逻辑的个股获得资金青睐，龙头大市值公司相较中小市值公司展现出更强的韧性与弹性。与此同时，红利类资产中的资源品方向受海外大宗商品价格波动及国内保供稳价影响，波动有所加大，煤炭、有色等板块均出现先扬后抑。其他红利类资产则受到科技成长方向资金吸引及利率预期变化等因素影响，阶段性承压。整体而言，二季度市场风险偏好维持在较高水平，交易逻辑由“景气预期”逐步转向“景气落地与景气持续”，科技龙头成为市场主线，资金向相关行业龙头集中的“马太效应”较一季度进一步强化。

总体而言，上半年强势板块在经历极致缩圈后，后续需要半年报及三季报业绩持续验证，才能支撑股价进一步上行。我们预计前期高景气方向的业绩容错率将有所下降，下半年市场或将在震荡上行过程中进一步缩圈，并酝酿新的市场结构。

展望 2026 年第三季度及下半年，外部环境仍面临经贸摩擦及地缘政治反复等多重扰动，市场风险偏好可能仍有波动，但市场对相关不确定性的交易敏感度或较上半年有所降低。若后续更多体现为产业链重构而非全面脱钩，其边际冲击有望进一步减弱。国内政策方面，随着上半年物价回升迹象逐步显现，政策主线有望从“托底增长”逐步过渡至“巩固价格回升态势与盈利修复传导”。后续仍需持续观察价格端改善的持续性、财政脉冲向企业盈利传导的实际斜率，以及中报密集披露期市场对盈利修复的验证情况。

风格层面，在半年报和三季度高频数据逐步披露的窗口期，市场对“确定性”“股东回报”以及“盈利质量”的关注预计仍将维持。高质量、高成长资产在确定性相对稀缺的环境下，仍更容易获得市场资金青睐；科技成长与新质生产力方向在经历二季度上涨后，也将面临市场对于业绩兑现、产业化壁垒及国产替代逻辑的进一步检验，预计板块内部的“马太效应”仍将较为明显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管

人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构。本基金管理人估值委员和估值人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红中证全指指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,436,737.48	183,291,176.09
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	48,046,726.69	109,978,281.00
其中：股票投资		48,046,726.69	109,978,281.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		14,398.19	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		53,497,862.36	293,269,457.09
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,289,676.33	-
应付管理人报酬		36,082.21	96,295.72
应付托管费		4,510.27	12,036.96
应付销售服务费		7,594.55	26,719.65
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	71,064.64	5,039.36
负债合计		2,408,928.00	140,091.69
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	47,963,306.80	292,281,314.11
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,125,627.56	848,051.29
净资产合计		51,088,934.36	293,129,365.40
负债和净资产总计		53,497,862.36	293,269,457.09

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 47,963,306.80 份，其中东方红中证全指指数增强 A 基金份额总额 29,056,751.47 份，基金份额净值 1.0661 元；东方红中证全指指数增强 C 基金份额总额 18,906,555.33 份，基金份额净值 1.0637 元。

6.2 利润表

会计主体：东方红中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,730,347.40
1. 利息收入		18,443.02
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,443.02
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,364,705.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	10,810,878.38
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	553,827.42
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-655,995.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	3, 194. 53
减：二、营业总支出		635, 273. 28
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	422, 747. 36
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	52, 843. 48
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	92, 547. 02
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	67, 135. 42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10, 095, 074. 12
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10, 095, 074. 12
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		10, 095, 074. 12

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 16 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年，本报表无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：东方红中证全指指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	292, 281, 314. 11	848, 051. 29	293, 129, 365. 40
二、本期期初净资产	292, 281, 314. 11	848, 051. 29	293, 129, 365. 40
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-244, 318, 007. 31	2, 277, 576. 27	-242, 040, 431. 04
（一）、综合收益总额	-	10, 095, 074. 12	10, 095, 074. 12
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-244, 318, 007. 31	-7, 817, 497. 85	-252, 135, 505. 16
其中：1. 基金申购款	16, 081, 950. 31	656, 889. 36	16, 738, 839. 67

2. 基金赎回款	-260,399,957.62	-8,474,387.21	-268,874,344.83
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	47,963,306.80	3,125,627.56	51,088,934.36

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 16 日，截止报告期末本基金合同生效未满一年，本报无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>成飞</u>	<u>汤琳</u>	<u>陈培</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方红中证全指指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《东方红中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2025]2228 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 292,281,314.11 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（25）第 00426 号验资报告。基金合同于 2025 年 12 月 16 日正式生效。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《东方红中证全指指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、

债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款等）、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产（含存托凭证）的比例不低于基金资产的 80%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（a）金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

