东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 5
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 6

§4 管理人报告 7

4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 8
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 9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 10
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 10

§5 托管人报告 10

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 10
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 10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 10

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 11

6.1 资产负债表 11
6.2 利润表 12
6.3 净资产变动表 13
6.4 报表附注 15

§7 投资组合报告 35

7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 35
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 36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
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 40
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 41
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 41

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 41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41
7.12 投资组合报告附注 41
§8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 盈利投资者数量占比 42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
8.4 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 42
§9 开放式基金份额变动 42
§10 重大事件揭示 43
10.1 基金份额持有人大会决议 43
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 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 43
10.4 基金投资策略的改变 43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 43
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 43
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 44
10.8 其他重大事件 47
§11 影响投资者决策的其他重要信息 47
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 47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 47
§12 备查文件目录 47
12.1 备查文件目录 47
12.2 存放地点 48
12.3 查阅方式 48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	东方红睿丰混合
场内简称	东方红睿丰 LOF
基金主代码	169101
基金运作方式	契约型开放式，本基金基金合同生效后，封闭期为三年（含三年），封闭期届满后转换为上市开放式基金（LOF）
基金合同生效日	2014 年 9 月 19 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
报告期末基金份额总额	973,975,389.25 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 3 月 6 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在有效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	本基金在中国经济增长模式转型的大背景下，寻找符合经济发展趋势的行业，积极把握由新型城镇化、人口结构调整、资源环境约束、产业升级、商业模式创新等大趋势带来的投资机会，挖掘重点行业中的优势个股，自下而上精选具有核心竞争优势的企业，分享转型期中国经济增长的成果，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周陶	张姗
	联系电话	021-53952888	400-61-95555
	电子邮箱	service@dfham.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	400-61-95555
传真		021-63326381	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码	200010	518040
法定代表人	杨斌	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	427,958,482.52
本期利润	561,465,670.61
加权平均基金份额本期利润	0.5881
本期加权平均净值利润率	25.26%
本期基金份额净值增长率	27.85%
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	1,203,601,588.76
期末可供分配基金份额利润	1.2358
期末基金资产净值	2,669,816,955.76
期末基金份额净值	2.741
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	445.06%

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

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	31.78%	2.37%	8.45%	0.88%	23.33%	1.49%
过去六个月	27.85%	2.13%	5.59%	0.79%	22.26%	1.34%
过去一年	103.94%	2.24%	17.83%	0.71%	86.11%	1.53%
过去三年	84.70%	1.75%	22.69%	0.77%	62.01%	0.98%
过去五年	12.89%	1.54%	0.53%	0.78%	12.36%	0.76%
过去七年	97.05%	1.50%	26.73%	0.81%	70.32%	0.69%
过去十年	212.80%	1.41%	33.16%	0.78%	179.64%	0.63%
自基金合同生效起至今	445.06%	1.47%	41.05%	0.72%	404.01%	0.75%

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



§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		
刘辉	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金经理	2023 年 2 月 4 日	-	20 年	上海东方证券资产管理有限公司董事总经理、基金经理，2023 年 02 月至今任东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理、2026 年 02 月至今任东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2026 年 04 月至今任东方红成长先锋混合型证券投资基金基金经理。阿德莱德大学应用金融学专业硕士。曾任华泰证券股份有限公司分析师，东吴基金管理有限公司研究员，汇丰晋信基金管理有限公司研究员、基金经理，嘉实基金管理有限公司基金经理，上投摩根基金管理有限公司基金经理。具备证券投资基金从业资格。

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日（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

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 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，A 股市场的结构性特征比较明显。一方面，以人工智能为代表的新兴产业出现了较大幅度的上涨。而另一方面，与传统经济密切相关的产业和公司股价则出现了明显的下跌。资本市场在投资方向的选择上，出现了极致的分化，并引发了市场的广泛讨论。面对这样显著分化的结构性行情，经过审慎、深入的研究后，本基金依然选择了继续坚持重点投资以 AI 为代表的新兴产业。面对科技产业的创新性发展，大量的社会资本涌入该领域，进而激发了很大的投资热情。我们认为在外在条件没有发生明显改变的前提下，上述的结构性变化很有可能是未来的常态。事实上，纵观海外美股的近些年走势，K 型分化不仅体现在宏观里，也在其资本市场得以长期演绎。因此，尽管未来股市可能会出现阶段性的再平衡，但是我们依然选择继续对以 AI 为代表的新兴产业进行重点投资和布局，希望可以取得相对较好的投资回报。

