# 东方红量化选股混合型发起式证券投资基金
# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 东方红量化选股混合发起 |
| 基金主代码 | 020803 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2024 年 5 月 21 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 16,904,330.37 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，通过量化方法优选个股构建投资组合，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金“自上而下”构建量化选股模型。在量化风险模型约束下，严格控制运作风险，并根据各个子策略不同时期的表现对其迭代，提高整体模型的适应能力，力争取得持续稳定的超额收益。本基金量化子策略包括：多因子选股策略、统计套利策略、事件驱动套利策略、高股息选股策略、投资组合优化。<br>本基金的其他投资策略主要包括：资产配置、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、信用衍生品投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*90%+中国债券总指数收益率*10% | |
| 风险收益特征 | 本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。<br>本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 上海东方证券资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 国信证券股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 东方红量化选股混合发起 A | 东方红量化选股混合发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 020803 | 020804 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,548,573.82 份 | 355,756.55 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 东方红量化选股混合发起 A | 东方红量化选股混合发起 C |
| 1.本期已实现收益 | 356,276.53 | 34,855.84 |
| 2.本期利润 | -4,229,796.98 | -162,908.21 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2543 | -0.3391 |
| 4.期末基金资产净值 | 21,224,424.27 | 450,860.63 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2826 | 1.2673 |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红量化选股混合发起 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -16.51% | 2.44% | -12.58% | 1.30% | -3.93% | 1.14% |
| 过去六个月 | 2.58% | 2.13% | -1.76% | 1.27% | 4.34% | 0.86% |
| 过去一年 | 1.43% | 1.73% | -3.71% | 1.13% | 5.14% | 0.60% |
| 自基金合同生效起至今 | 28.26% | 1.38% | 20.72% | 1.15% | 7.54% | 0.23% |

东方红量化选股混合发起 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -16.63% | 2.44% | -12.58% | 1.30% | -4.05% | 1.14% |
| 过去六个月 | 2.30% | 2.13% | -1.76% | 1.27% | 4.06% | 0.86% |
| 过去一年 | 0.90% | 1.73% | -3.71% | 1.13% | 4.61% | 0.60% |
| 自基金合同生效起至今 | 26.73% | 1.38% | 20.72% | 1.15% | 6.01% | 0.23% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较






# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐习佳 | 上海东方证券资产管理有限公司量化投资部总经理、基金经理 | 2024 年 5 月 21 日 | - | 26 年 | 上海东方证券资产管理有限公司量化投资部总经理、基金经理，2019 年 07 月至今任东方红中证竞争力指数发起式证券投资基金基金经理、2021 年 12 月至今任东方红中证东方红红利低波动指数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、2024 年 05 月至今任东方红量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理、2024 年 07 月至今任东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理、2024 年 08 月至今任东方红红利量化选股混合型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 09 月至今任东方红慧选成长混合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。天普大学金融学博士。曾任联合证券 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 投资银行部投行经理，美国 Towers Watson 资深分析师，兴业全球基金金融工程与专题研究部副总监、基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司研究部副总监、量化投资部总经理、投资主办人、公募指数与多策略部副总经理（主持工作）、公募指数与多策略部总经理。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。

### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|---|---|---|---|---|
| 徐习佳 | 公募基金 | 10 | 8,507,304,973.79 | 2019 年 7 月 31 日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 3,672,138.79 | 2026 年 1 月 23 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 11 | 8,510,977,112.58 | - |

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，A 股市场整体呈现宽幅震荡调整、景气投资预期分化、K 型结构分化缓解的运行特征。上证指数三季度下跌 6.16%，前三季度累计下跌。整体来看，市场定价逻辑由上半年对"景气落地与景气持续"的追逐，过渡到中报与三季报的业绩实测，前期高景气方向的业绩容错率维持低位，板块间及板块内部的缩圈与分化延续。三季度中证 500 和科创 50 下跌 17.67%和 30.7%，而中证红利和东证红利低波上涨 9.38%和 9.19%，巨大差距反映了市场再平衡的力度。