（b）金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

（a）金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

（b）金融工具的后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

（c）金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和

报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（d）金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金管理人可每月对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配；

3、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每月进行收益分配。评价时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告。若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

4、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取销售服务费情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润和基金份额净值增长率将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可以在履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活

跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票,根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》,在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关

于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。对本基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个

人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,284,481.51
等于：本金	2,284,350.55
加：应计利息	130.96
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	3,152,255.97
等于：本金	3,152,211.92
加：应计利息	44.05
合计	5,436,737.48

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		47,714,279.31	-	48,046,726.69	332,447.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		47,714,279.31	-	48,046,726.69	332,447.38

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	70,974.04
其他	90.60
合计	71,064.64

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东方红中证全指指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	130,074,135.10	130,074,135.10
本期申购	6,121,363.43	6,121,363.43
本期赎回（以“-”号填列）	-107,138,747.06	-107,138,747.06
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,056,751.47	29,056,751.47

东方红中证全指指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,207,179.01	162,207,179.01
本期申购	9,960,586.88	9,960,586.88
本期赎回（以“-”号填列）	-153,261,210.56	-153,261,210.56
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	18,906,555.33	18,906,555.33

注：1、本基金合同生效日为 2025 年 12 月 16 日。本基金(A 类)在募集期间有效净认购资金共计 130,051,211.77 元，折合基金份额 130,051,211.77 份，产生的利息收入 22,923.33 元，折合基金份额 22,923.33 份，划入基金份额持有人账户；本基金(C 类)在募集期间有效净认购资金共计

162,168,046.34 元，折合基金份额 162,168,046.34 份，产生的利息收入 39,132.67 元，折合基金份额 39,132.67 份，划入基金份额持有人账户。

2、申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

东方红中证全指指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-50,590.10	439,897.51	389,307.41
本期期初	-50,590.10	439,897.51	389,307.41
本期利润	6,363,603.93	-1,119,551.28	5,244,052.65
本期基金份额交易产生的变动数	-3,276,325.78	-435,903.65	-3,712,229.43
其中：基金申购款	428,289.93	-138,404.33	289,885.60
基金赎回款	-3,704,615.71	-297,499.32	-4,002,115.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,036,688.05	-1,115,557.42	1,921,130.63

东方红中证全指指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-89,801.94	548,545.82	458,743.88
本期期初	-89,801.94	548,545.82	458,743.88
本期利润	4,387,466.14	463,555.33	4,851,021.47
本期基金份额交易产生的变动数	-2,368,090.08	-1,737,178.34	-4,105,268.42
其中：基金申购款	466,528.14	-99,524.38	367,003.76
基金赎回款	-2,834,618.22	-1,637,653.96	-4,472,272.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,929,574.12	-725,077.19	1,204,496.93

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,451.92
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,981.02
结算备付金利息收入	-
其他	10.08
合计	18,443.02

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,810,878.38
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	10,810,878.38

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	455,397,246.93
减：卖出股票成本总额	444,051,573.27
减：交易费用	534,795.28
买卖股票差价收入	10,810,878.38

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	553,827.42
其中：证券出借权益补偿收	-

入	
基金投资产生的股利收益	-
合计	553,827.42

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-655,995.95
股票投资	-655,995.95
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	-655,995.95

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,993.09
基金转换费收入	201.44
合计	3,194.53

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	8,926.92
信息披露费	57,007.76
证券出借违约金	-
存托服务费	0.74
其他	1,200.00
合计	67,135.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司（“东证资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	422,747.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	200,834.10
应支付基金管理人的净管理费	221,913.26

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	52,843.48

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红中证全指指数 增强 A	东方红中证全指指数 增强 C	合计
东证资管	-	209.52	209.52
合计	-	209.52	209.52

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
华夏银行	2,284,481.51	12,451.92

注：1、本基金的上述银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金的第三方存管户资金为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金，

按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层面设立全面风险管理委员会，负责指导、协调和监督各

职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放日内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率

敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,436,737.48	-	-	-	-	-5,436,737.48	
交易性金融资产	-	-	-	-	-	48,046,726.69	48,046,726.69
应收申购款	10,000.44	-	-	-	-	4,397.75	14,398.19
资产总计	5,446,737.92	-	-	-	-	48,051,124.44	53,497,862.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,289,676.33	2,289,676.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,082.21	36,082.21
应付托管费	-	-	-	-	-	4,510.27	4,510.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,594.55	7,594.55
其他负债	-	-	-	-	-	71,064.64	71,064.64
负债总计	-	-	-	-	-	2,408,928.00	2,408,928.00
利率敏感度缺口	5,446,737.92	-	-	-	-	45,642,196.44	51,088,934.36
上年度末 2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	183,291,176.09	-	-	-	-	-	183,291,176.09
交易性金融资产	-	-	-	-	-	109,978,281.00	109,978,281.00
资产总计	183,291,176.09	-	-	-	-	109,978,281.00	293,269,457.09
负债							
应付管理人报	-	-	-	-	-	96,295.72	96,295.72