4.4.2 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 2.741 元，份额累计净值为 3.643 元。本报告期基金份额净值增长率为 27.85%，同期业绩比较基准收益率为 5.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，或许资本市场会担心美国云服务厂商的现金流转负情况进而担心 AI 资本开支能否持续，会担心中国开源模型的竞争性扰动，也会担心未来 AI 大模型调用价格下调的不利影响。但根据杰文斯悖论，价格的下降是所有新兴事物未来渗透率大幅普及的前提，同时开源模型的竞争也会导致美国闭源模型公司去增加研发投入和加快市场开拓的步伐。同时，面对未来 AI 算力的持续需求，考虑到三年时间就可以收回 AI 基建投资成本的高回报率，云服务厂商必然会继续加大其在资本开支上的投入，无论是需要以股权还是债券的形式去融资。因此，在具体投资方向上，我仍坚持看好人工智能行业的长期发展前景，认为 AI 将会深刻改变人类社会的发展进程。若干年后，人工智能必将会渗透到我们工作和生活的方方面面，而这将注定会是人类社会不可逆的发展趋势。虽然产业发展的进程中必然会出现一些波折或者干扰的因素，但是我们判断，伴随着 AI 智能体的渗透率逐步提升，我们必将会对此有着更加清晰的认知。最后，在 AI 领域之外，本基金依然会继续坚持投资于具备广阔成长空间的细分领域，力争为持有人取得相对较好的投资回报。

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历。

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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	348,421,276.83	184,867,914.05
结算备付金		4,932,751.52	4,267,932.11
存出保证金		1,111,827.50	894,890.17
交易性金融资产	6.4.7.2	2,397,579,970.13	1,960,301,662.02
其中：股票投资		2,395,557,908.09	1,960,301,662.02
基金投资		-	-
债券投资		2,022,062.04	-
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		66,780,370.08	35,186,667.35
应收股利		-	-
应收申购款		599,846.82	871,889.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,819,426,042.88	2,186,390,955.33
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		127,349,078.82	30,288,686.65
应付赎回款		16,344,672.76	8,698,148.14

应付管理人报酬		2,372,219.05	2,178,370.03
应付托管费		395,369.85	363,061.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.04	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,147,744.60	2,114,876.62
负债合计		149,609,087.12	43,643,143.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	973,975,389.25	999,349,696.19
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,695,841,566.51	1,143,398,116.01
净资产合计		2,669,816,955.76	2,142,747,812.20
负债和净资产总计		2,819,426,042.88	2,186,390,955.33

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.741 元，基金份额总额 973,975,389.25 份。

6.2 利润表

会计主体：东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		576,963,268.36	231,968,500.74
1.利息收入		418,220.89	205,709.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	418,220.89	205,709.27
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）		442,522,797.72	96,821,690.43
其中：股票投资收益	6.4.7.14	433,596,247.27	84,590,589.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	60.22	359,520.55
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	8,926,490.23	11,871,580.62

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	133,507,188.09	134,862,902.54
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	515,061.66	78,198.50
减：二、营业总支出		15,497,597.75	11,940,126.55
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	13,171,514.06	10,137,185.04
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	2,195,252.37	1,689,530.84
3．销售服务费		-	-
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		0.22	-
8．其他费用	6.4.7.23	130,831.10	113,410.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		561,465,670.61	220,028,374.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		561,465,670.61	220,028,374.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		561,465,670.61	220,028,374.19

6.3 净资产变动表

会计主体：东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	999,349,696.19	1,143,398,116.01	2,142,747,812.20
二、本期期初净资产	999,349,696.19	1,143,398,116.01	2,142,747,812.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号	-25,374,306.94	552,443,450.50	527,069,143.56

