
东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资
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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50

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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	54
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	东方红中证 500 指数增强发起	
基金主代码	021175	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2024 年 7 月 9 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	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	39,944,668.68 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 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
下属分级基金的交 易代码	021175	021176
报告期末下属分级 基金的份额总额	20,884,369.49 份	19,060,299.19 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 500 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 500 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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周陶	冯萌
	联系电话	021-53952888	021-52629999-213310
	电子邮箱	service@dfham.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		4009200808	95561
传真		021-63326381	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200010	200120
法定代表人		杨斌	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
本期已实现收益	4,497,549.07	5,342,510.06
本期利润	5,567,582.57	6,065,464.90
加权平均基金份 额本期利润	0.2395	0.2040

本期加权平均净 值利润率	16.42%	14.12%
本期基金份额净 值增长率	18.67%	18.43%
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	11,661,083.83	10,411,771.17
期末可供分配基 金份额利润	0.5584	0.5463
期末基金资产净 值	33,291,495.22	30,144,489.35
期末基金份额净 值	1.5941	1.5815
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	59.41%	58.15%

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 500 指数增强发起 A

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	16.70%	1.40%	17.61%	1.56%	-0.91%	-0.16%
过去六个月	18.67%	1.43%	19.93%	1.58%	-1.26%	-0.15%
过去一年	36.33%	1.21%	49.68%	1.35%	-13.35 %	-0.14%

自基金合同生效起 至今	59.41%	1.28%	83.48%	1.50%	-24.07 %	-0.22%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------------	--------

东方红中证 500 指数增强发起 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	16.58%	1.40%	17.61%	1.56%	-1.03%	-0.16%
过去六个月	18.43%	1.43%	19.93%	1.58%	-1.50%	-0.15%
过去一年	35.77%	1.21%	49.68%	1.35%	-13.91 %	-0.14%
自基金合同生效起 至今	58.15%	1.28%	83.48%	1.50%	-25.33 %	-0.22%

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500指数增强发起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500指数增强发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
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 7 月 9 日	-	25 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。

4.1.3 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
徐习佳	公募基金	10	8,402,940,377.84	2019 年 7 月 31 日
	私募资产管理计划	1	2,764,069.65	2026 年 1 月 23 日
	其他组合	-	-	-
	合计	11	8,405,704,447.49	-

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

报告期内，A 股市场整体呈现“宽幅震荡向上、景气投资主导、K 型结构分化”的运行特征。上证指数二季度在 3871 到 4259 之间宽幅震荡，半年度收于 4094.40 点，上半年累计上涨 3.16%。整体来看，市场定价逻辑由一季度的“景气预期分化”，进一步深化为对短期景气业绩落地和中期景气持续的追逐，板块间及板块内部的分化演绎至极致。

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%，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%，已经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，依旧维持“政府发力、信贷偏弱”的格局。

投资层面，二季度市场彻底告别一季度末的“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，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，龙头大市值相对于中小市值更具韧性和爆发力。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，波动较大，煤炭、有色均出现先扬后抑。其他红利类资产受到美联储加息预期和科技股的资金面

吸引，均加大回撤力度。整体而言，二季度市场风险偏好显著维持高位，交易由“景气预期”逐步让位于“景气落地和景气持续”，科技龙头成为绝对主流，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，上半年强势板块在极致缩圈后，需要半年报和三季度报的持续超预期来实现股价的进一步上行，我们预计前期高景气方向的业绩容错率将大幅降低，下半年市场会在震荡上行中进一步缩圈，同时酝酿新的结构。

东方红中证 500 指数增强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。2026 年上半年，500 指增基金 A 类净值上涨 18.67%，略低于基准 19.93% 的收益。总体而言，在市场上涨和科技向龙头缩圈过程中获取超额难度不断加大，6 月最后两个交易日的大幅上涨使得季度超额由正转负。回顾上半年行情，极致的结构化主题投资在行业和市值上的分布使得中证 500 成为宽基指数中的主战场。目前看这种现象在 5 月有所缓解后，在 6 月中下旬进一步得到延续和加剧并且伴随着热门板块的不断缩圈。