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	12,036.96	12,036.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-	26,719.65	26,719.65
其他负债	-	-	-	-	-	5,039.36	5,039.36
负债总计	-	-	-	-	-	140,091.69	140,091.69
利率敏感度缺口	183,291,176.09	-	-	-	-	109,838,189.31	293,129,365.40

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资 (2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	48,046,726.69	94.05	109,978,281.00	37.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产－贵金属投资	－	－	－	－
衍生金融资产－权证投资	－	－	－	－
其他	－	－	－	－
合计	48,046,726.69	94.05	109,978,281.00	37.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	2,293,947.71	5,453,060.64
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-2,293,947.71	-5,453,060.64

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	48,046,726.69	109,237,240.00
第二层次	—	741,041.00
第三层次	—	—
合计	48,046,726.69	109,978,281.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	48,046,726.69	89.81
	其中：股票	48,046,726.69	89.81
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	5,436,737.48	10.16
8	其他各项资产	14,398.19	0.03
9	合计	53,497,862.36	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资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	85,680.00	0.17
B	采矿业	2,512,977.00	4.92
C	制造业	31,238,554.99	61.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,511,111.00	2.96
E	建筑业	868,126.00	1.70
F	批发和零售业	683,745.00	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	334,865.00	0.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,292,211.30	6.44
J	金融业	4,946,978.00	9.68
K	房地产业	536,368.00	1.05
L	租赁和商务服务业	327,749.00	0.64
M	科学研究和技术服务业	942,077.40	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	654,860.00	1.28
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	47,935,302.69	93.83

7.2.2 报告期末积极投资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	111,424.00	0.22
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	111,424.00	0.22

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300308	中际旭创	1,100	1,397,000.00	2.73
2	300502	新易盛	1,620	983,340.00	1.92
3	300750	宁德时代	2,000	786,020.00	1.54
4	601318	中国平安	13,800	658,812.00	1.29
5	601899	紫金矿业	22,300	560,622.00	1.10
6	600030	中信证券	17,900	514,267.00	1.01
7	600900	长江电力	19,400	513,518.00	1.01
8	000333	美的集团	6,500	490,945.00	0.96

9	688256	寒武纪	298	475,473.90	0.93
10	002384	东山精密	1,800	472,230.00	0.92
11	601166	兴业银行	27,900	462,024.00	0.90
12	688981	中芯国际	2,900	460,578.00	0.90
13	002371	北方华创	500	442,280.00	0.87
14	601398	工商银行	61,800	436,926.00	0.86
15	300274	阳光电源	2,700	429,354.00	0.84
16	601288	农业银行	63,700	386,659.00	0.76
17	002475	立讯精密	5,200	366,080.00	0.72
18	600519	贵州茅台	300	355,647.00	0.70
19	002463	沪电股份	2,300	351,440.00	0.69
20	605069	正和生态	21,000	346,080.00	0.68
21	002415	海康威视	9,900	338,580.00	0.66
22	601088	中国神华	8,400	327,936.00	0.64
23	603986	兆易创新	400	326,000.00	0.64
24	300394	天孚通信	1,060	320,840.80	0.63
25	601138	工业富联	4,400	317,460.00	0.62
26	688045	必易微	3,900	315,042.00	0.62
27	600887	伊利股份	13,100	313,876.00	0.61
28	601988	中国银行	54,600	312,312.00	0.61
29	601939	建设银行	32,200	310,086.00	0.61
30	002963	豪尔赛	14,500	305,370.00	0.60
31	605366	宏柏新材	23,000	299,690.00	0.59
32	600176	中国巨石	4,100	298,808.00	0.58
33	688685	迈信林	5,300	290,970.00	0.57
34	600885	宏发股份	8,400	289,716.00	0.57
35	600941	中国移动	3,300	284,229.00	0.56
36	600028	中国石化	63,700	284,102.00	0.56
37	000166	申万宏源	64,000	281,600.00	0.55
38	002182	宝武镁业	18,000	280,260.00	0.55
39	300124	汇川技术	4,200	278,586.00	0.55
40	002028	思源电气	1,600	276,800.00	0.54
41	688595	芯海科技	6,300	276,318.00	0.54
42	688138	清溢光电	5,800	272,600.00	0.53
43	300686	智动力	15,100	271,951.00	0.53
44	002736	国信证券	27,200	271,728.00	0.53
45	000157	中联重科	38,600	269,042.00	0.53
46	603991	领先股份	1,900	268,185.00	0.52
47	688061	灿瑞科技	5,300	263,251.00	0.52
48	301257	普蕊斯	5,800	263,204.00	0.52
49	601665	齐鲁银行	44,400	256,188.00	0.50
50	000651	格力电器	6,800	255,000.00	0.50
51	601058	赛轮轮胎	21,900	252,507.00	0.49