宏观层面，国内经济呈现"外需强、内需弱、生产稳"的分化组合。价格端，8 月 CPI 同比上涨 0.8%、环比上涨 0.4%，涨幅较二季度有所回落；PPI 同比上涨 3.8%、环比上涨 0.4%，在二季度转正后维持在较高水平。生产端总体平稳，7、8 月规模以上工业增加值当月同比分别增长 4.5%和 5.2%，8 月表现好于市场预期。内需修复仍显乏力，7、8 月社会消费品零售总额当月同比分别增长 0.6%和 0.4%、低于市场预期，其中 8 月汽车零售额同比下降 18.5%形成主要拖累，剔除汽车后消费品零售额同比增长 2.5%持平前值，换机需求与补贴政策支撑下通讯器材类零售额同比增长 27.3%，服务消费表现持续好于商品消费（1—8 月服务零售额、商品零售额累计同比分别增长 4.9%和 1.0%）。固定资产投资 7、8 月当月同比分别下降 12.9%和 11.0%，降幅边际收窄但三大分项全面承压——8 月房地产开发投资同比下降 25.5%，仍处深度调整阶段；广义基建投资同比下降 14.8%，资金向实物工作量转化依然偏慢，项目储备不足是核心矛盾；制造业投资降幅由 4.4%扩大至 6.1%，仅通信电子设备投资累计增长 8.1%继续上行，汽车、化工、电气机械、通用设备等多数行业偏弱。外需维持高景气，8 月出口（美元计价）同比增长 25.0%、高于市场预期，1—8 月累计增长 19.3%，AI 产业链与高端制造共同支撑：8 月集成电路出口、进口同比分别增长 129.8%和 83.6%，均创 2015 年以来新高，前 8 个月汽车、船舶出口同比分别增长 53.2%和 35.2%；但强出口也意味着增长对外需依赖加深，中美/中欧贸易摩擦、海外需求及美国 AI 资本开支周期降温等风险需持续关注。景气端，8 月制造业 PMI 回升 0.6 个百分点至 49.8%，距荣枯线仅一步之遥，新订单贡献 0.63 个百分点、生产指数重回扩张区间，购进价格指数升至 56.6%、出厂价格指数重回线上，价格回暖信号继续积累；但非制造业 PMI 持平于 49.0%，建筑业商务活动指数降至 46.9%、再创 75 个月新低。房地产仍是主要拖累项：8 月商品房销售面积、销售额同比分别下降 14.8%和 12.1%，跌幅重新走阔，新开工同比下降 30.9%，70 城新房、二手房价格环比分别下降 0.2%和 0.3%，城市间价格分化

明显（一线城市新房价格连续两个月环比下跌 0.1%，二手房价格环比上涨 0.1%、连续六个月保持正增长），筑底过程仍然漫长；8·28 新政实施后预售门槛提高、购房款监管强化，短期或进一步抑制房企拿地与投资意愿，地方政策则从一线城市限购松绑转向购房补贴、公积金优化与存量房收购。