填列）			
（一）、综合收益总额	-	561,465,670.61	561,465,670.61
（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）	-25,374,306.94	-9,022,220.11	-34,396,527.05
其中：1.基金申购款	220,466,474.62	333,509,008.76	553,975,483.38
2.基金赎回款	-245,840,781.56	-342,531,228.87	-588,372,010.43
（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	973,975,389.25	1,695,841,566.51	2,669,816,955.76
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	1,390,054,488.06	252,947,065.71	1,643,001,553.77
二、本期期初净资产	1,390,054,488.06	252,947,065.71	1,643,001,553.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-87,440,211.54	195,488,606.81	108,048,395.27
（一）、综合收益总额	-	220,028,374.19	220,028,374.19
（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）	-87,440,211.54	-24,539,767.38	-111,979,978.92
其中：1.基金申购款	18,743,633.50	4,906,982.75	23,650,616.25
2.基金赎回款	-106,183,845.04	-29,446,750.13	-135,630,595.17
（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	1,302,614,276.52	448,435,672.52	1,751,049,949.04

产			

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：

成飞	汤琳	陈培
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

东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]720号《关于核准东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由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》和《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,609,220,897.11 元，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）信会师报字[2014]第 130627 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,610,160,711.75 份基金份额，其中认购资金利息折合 939,814.64 份基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金封闭期自基金合同生效之日起至三年后对应日的前一工作日止。本基金在封闭期内不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF），继续在深圳证券交易所上市交易。经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2015]88 号核准，本基金 31,401,059.00 份基金份额于 2015 年 3 月 6 日在深交所挂牌交易。对于托管在场外的基金份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定以及本基金的基金管理人于 2017 年 9 月 15 日发布的《关于东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金转为上市开放式基金（LOF）并变更基金名称的公告》，本基金自 2017 年 9 月 19 日起转型为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，并自转型之日起开始办理申

购、赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票及存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、债券（含中小企业私募债）、中期票据、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、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）。未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的，本基金可参与同业存单的投资，不需召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。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。本基金的投资比例为：本基金转换为上市开放式基金（LOF）后股票资产（含存托凭证）投资比例为基金资产的 0%—95%，封闭期内股票资产（含存托凭证）投资比例为基金资产的 0%—100%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；本基金转换为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终，在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

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

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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》、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》、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)对本基金从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。

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。

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。

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。

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	348,421,276.83
等于：本金	348,392,069.46
加：应计利息	29,207.37
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	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
合计	348,421,276.83

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		1,782,385,031.96	-	2,395,557,908.09	613,172,876.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,022,000.00	62.04	2,022,062.04	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,022,000.00	62.04	2,022,062.04	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,784,407,031.96	62.04	2,397,579,970.13	613,172,876.13

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	11,823.13
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,038,353.20
其中：交易所市场	3,038,353.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	97,568.27
合计	3,147,744.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	999,349,696.19	999,349,696.19
本期申购	220,466,474.62	220,466,474.62
本期赎回（以“-”号填列）	-245,840,781.56	-245,840,781.56
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	973,975,389.25	973,975,389.25

注：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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	788,996,986.41	354,401,129.60	1,143,398,116.01

本期期初	788,996,986.41	354,401,129.60	1,143,398,116.01
本期利润	427,958,482.52	133,507,188.09	561,465,670.61
本期基金份额交易产生的变动数	-13,353,880.17	4,331,660.06	-9,022,220.11
其中：基金申购款	254,247,525.37	79,261,483.39	333,509,008.76
基金赎回款	-267,601,405.54	-74,929,823.33	-342,531,228.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,203,601,588.76	492,239,977.75	1,695,841,566.51

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	379,351.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,867.26
其他	24,002.42
合计	418,220.89

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	433,596,247.27
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	433,596,247.27

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	7,432,748,247.86
减：卖出股票成本总额	6,988,074,218.78
减：交易费用	11,077,781.81
买卖股票差价收入	433,596,247.27

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	60.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	60.22

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	8,926,490.23
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	8,926,490.23

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	133,507,188.09
股票投资	133,507,188.09
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	133,507,188.09

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	512,854.03
基金转换费收入	2,207.63
合计	515,061.66

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	28,760.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	14,662.83
账户维护费	27,900.00
合计	130,831.10

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、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
上海东证期货有限公司(“东证期货”)	受东方证券控制的公司、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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	284,949,621.32	1.94	246,292,234.01	4.07