52	301119	正强股份	10,100	247,854.00	0.49
53	603088	宁波精达	24,000	241,440.00	0.47
54	002049	紫光国微	2,700	239,625.00	0.47
55	002225	濮耐股份	50,500	238,865.00	0.47
56	002643	万润股份	11,400	238,830.00	0.47
57	003816	中国广核	60,900	238,119.00	0.47
58	601018	宁波港	74,700	235,305.00	0.46
59	688620	安凯微	14,400	233,280.00	0.46
60	600795	国电电力	49,800	232,566.00	0.46
61	301221	光庭信息	7,800	230,178.00	0.45
62	603703	盛洋科技	20,200	224,220.00	0.44
63	300316	晶盛机电	3,700	223,480.00	0.44
64	600517	国网英大	47,600	222,768.00	0.44
65	600307	酒钢宏兴	154,200	214,338.00	0.42
66	002601	龙佰集团	13,000	214,240.00	0.42
67	300842	帝科股份	2,400	214,008.00	0.42
68	002861	瀛通通讯	9,600	213,888.00	0.42
69	688329	艾隆科技	10,555	213,316.55	0.42
70	000975	山金国际	12,500	212,500.00	0.42
71	688311	盟升电子	8,000	209,520.00	0.41
72	301180	万祥科技	16,500	206,745.00	0.40
73	000338	潍柴动力	7,500	204,375.00	0.40
74	002084	海鸥住工	58,700	204,276.00	0.40
75	002422	科伦药业	5,300	204,156.00	0.40
76	000935	四川双马	7,700	200,893.00	0.39
77	002025	航天电器	2,600	198,172.00	0.39
78	003030	祖名股份	9,600	197,280.00	0.39
79	000757	浩物股份	57,800	197,098.00	0.39
80	301037	保立佳	16,400	196,800.00	0.39
81	600926	杭州银行	13,600	196,520.00	0.38
82	688653	康希通信	11,300	196,394.00	0.38
83	688272	富吉瑞	4,400	195,360.00	0.38
84	600871	石化油服	95,700	194,271.00	0.38
85	688689	银河微电	3,000	194,160.00	0.38
86	603993	洛阳钼业	10,900	191,295.00	0.37
87	301397	溯联股份	5,900	190,924.00	0.37
88	300749	顶固集创	7,000	187,950.00	0.37
89	603259	药明康德	1,500	186,765.00	0.37
90	300408	三环集团	1,100	183,590.00	0.36
91	600515	海南机场	67,000	183,580.00	0.36
92	688130	晶华微	6,500	182,780.00	0.36
93	600100	同方股份	26,600	182,210.00	0.36
94	002247	聚力文化	86,000	181,460.00	0.36

95	600690	海尔智家	8,800	179,608.00	0.35
96	301169	零点有数	2,500	176,650.00	0.35
97	600577	精达股份	18,000	176,040.00	0.34
98	600159	大龙地产	79,600	175,916.00	0.34
99	600774	汉商集团	27,900	174,654.00	0.34
100	688376	美埃科技	1,500	174,450.00	0.34
101	603058	永吉股份	19,900	173,329.00	0.34
102	301279	金道科技	7,900	171,667.00	0.34
103	300767	震安科技	7,700	171,633.00	0.34
104	301272	英华特	5,100	167,994.00	0.33
105	002273	水晶光电	4,700	166,756.00	0.33
106	688173	希荻微	8,700	166,518.00	0.33
107	002338	奥普光电	2,900	165,880.00	0.32
108	600893	航发动力	4,300	164,862.00	0.32
109	601688	华泰证券	7,900	162,898.00	0.32
110	603019	中科曙光	1,500	160,845.00	0.31
111	688480	赛恩斯	1,800	157,662.00	0.31
112	601857	中国石油	18,100	157,108.00	0.31
113	600202	哈空调	34,900	156,352.00	0.31
114	600183	生益科技	900	156,060.00	0.31
115	002609	捷顺科技	20,400	155,448.00	0.30
116	605056	咸亨国际	9,700	155,200.00	0.30
117	000970	中科三环	10,200	154,938.00	0.30
118	000017	深中华 A	25,300	154,836.00	0.30
119	688209	英集芯	5,300	154,124.00	0.30
120	688521	芯原股份	400	148,456.00	0.29
121	688041	海光信息	400	148,120.00	0.29
122	301280	珠城科技	2,900	146,653.00	0.29
123	600352	浙江龙盛	12,000	145,320.00	0.28
124	002259	升达林业	38,200	144,778.00	0.28
125	002206	海利得	28,000	144,760.00	0.28
126	600773	西藏城投	11,200	144,144.00	0.28
127	688150	莱特光电	2,100	144,102.00	0.28
128	300661	圣邦股份	1,000	143,480.00	0.28
129	301580	爱迪特	2,220	142,812.60	0.28
130	002001	新和成	5,000	142,100.00	0.28
131	600566	济川药业	6,400	142,016.00	0.28
132	600036	招商银行	4,000	142,000.00	0.28
133	002020	京新药业	11,300	141,137.00	0.28
134	000425	徐工机械	17,100	138,339.00	0.27
135	000607	华媒控股	43,700	134,159.00	0.26
136	603063	禾望电气	2,500	132,225.00	0.26
137	300774	倍杰特	12,200	131,150.00	0.26