货币与信用环境方面，三季度信用扩张整体走弱：7、8 月新增人民币贷款分别为-3400 亿元和 600 亿元，8 月同比少增 5300 亿元、明显低于市场预期，其中企业贷款新增 2600 亿元、同比少增 3300 亿元，短期贷款净减少、中长期贷款同比少增，票据融资同比多增、冲量特征明显；居民贷款净减少 2029 亿元、同比多减 2332 亿元，消费信贷与按揭需求均显疲弱。7、8 月社会融资规模增量分别为 14017 亿元和 16619 亿元，8 月同比少增 9041 亿元、亦低于市场预期，社融存量同比增速由 7 月的 7.4%回落至 7.2%；结构上，8 月政府债券融资 10128 亿元仍为当月社融的主要支撑项、但同比少增 3544 亿元，企业债券融资 2687 亿元、同比多增 1349 亿元，股票融资 638 亿元、同比多增 182 亿元，形成部分对冲，非标融资同比少增 1781 亿元。货币端，M2 同比增速由 7 月的 7.7%回落至 7.5%，M1 同比小幅回升 0.1 个百分点至 4.1%，实体融资需求不足的问题仍待缓解。从三季度的高频观察看，9 月为地方债供给与广义赤字的双重高峰，政府债发行提速，新型政策性金融工具已开始落地，启动时点提前近一个月，中性情形下预计拉动下半年固定资产投资约 1.5 个百分点；但化债政策已由"加快置换"转向"严控新增、强化问责"，地方财政的收支约束仍在，且当前缺少类似 2024 年"924"的政策触发条件，政策加码节奏预计仍相对克制。

海外方面，美联储于 9 月 16 日 FOMC 会议全票（12:0）通过加息 25 个基点，将联邦基金利率目标区间上调至 3.75%—4.00%，为 2023 年 7 月以来的首次加息，议息路径分歧最终以加息落地收场；受此影响，10 年期美债收益率月末一度升破 5%，创近年新高，海外紧缩与国内宽货币的分化进一步加剧，全球无风险利率走高也对国内高估值成长资产形成压制。大宗商品方面，中东地缘风险推动原油价格一度升破 100 美元/桶，月末随风险溢价缓解回落至 90 美元附近；黄金在 9 月上旬于 4380—4406 美元区间震荡企稳后，月末受美债收益率飙升、美元走强影响进一步回调至 4160 美元附近。

总体而言，三季度市场进入业绩实测期，前期高景气方向的股价进一步上行依赖三季报的持续超预期，业绩容错率处于低位；海外加息预期反复、海峡风险与油价波动、国内信用扩张偏弱与地产链尚未企稳等变量仍压制风险偏好的修复节奏。展望四季度，随着财政融资提速与新型政

策性金融工具投放，财政脉冲对经济动能的支撑有望增强，政策托底内需的必要性在上升，但政策加码节奏预计仍相对克制，出口景气的边际变化或成为政策力度的重要观察变量；我们预计市场在极致缩圈后开启新结构的酝酿进程，四季度的定价或将进一步向盈利质量、股东回报与真实盈利增速集中。

东方红量化选股发起基金投资于一篮子盈利能力稳定、持有期利润增长概率高、价格合理的股票组合。回顾三季度行情，市场结束科技“缩圈”，正式开始前期景气品种的显著调整，科创 50 和创业板 50 季线均出现-30%以上回撤。

展望 2026 年第四季度，外部环境仍面临经贸摩擦最终落地后的外需适应性调整、地缘政治反复及海峡航运风险对能源与贸易成本的外溢等多重扰动，美联储加息预期升温亦加大全球风险资产的波动；但市场对相关不确定性的交易框架已较上半年更为钝化，若后续更多体现为产业链重构的节奏变化而非全面脱钩，其边际冲击有望进一步减弱。国内政策方面，7 月中央政治局会议定调"宏观政策要发力提效"并强调加大逆周期调节力度，随着财政融资边际提速与新型政策性金融工具落地，财政脉冲对四季度经济动能的支撑有望增强，政策托底内需的必要性进一步上升；但在出口仍具韧性、尾部风险较 2024 年明显下降的背景下，政策加码节奏预计仍相对克制，出口景气的边际变化或成为政策力度的重要观察变量。后续仍需继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，以及三季报密集披露期市场对盈利修复的最终验证情况。