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	124,202.21	1.94	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	107,359.90	4.07	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果等。

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,171,514.06	10,137,185.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,392,416.50	4,139,551.58
应支付基金管理人的净管理费	7,779,097.56	5,997,633.46

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.20%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,195,252.37	1,689,530.84

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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：本基金本报告期内及上年度可比期间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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6

	30 日	月 30 日
基金合同生效日（2014 年 9 月 19 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	10,750,627.10
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	10,750,627.10
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.8253%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	348,421,276.83	379,351.21	105,514,784.10	180,317.89

注：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。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按协议利率计息，存出保证金不计息。于 2026 年 06 月 30 日，本基金存放于东证期货的结算备付金余额（不含应计利息）为 175,258.71 元，存出保证金余额为 0 元(2025 年 12 月 31 日：结算备付金余额 174,718.20 元，存出保证金余额 0 元)。于报告期内，本基金存放于东证期货的结算备付金利息收入为 537.64 元(2025 年同期：605.94 元)。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	20,220	2,022,000.00	2,022,062.04	-

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的各类重大风险，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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	2,022,062.04	-
未评级	-	-
合计	2,022,062.04	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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	348,421,276.83	-	-	-	-	-	348,421,276.83
结算备付金	4,932,751.52	-	-	-	-	-	4,932,751.52
存出保证金	1,111,827.50	-	-	-	-	-	1,111,827.50
交易性金融资产	-	-	-	-	2,022,062.04	2,395,557,908.09	2,397,579,970.13
应收申购款	39,786.72	-	-	-	-	560,060.10	599,846.82
应收清算款	-	-	-	-	-	66,780,370.08	66,780,370.08
资产总计	354,505,642.57	-	-	-	2,022,062.04	2,462,898,338.27	2,819,426,042.88
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	16,344,672.76	16,344,672.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,372,219.05	2,372,219.05
应付托管费	-	-	-	-	-	395,369.85	395,369.85
应付清算款	-	-	-	-	-	127,349,078.82	127,349,078.82
应交税费	-	-	-	-	-	2.04	2.04
其他负债	-	-	-	-	-	3,147,744.60	3,147,744.60
负债总计	-	-	-	-	-	149,609,087.12	149,609,087.12
利率敏感度缺口	354,505,642.57	-	-	-	2,022,062.04	2,313,289,251.15	2,669,816,955.76
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	184,867,914.05	-	-	-	-	-	184,867,914.05

结算备付金	4,267,932.11	-	-	-	-	-	4,267,932.11
存出保证金	894,890.17	-	-	-	-	-	894,890.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,960,301,662.02	1,960,301,662.02
应收申购款	8,875.24	-	-	-	-	863,014.39	871,889.63
应收清算款	-	-	-	-	-	35,186,667.35	35,186,667.35
资产总计	190,039,611.57	-	-	-	-	1,996,351,343.76	2,186,390,955.33
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,698,148.14	8,698,148.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,178,370.03	2,178,370.03
应付托管费	-	-	-	-	-	363,061.69	363,061.69
应付清算款	-	-	-	-	-	30,288,686.65	30,288,686.65
其他负债	-	-	-	-	-	2,114,876.62	2,114,876.62
负债总计	-	-	-	-	-	43,643,143.13	43,643,143.13
利率敏感度缺口	190,039,611.57	-	-	-	-	1,952,708,200.63	2,142,747,812.20

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

假设	除市场利率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.市场利率下降 25 个基点	29,472.88	-
	2.市场利率上升 25 个基点	-28,975.67	-

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	2,395,557,908.09	89.73	1,960,301,662.02	91.49
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	2,395,557,908.09	89.73	1,960,301,662.02	91.49

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%	251,641,121.03	213,028,479.67
	2.沪深 300 指数下降 5%	-251,641,121.03	-213,028,479.67

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

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	2,395,557,908.09	1,960,301,662.02
第二层次	2,022,062.04	-
第三层次	-	-
合计	2,397,579,970.13	1,960,301,662.02