138	001311	多利科技	8,100	130,653.00	0.26
139	301133	金钟股份	3,400	129,880.00	0.25
140	300005	探路者	5,700	128,820.00	0.25
141	688153	唯捷创芯	4,000	128,480.00	0.25
142	300855	图南股份	4,100	128,166.00	0.25
143	002532	天山铝业	11,900	127,687.00	0.25
144	301326	捷邦科技	900	125,433.00	0.25
145	688510	航亚科技	5,200	124,176.00	0.24
146	688607	康众医疗	2,400	122,400.00	0.24
147	601881	中国银河	9,700	121,929.00	0.24
148	688709	成都华微	3,200	121,888.00	0.24
149	600025	华能水电	13,700	121,793.00	0.24
150	600815	厦工股份	47,300	121,561.00	0.24
151	601600	中国铝业	14,600	120,012.00	0.23
152	300689	澄天伟业	1,700	119,306.00	0.23
153	600489	中金黄金	6,600	119,130.00	0.23
154	600703	三安光电	5,600	118,832.00	0.23
155	001373	翔腾新材	3,900	117,585.00	0.23
156	600426	华鲁恒升	4,900	117,208.00	0.23
157	603289	泰瑞机器	14,500	117,015.00	0.23
158	603920	世运电路	2,400	115,296.00	0.23
159	600938	中国海油	4,200	114,030.00	0.22
160	000411	英特集团	12,600	113,778.00	0.22
161	688680	海优新材	2,700	113,400.00	0.22
162	688279	峰昭科技	500	112,220.00	0.22
163	300806	斯迪克	1,000	112,000.00	0.22
163	601399	国机重装	32,000	112,000.00	0.22
165	600641	先导基电	2,800	111,608.00	0.22
166	688372	伟测科技	600	111,600.00	0.22
167	000603	盛达资源	4,800	110,880.00	0.22
168	000933	神火股份	5,200	110,240.00	0.22
169	603336	宏辉果蔬	13,700	108,504.00	0.21
170	688252	天德钰	4,500	108,000.00	0.21
171	688651	盛邦安全	3,300	106,326.00	0.21
172	000100	TCL 科技	17,900	104,178.00	0.20
173	300476	胜宏科技	300	103,929.00	0.20
174	301027	华蓝集团	5,000	103,450.00	0.20
175	001268	联合精密	2,900	102,718.00	0.20
176	002135	东南网架	15,100	102,529.00	0.20
177	301228	实朴检测	1,300	101,608.00	0.20
178	600023	浙能电力	19,100	100,466.00	0.20
179	688539	高华科技	3,100	98,828.00	0.19
180	301286	侨源股份	1,700	98,583.00	0.19