风格层面，在三季报与四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"真实盈利增速"的重视预计仍将维持。高质量、高分红资产在长端利率低位震荡环境下，仍是绝对收益资金的重要底仓；同时，科技成长与新质生产力方向在经历"去伪存真"后，真正具备业绩兑现与产业化壁垒的细分龙头有望迎来修复，但板块内部的"马太效应"预计仍会较大。展望四季度，市场将进入三季报业绩实测期，对于缺乏基本面支撑的估值扩张，市场长期仍将为其支付成本；本产品后续将平衡短期波动和长期收益，力争在成长与估值间做好取舍平衡，以纪律化权重机制力争抑制回撤尾部风险。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金 A 类份额净值为 1.2826 元，份额累计净值为 1.2826 元;C 类份额净值为 1.2673 元，份额累计净值为 1.2673 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-16.51%，同期业绩比较基准收益率为-12.58%;C 类份额净值增长率为-16.63%，同期业绩比较基准收益率为-12.58%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 17,949,269.50 | 82.65 |
| | 其中：股票 | 17,949,269.50 | 82.65 |
| 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 | 3,763,983.04 | 17.33 |
| 8 | 其他资产 | 3,764.83 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 21,717,017.37 | 100.00 |

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 2,070,792.00 | 9.55 |
| C | 制造业 | 14,268,411.50 | 65.83 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 422,144.00 | 1.95 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 886,398.00 | 4.09 |
| 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 | 301,524.00 | 1.39 |
| 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 | 17,949,269.50 | 82.81 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300765 | 石药创新 | 14,700 | 693,693.00 | 3.20 |
| 2 | 002980 | 华盛昌 | 6,400 | 671,808.00 | 3.10 |
| 3 | 688498 | 源杰科技 | 400 | 645,200.00 | 2.98 |
| 4 | 688331 | 荣昌生物 | 5,300 | 621,902.00 | 2.87 |
| 5 | 002128 | 电投能源 | 22,100 | 616,590.00 | 2.84 |
| 6 | 688110 | 东芯股份 | 5,400 | 614,574.00 | 2.84 |
| 7 | 300475 | 香农芯创 | 3,700 | 566,988.00 | 2.62 |
| 8 | 603986 | 兆易创新 | 1,600 | 566,240.00 | 2.61 |
| 9 | 000762 | 西藏矿业 | 27,300 | 566,202.00 | 2.61 |
| 10 | 002432 | 九安医疗 | 9,200 | 555,588.00 | 2.56 |

## 5.4 报告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。

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期未进行股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，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。本基金还将利用股指期货，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理原则，以套期保值为目的。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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期未进行国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未进行国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金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。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
| --- | --- | --- |

| | | |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,764.83 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,764.83 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东方红量化选股混合发起 A | 东方红量化选股混合发起 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 16,583,416.17 | 695,939.37 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 532,514.02 | 207,742.64 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 567,356.37 | 547,925.46 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 16,548,573.82 | 355,756.55 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 东方红量化选股混合发起 A | 东方红量化选股混合发起 C |
|---|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,016,201.62 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,016,201.62 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总 | 60.53 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 份额比例（%） | | |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，本基金管理人不存在申购、赎回或交易本基金的情况。

# §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 10,016,201.62 | 59.25 | 10,000,000.00 | 59.16 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,016,201.62 | 59.25 | 10,000,000.00 | 59.16 | 3 年 |

# §9 影响投资者决策的其他重要信息

## 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 20260701-20260930 | 10,016,201.62 | 0.00 | 0.00 | 10,016,201.62 | 59.2523 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金由于存在单一投资者份额集中度较高的情况，可能存在巨额赎回的风险，增加基金管理人的流动性管理压力；基金管理人应付赎回的变现行为可能使基金资产净值受到不利影响或者产生较大波动。本基金管理人后期将审慎评估大额申购对基金份额集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，加强对基金持有人利益的保护。 | | | | | | | |

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §10 备查文件目录

## 10.1 备查文件目录

1、中国证监会准予注册东方红量化选股混合型发起式证券投资基金的文件；

2、《东方红量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《东方红量化选股混合型发起式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。

## 10.2 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。

## 10.3 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 10 月 27 日**