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	2,395,557,908.09	84.97
	其中：股票	2,395,557,908.09	84.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,022,062.04	0.07
	其中：债券	2,022,062.04	0.07
	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	353,354,028.35	12.53
8	其他各项资产	68,492,044.40	2.43
9	合计	2,819,426,042.88	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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	88,933,928.76	3.33
C	制造业	2,230,221,889.90	83.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	699,257.99	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	756,509.95	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,059,777.10	2.59
J	金融业	5,886,544.39	0.22

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	2,395,557,908.09	89.73

7.2.2 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。

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

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	300502	新易盛	418,404	253,971,228.00	9.51
2	300308	中际旭创	187,290	237,858,300.00	8.91
3	601138	工业富联	2,575,299	185,807,822.85	6.96
4	603986	兆易创新	219,800	179,137,000.00	6.71
5	688008	澜起科技	487,360	151,032,864.00	5.66
6	002384	东山精密	533,100	139,858,785.00	5.24
7	688668	鼎通科技	350,724	130,925,269.20	4.90
8	605117	德业股份	1,143,658	121,433,606.44	4.55
9	300476	胜宏科技	342,489	118,648,464.27	4.44
10	300604	长川科技	316,500	108,059,430.00	4.05
11	002463	沪电股份	581,860	88,908,208.00	3.33
12	601899	紫金矿业	3,455,531	86,872,049.34	3.25
13	603115	海星股份	693,700	84,957,439.00	3.18
14	300620	光库科技	213,845	80,876,179.00	3.03
15	688766	普冉股份	105,018	80,506,798.80	3.02
16	301396	宏景科技	199,200	66,054,720.00	2.47
17	300857	协创数据	194,000	65,940,600.00	2.47
18	300394	天孚通信	167,629	50,737,945.72	1.90
19	002484	江海股份	335,000	35,175,000.00	1.32
20	688278	特宝生物	646,353	35,161,603.20	1.32
21	300750	宁德时代	49,300	19,375,393.00	0.73
22	600487	亨通光电	108,440	11,856,829.60	0.44
23	002475	立讯精密	101,600	7,152,640.00	0.27
24	688120	华海清科	15,501	4,994,112.18	0.19
25	002371	北方华创	3,900	3,449,784.00	0.13
26	603129	春风动力	12,174	3,114,109.20	0.12

27	601869	长飞光纤	5,500	3,002,450.00	0.11
28	300274	阳光电源	15,820	2,515,696.40	0.09
29	300433	蓝思科技	43,509	2,334,692.94	0.09
30	600482	中国动力	69,170	2,268,776.00	0.08
31	603236	移远通信	39,831	2,038,152.27	0.08
32	002851	麦格米特	11,900	1,989,442.00	0.07
33	600519	贵州茅台	1,600	1,896,784.00	0.07
34	603613	国联股份	95,580	1,760,583.60	0.07
35	601166	兴业银行	103,100	1,707,336.00	0.06
36	601077	渝农商行	266,816	1,630,245.76	0.06
37	601689	拓普集团	28,422	1,603,569.24	0.06
38	688281	华秦科技	29,576	1,485,602.48	0.06
39	000528	柳工	185,320	1,399,166.00	0.05
40	601838	成都银行	77,400	1,369,980.00	0.05
41	603179	新泉股份	27,171	1,349,040.15	0.05
42	600150	中国船舶	37,100	1,253,609.00	0.05
43	002155	湖南黄金	50,401	1,203,071.87	0.05
44	001389	广合科技	4,500	1,067,625.00	0.04
45	002126	银轮股份	20,400	1,015,920.00	0.04
46	002273	水晶光电	27,800	986,344.00	0.04
47	300017	网宿科技	68,100	885,981.00	0.03
48	603486	科沃斯	17,397	882,897.75	0.03
49	600000	浦发银行	101,743	876,007.23	0.03
50	300014	亿纬锂能	13,200	858,396.00	0.03
51	601127	赛力斯	13,167	806,478.75	0.03
52	600489	中金黄金	43,391	783,207.55	0.03
53	603871	嘉友国际	74,095	756,509.95	0.03
54	600900	长江电力	26,417	699,257.99	0.03
55	000568	泸州老窖	9,000	697,680.00	0.03
56	002050	三花智控	14,834	650,174.22	0.02
57	002600	领益智造	36,700	636,378.00	0.02
58	002837	英维克	6,786	539,894.16	0.02
59	688777	中控技术	3,051	358,492.50	0.01
60	601229	上海银行	34,905	302,975.40	0.01
61	601069	西部黄金	2,200	48,400.00	0.00
62	000975	山金国际	1,600	27,200.00	0.00
63	002487	大金重工	64	3,710.08	0.00