181	002817	黄山胶囊	16,800	98,448.00	0.19
182	300650	太龙股份	6,700	97,351.00	0.19
183	600019	宝钢股份	17,700	96,111.00	0.19
184	002392	北京利尔	11,800	95,226.00	0.19
185	000761	本钢板材	43,900	94,385.00	0.18
186	002595	豪迈科技	2,000	93,200.00	0.18
187	601390	中国中铁	22,300	92,991.00	0.18
188	688038	中科通达	5,500	92,510.00	0.18
189	300991	创益通	2,600	91,546.00	0.18
190	688683	莱尔科技	2,400	91,008.00	0.18
191	301536	星辰科技	700	90,097.00	0.18
192	300246	宝莱特	6,400	90,048.00	0.18
193	000893	亚钾国际	2,200	89,958.00	0.18
194	601328	交通银行	13,900	89,377.00	0.17
195	301359	东南电子	5,500	87,340.00	0.17
196	603867	新化股份	2,600	87,074.00	0.17
197	000663	永安林业	16,800	85,680.00	0.17
198	300423	昇辉科技	15,200	83,752.00	0.16
199	600981	苏豪汇鸿	37,200	83,700.00	0.16
200	688556	高测股份	6,300	83,664.00	0.16
201	300393	中来股份	11,400	83,106.00	0.16
202	600671	天目药业	4,900	82,712.00	0.16
203	603391	力聚热能	1,500	81,570.00	0.16
204	601168	西部矿业	2,900	78,706.00	0.15
205	603067	振华股份	1,700	78,693.00	0.15
206	000850	华茂股份	21,400	75,114.00	0.15
207	300938	信测标准	1,480	73,822.40	0.14
208	301382	蜂助手	1,600	73,600.00	0.14
209	688536	思瑞浦	200	72,818.00	0.14
210	002875	安奈儿	4,900	72,814.00	0.14
211	301418	协昌科技	1,300	72,644.00	0.14
212	600115	中国东航	19,000	72,390.00	0.14
213	300713	英可瑞	5,600	71,344.00	0.14
214	688385	复旦微电	1,000	71,290.00	0.14
215	601117	中国化学	9,600	70,560.00	0.14
216	002666	德联集团	17,800	70,310.00	0.14
217	002062	宏润建设	9,800	70,168.00	0.14
218	603879	永悦科技	15,300	69,156.00	0.14
219	002841	视源股份	2,000	69,060.00	0.14
220	603980	吉华集团	10,300	68,392.00	0.13
221	300417	南华仪器	6,600	67,716.00	0.13
222	300458	全志科技	1,700	67,082.00	0.13
223	301510	固高科技	2,100	67,053.00	0.13

224	600418	江淮汽车	2,500	64,575.00	0.13
225	600968	海油发展	19,200	63,936.00	0.13
226	688573	信宇人	3,600	63,792.00	0.12
227	300990	同飞股份	600	63,042.00	0.12
228	601137	博威合金	2,800	62,524.00	0.12
229	600177	雅戈尔	8,300	62,499.00	0.12
230	300979	华利集团	2,100	62,475.00	0.12
231	688486	龙迅股份	980	62,308.40	0.12
232	002768	国恩股份	1,184	61,639.04	0.12
233	601985	中国核电	6,700	60,501.00	0.12
234	000951	中国重汽	3,100	60,481.00	0.12
235	002663	普邦股份	39,400	58,706.00	0.11
236	301390	经纬股份	1,800	58,068.00	0.11
237	002268	电科网安	4,500	58,050.00	0.11
238	300412	迦南科技	12,600	57,456.00	0.11
239	603219	富佳股份	3,600	56,088.00	0.11
240	600219	南山铝业	14,000	55,860.00	0.11
241	300585	奥联电子	3,400	55,522.00	0.11
242	000988	华工科技	300	55,383.00	0.11
243	301093	华兰股份	400	54,252.00	0.11
244	605287	德才股份	1,300	53,937.00	0.11
245	000932	华菱钢铁	15,500	53,785.00	0.11
246	002790	瑞尔特	10,100	53,732.00	0.11
247	601106	中国一重	15,900	52,470.00	0.10
248	600800	渤海化学	15,900	51,357.00	0.10
249	603818	曲美家居	17,000	50,490.00	0.10
250	301608	博实结	1,000	50,260.00	0.10
251	603615	茶花股份	3,100	50,065.00	0.10
252	000423	东阿阿胶	1,100	49,896.00	0.10
253	300369	绿盟科技	9,000	48,960.00	0.10
254	600271	航天信息	7,300	48,034.00	0.09
255	000683	博源化工	8,300	47,808.00	0.09
256	600201	生物股份	4,100	47,765.00	0.09
257	301429	森泰股份	3,000	47,010.00	0.09
258	605068	明新旭腾	2,800	46,984.00	0.09
259	605151	西上海	2,600	45,786.00	0.09
260	300467	迅游科技	1,200	44,616.00	0.09
261	600645	中源协和	2,600	44,486.00	0.09
262	300051	珩升科技	5,000	43,800.00	0.09
263	688046	药康生物	1,800	43,560.00	0.09
264	601377	兴业证券	7,000	42,280.00	0.08
265	000782	恒申新材	5,000	40,400.00	0.08
266	600959	江苏有线	13,600	39,304.00	0.08

267	600048	保利发展	8,300	38,429.00	0.08
268	605339	南侨食品	3,200	38,208.00	0.07
269	002197	证通电子	6,600	37,884.00	0.07
270	601225	陕西煤业	1,800	36,630.00	0.07
271	601061	中信金属	3,400	36,618.00	0.07
272	600886	国投电力	2,700	35,937.00	0.07
273	002921	联诚精密	1,300	35,542.00	0.07
274	688659	元琛科技	3,400	35,496.00	0.07
275	000807	云铝股份	1,600	35,424.00	0.07
276	600346	恒力石化	2,000	35,420.00	0.07
277	688199	久日新材	1,000	34,530.00	0.07
278	688157	松井股份	1,300	34,307.00	0.07
279	688118	普元信息	1,700	34,204.00	0.07
280	300604	长川科技	100	34,142.00	0.07
281	000739	普洛药业	2,000	33,320.00	0.07
282	688244	永信至诚	2,300	32,798.00	0.06
283	600901	江苏金租	5,700	32,775.00	0.06
284	688125	安达智能	200	32,700.00	0.06
285	000923	河钢资源	2,600	32,266.00	0.06
286	601628	中国人寿	900	31,815.00	0.06
287	688378	奥来德	500	31,000.00	0.06
288	600039	四川路桥	3,900	30,498.00	0.06
289	600399	抚顺特钢	7,400	30,414.00	0.06
290	601798	蓝科高新	4,200	30,408.00	0.06
291	000758	中色股份	4,500	29,565.00	0.06
292	600366	宁波韵升	1,900	27,892.00	0.05
293	600098	广州发展	4,700	27,777.00	0.05
294	603196	璞源材料	1,100	26,884.00	0.05
295	688737	中自科技	1,400	26,796.00	0.05
296	300980	祥源新材	900	26,469.00	0.05
297	300169	天晟新材	5,300	26,447.00	0.05
298	000007	全新好	2,100	26,040.00	0.05
299	000050	深天马 A	2,500	24,775.00	0.05
300	000596	古井贡酒	300	23,940.00	0.05
301	300049	福瑞医科	600	23,328.00	0.05
302	688283	坤恒顺维	700	23,177.00	0.05
303	600316	洪都航空	800	22,352.00	0.04
304	002444	巨星科技	700	21,770.00	0.04
305	000006	深振业 A	2,800	20,944.00	0.04
306	002700	万懋能源	3,300	20,526.00	0.04
307	300036	超图软件	1,800	20,286.00	0.04
308	000895	双汇发展	900	20,160.00	0.04
309	001230	劲旅环境	1,300	19,968.00	0.04

310	300572	安车检测	700	19,859.00	0.04
311	300146	汤臣倍健	2,000	18,080.00	0.04
312	002988	豪美新材	800	17,648.00	0.03
313	002027	分众传媒	3,500	16,940.00	0.03
314	301602	超研股份	1,200	16,488.00	0.03
315	301117	佳缘科技	700	16,345.00	0.03
316	603089	正裕工业	1,900	15,865.00	0.03
317	300968	格林精密	1,600	15,424.00	0.03
318	600027	华电国际	3,400	15,130.00	0.03
319	600448	华纺股份	6,000	15,120.00	0.03
320	600216	浙江医药	1,300	14,820.00	0.03
321	300201	海伦哲	700	14,749.00	0.03
322	300006	莱美药业	2,800	14,364.00	0.03
323	002110	三钢闽光	4,900	14,112.00	0.03
324	600919	江苏银行	1,300	14,014.00	0.03
325	301125	腾亚精工	900	12,924.00	0.03
326	688226	威腾电气	300	12,849.00	0.03
327	301138	华研精机	400	12,400.00	0.02
328	600575	淮河能源	3,500	11,165.00	0.02
329	300277	汽轮科技	700	10,528.00	0.02
330	603306	华懋科技	100	10,369.00	0.02
331	000032	深桑达 A	400	9,980.00	0.02
332	300224	正海磁材	700	9,331.00	0.02
333	300405	科隆股份	1,800	9,324.00	0.02
334	601111	中国国航	1,500	9,075.00	0.02
335	001979	招商蛇口	1,300	8,359.00	0.02
336	688152	麒麟信安	300	8,244.00	0.02
337	002397	梦洁股份	2,000	7,640.00	0.01
338	600009	上海机场	300	6,930.00	0.01
339	002252	上海莱士	1,000	4,340.00	0.01
340	001914	招商积余	400	3,264.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	603268	松发股份	800	111,424.00	0.22