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	300476	胜宏科技	371,978,251.48	17.36

2	300394	天孚通信	332,499,198.01	15.52
3	600482	中国动力	325,945,151.77	15.21
4	002487	大金重工	298,546,836.14	13.93
5	601138	工业富联	264,182,735.98	12.33
6	000975	山金国际	231,103,268.56	10.79
7	301396	宏景科技	217,442,221.17	10.15
8	688008	澜起科技	201,681,684.76	9.41
9	300857	协创数据	197,175,868.67	9.20
10	688668	鼎通科技	190,213,464.07	8.88
11	600489	中金黄金	183,279,154.99	8.55
12	002484	江海股份	177,679,258.90	8.29
13	603115	海星股份	170,196,759.00	7.94
14	300750	宁德时代	170,045,786.42	7.94
15	002475	立讯精密	169,835,862.90	7.93
16	002396	星网锐捷	163,189,724.76	7.62
17	002028	思源电气	162,133,685.18	7.57
18	002463	沪电股份	158,726,235.50	7.41
19	300570	太辰光	155,471,584.14	7.26
20	601069	西部黄金	150,269,426.57	7.01
21	600487	亨通光电	147,847,237.86	6.90
22	300274	阳光电源	141,229,647.15	6.59
23	601899	紫金矿业	141,031,548.59	6.58
24	688012	中微公司	129,227,004.04	6.03
25	002384	东山精密	127,742,275.26	5.96
26	603986	兆易创新	123,201,166.15	5.75
27	605117	德业股份	120,161,616.39	5.61
28	300433	蓝思科技	119,971,329.41	5.60
29	601231	环旭电子	114,661,293.83	5.35
30	600988	赤峰黄金	110,557,707.35	5.16
31	000603	盛达资源	106,843,895.40	4.99
32	300604	长川科技	104,363,292.40	4.87
33	688411	海博思创	101,807,229.65	4.75
34	603993	洛阳钼业	101,304,739.37	4.73
35	600089	特变电工	93,019,838.88	4.34
36	600584	长电科技	92,013,274.24	4.29
37	000506	招金黄金	84,623,131.32	3.95
38	300620	光库科技	84,527,695.75	3.94
39	688278	特宝生物	81,391,498.24	3.80
40	688766	普冉股份	76,854,768.57	3.59
41	688390	固德威	72,289,361.98	3.37
42	603606	东方电缆	66,790,881.25	3.12
43	600176	中国巨石	65,862,165.87	3.07
44	688519	南亚新材	65,748,067.89	3.07

45	001337	四川黄金	64,206,170.60	3.00
46	002371	北方华创	54,996,983.90	2.57
47	002202	金风科技	51,196,623.00	2.39
48	600547	山东黄金	49,316,923.84	2.30
49	600875	东方电气	47,544,478.46	2.22
50	300017	网宿科技	43,950,013.14	2.05

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	430,504,083.94	20.09
2	300394	天孚通信	417,915,704.00	19.50
3	600482	中国动力	370,620,942.48	17.30
4	002487	大金重工	341,726,394.30	15.95
5	601138	工业富联	300,903,195.57	14.04
6	002396	星网锐捷	281,945,681.29	13.16
7	002463	沪电股份	273,245,074.43	12.75
8	000975	山金国际	215,887,907.82	10.08
9	601899	紫金矿业	214,988,740.06	10.03
10	300433	蓝思科技	200,125,879.46	9.34
11	600489	中金黄金	195,830,065.99	9.14
12	002475	立讯精密	171,252,727.38	7.99
13	600547	山东黄金	163,250,709.81	7.62
14	002028	思源电气	162,244,941.00	7.57
15	688278	特宝生物	156,787,041.42	7.32
16	300750	宁德时代	153,939,509.95	7.18
17	300570	太辰光	153,834,543.38	7.18
18	002484	江海股份	149,460,943.84	6.98
19	600487	亨通光电	144,628,295.62	6.75
20	601069	西部黄金	142,165,806.66	6.63
21	603115	海星股份	141,914,116.00	6.62
22	300308	中际旭创	139,892,821.99	6.53
23	603236	移远通信	136,825,609.18	6.39
24	301396	宏景科技	131,504,197.62	6.14
25	600988	赤峰黄金	126,425,037.72	5.90
26	688012	中微公司	124,321,098.47	5.80
27	300857	协创数据	121,426,044.19	5.67
28	300274	阳光电源	118,322,026.54	5.52
29	601231	环旭电子	117,496,562.11	5.48
30	300502	新易盛	112,409,987.57	5.25
31	603993	洛阳钼业	102,254,385.35	4.77
32	688668	鼎通科技	94,545,997.63	4.41