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	2,426,340.00	0.83

2	300750	宁德时代	1,752,188.00	0.60
3	601166	兴业银行	1,723,177.00	0.59
4	601398	工商银行	1,712,056.00	0.58
5	600276	恒瑞医药	1,674,611.54	0.57
6	600919	江苏银行	1,664,841.00	0.57
7	600150	中国船舶	1,621,452.00	0.55
8	600030	中信证券	1,564,492.00	0.53
9	000001	平安银行	1,538,999.00	0.53
10	601288	农业银行	1,414,499.00	0.48
11	002028	思源电气	1,411,032.00	0.48
12	601328	交通银行	1,410,595.00	0.48
13	002475	立讯精密	1,407,592.00	0.48
14	300274	阳光电源	1,378,652.76	0.47
15	601318	中国平安	1,377,244.00	0.47
16	600900	长江电力	1,371,450.00	0.47
17	002415	海康威视	1,300,619.00	0.44
18	603259	药明康德	1,276,973.00	0.44
19	688610	埃科光电	1,257,923.29	0.43
20	000725	京东方 A	1,240,205.00	0.42

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	3,696,889.00	1.26
2	600036	招商银行	2,715,594.00	0.93
3	600519	贵州茅台	2,664,953.00	0.91
4	601318	中国平安	2,423,717.00	0.83
5	300308	中际旭创	2,354,733.00	0.80
6	600183	生益科技	2,283,643.00	0.78
7	601398	工商银行	2,264,326.00	0.77
8	603259	药明康德	2,230,089.00	0.76
9	601899	紫金矿业	2,077,453.00	0.71
10	600900	长江电力	2,011,729.00	0.69
11	600276	恒瑞医药	1,971,164.00	0.67
12	300059	东方财富	1,896,852.00	0.65
13	000333	美的集团	1,829,490.00	0.62
14	000408	藏格矿业	1,817,692.00	0.62
15	600919	江苏银行	1,792,056.00	0.61
16	600030	中信证券	1,751,980.00	0.60
17	300502	新易盛	1,744,091.00	0.59
18	601288	农业银行	1,738,423.00	0.59

19	601328	交通银行	1,677,363.99	0.57
20	601088	中国神华	1,666,010.00	0.57

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	382,776,014.91
卖出股票收入（成交）总额	455,397,246.93

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并通过对证券市场和期货市场运行趋势的研判，结合对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，以对冲系统性风险和流动性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约，在风险可控的前提下，参与国债期货投资。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,398.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,398.19

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
东方红中 证全指指 数增强 A	520	55,878.37	13,325.80	0.05	29,043,425.67	99.95
东方红中 证全指指 数增强 C	419	45,123.04	0.00	0.00	18,906,555.33	100.00
合计	939	51,079.13	13,325.80	0.03	47,949,981.00	99.97

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	东方红中证全指指数增强 A	64,174.82	0.22
	东方红中证全指指数增强 C	—	—
	合计	64,174.82	0.13

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研究部门	东方红中证全指指数增强 A	0~10
	东方红中证全指指数增强 C	0

负责人持有本开放式基金		
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红中证全指指数增强 A	0
	东方红中证全指指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红中证全指指数增强 A	东方红中证全指指数增强 C
基金合同生效日 （2025 年 12 月 16 日）基金份额总额	130,074,135.10	162,207,179.01
本报告期期初基金份额总额	130,074,135.10	162,207,179.01
本报告期基金总申购份额	6,121,363.43	9,960,586.88
减：本报告期基金总赎回份额	107,138,747.06	153,261,210.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,056,751.47	18,906,555.33

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未发生基金份额持有人大会决议事项。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 3 月 12 日发布公告，朱绍纲先生自 2026 年 3 月 9 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，陈秀良先生自 2026 年 3 月 16 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部总经理。

本报告期内，本基金托管人于 2026 年 6 月 22 日发布公告，赵伟婧女士自 2026 年 6 月 22 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人基金投资业务、基金财产的重大诉讼。
本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内本基金未发生改聘会计师事务所的情形。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人未有受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
金融街证券	2	824,464,620.66	98.36	243,624.55	96.16	—
中信建投证券	2	13,708,641.18	1.64	9,718.76	3.84	—
东北证券	2	—	—	—	—	—

注：1、本基金采用委托证券公司办理交易模式，不适用单个证券公司交易佣金的比例限制，上述数据为本基金通过相应证券公司办理交易的相关数据。

2、证券公司的选择标准和程序

(1) 选择标准

证券公司财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的合规风控能力和交易服务能力；针对除被动股票型基金外的其余基金将研究服务能力纳入考量。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同证券公司进行综合评价和选择，与其签订经纪服务协议。

3、本基金本报告期内委托办理交易的证券公司无变更。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
金融街证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方红中证全指指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 12 日
2	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 30 日
3	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排更新的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
4	东方红中证全指指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
5	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排更新的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 5 月 21 日
6	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排更新的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红中证全指指数增强型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红中证全指指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红中证全指指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 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。

12.2 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。

12.3 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

2026 年 8 月 31 日