33	688411	海博思创	87,389,353.15	4.08
34	600089	特变电工	87,107,179.63	4.07
35	000506	招金黄金	86,575,412.65	4.04
36	600584	长电科技	86,538,590.68	4.04
37	000603	盛达资源	78,487,328.00	3.66
38	688008	澜起科技	78,087,764.85	3.64
39	001337	四川黄金	76,747,733.65	3.58
40	603606	东方电缆	65,032,824.00	3.04
41	600176	中国巨石	62,610,054.01	2.92
42	688519	南亚新材	61,410,635.87	2.87
43	002384	东山精密	59,809,089.95	2.79
44	688390	固德威	58,999,290.73	2.75
45	002202	金风科技	53,030,348.42	2.47
46	002371	北方华创	50,425,052.65	2.35
47	600875	东方电气	46,803,936.00	2.18
48	300017	网宿科技	44,110,553.90	2.06

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	7,289,823,276.76
卖出股票收入（成交）总额	7,432,748,247.86

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	2,022,062.04	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,022,062.04	0.08

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

1	118072	鼎通转债	20,220	2,022,062.04	0.08

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以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

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，以萃取相应债券组合的超额收益。

7.11.2 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。

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	1,111,827.50
2	应收清算款	66,780,370.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	599,846.82

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,492,044.40

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

注：本基金本报告期末前十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

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（%）
41,513	23,461.94	146,354,265.96	15.03	827,621,123.29	84.97

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	97.63

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,255,940.98	0.13

8.4 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	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负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 9 月 19 日）基金份额总额	1,610,160,711.75

本报告期期初基金份额总额	999,349,696.19
本报告期基金总申购份额	220,466,474.62
减：本报告期基金总赎回份额	245,840,781.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	973,975,389.25

§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，基金托管人无重大人事变动。

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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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(%)	
中信证券	2	2,267,172,694.95	15.40	988,255.85	15.40	-
兴业证券	2	1,947,151,697.27	13.23	848,772.70	13.23	-
招商证券	1	1,724,726,671.10	11.71	751,812.35	11.71	-
国联民生	3	1,314,855,098.27	8.93	573,147.74	8.93	-
华泰证券	1	1,273,323,935.79	8.65	555,043.06	8.65	-
长江证券	2	1,088,396,058.41	7.39	474,434.81	7.39	-
国金证券	2	1,033,882,633.28	7.02	450,693.20	7.02	-
东吴证券	1	1,011,321,708.02	6.87	440,834.60	6.87	-
东方财富证券	2	903,274,241.43	6.14	393,725.16	6.14	-
国盛证券	2	667,781,813.62	4.54	291,084.52	4.54	-
国泰海通	3	619,625,799.42	4.21	270,094.58	4.21	-
申万宏源	1	409,962,728.95	2.78	178,702.65	2.78	-
东方证券	5	284,949,621.32	1.94	124,202.21	1.94	-
广发证券	2	176,146,822.79	1.20	76,781.46	1.20	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-

华金证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

（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，与其签订交易单元租用协议。

2、本基金租用的证券公司交易单元变更情况：减少国泰海通交易单元 2 个。

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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证	-	-	-	-	-	-

券						
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	2,022,000.00	100.00	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证	-	-	-	-	-	-

券						
西南证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

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	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
2	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
3	东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 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睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的文件；

2、《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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