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 1.5941 元，份额累计净值为 1.5941 元；C 类份额净值为 1.5815 元，份额累计净值为 1.5815 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 18.67%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；C 类份额净值增长率为 18.43%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。

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 2026 年第三季度及下半年，外部环境仍面临各种经贸摩擦和地缘政治反复等多重扰动，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更为钝化。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”拐点初现，政策主线将从“托底增长”逐步过渡至“巩固物价回升态势与盈利修复传导”。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，以及中报密集期市场对盈利修复的最终验证情况。

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”的重视预计仍将维持。高质量、高成长资产在目前这个确定性稀缺的环境下，更容易获得市场活跃资金的追逐；科技成长与新质生产力方向在经历二季度的震荡上涨后，面临市场对于业绩兑现、产业化壁垒和国产替代的再审视，预估板块内部的“马太效应”仍会较大。随着中证 500 内部分化加剧，我们预计那些被错杀的、具有真实持续盈利增长且估值合理的标的获得重新定价的时点越来越近。

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

报告期内，本托管人严格遵守《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，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载

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：东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	8,357,172.93	8,673,213.40
结算备付金		702,711.79	807,038.66
存出保证金		696,399.60	581,505.60
交易性金融资产	6.4.7.2	54,622,175.68	66,798,704.20
其中：股票投资		54,622,175.68	66,798,704.20
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		251,316.61	2,285,165.08
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		64,629,776.61	79,145,626.94
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		1,076,276.02	2,569,195.73
应付管理人报酬		42,535.93	52,508.76
应付托管费		5,317.01	6,563.59
应付销售服务费		10,759.47	15,848.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,520.84	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	53,382.77	100,000.00
负债合计		1,193,792.04	2,744,116.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	39,944,668.68	57,069,112.16
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	23,491,315.89	19,332,398.34
净资产合计		63,435,984.57	76,401,510.50
负债和净资产总计		64,629,776.61	79,145,626.94

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 39,944,668.68 份，其中东方红中证 500 指数增强发起 A 基金份额总额 20,884,369.49 份，基金份额净值 1.5941 元；东方红中证 500 指数增强发起 C 基金份额总额 19,060,299.19 份，基金份额净值 1.5815 元。

6.2 利润表

会计主体：东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	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		12,115,878.63	2,778,179.46
1. 利息收入		12,911.85	9,571.35
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,911.85	9,571.35
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）		10,283,971.50	-692,125.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	9,050,086.82	-1,448,579.98
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	884,333.13	85,906.33
股利收益	6.4.7.19	349,551.55	670,547.70
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	1,792,988.34	3,420,219.71
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	26,006.94	40,514.35
减：二、营业总支出		482,831.16	443,014.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	305,964.46	275,332.47
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	38,245.56	34,416.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	85,652.87	83,190.40
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		3,186.45	311.80
8. 其他费用	6.4.7.23	49,781.82	49,763.57
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		11,633,047.47	2,335,164.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		11,633,047.47	2,335,164.67
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		11,633,047.47	2,335,164.67

6.3 净资产变动表

会计主体：东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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	57,069,112.16	19,332,398.34	76,401,510.50
二、本期期初净资产	57,069,112.16	19,332,398.34	76,401,510.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,124,443.48	4,158,917.55	-12,965,525.93
（一）、综合收益总额	-	11,633,047.47	11,633,047.47
（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）	-17,124,443.48	-7,474,129.92	-24,598,573.40
其中：1. 基金申购款	66,310,501.79	30,256,293.12	96,566,794.91
2. 基金赎回款	-83,434,945.27	-37,730,423.04	-121,165,368.31
（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	39,944,668.68	23,491,315.89	63,435,984.57
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	54,780,478.15	7,424,701.93	62,205,180.08
二、本期期初净资产	54,780,478.15	7,424,701.93	62,205,180.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,500,397.59	3,278,289.24	12,778,686.83
（一）、综合收益总额	-	2,335,164.67	2,335,164.67
（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）	9,500,397.59	943,124.57	10,443,522.16
其中：1. 基金申购款	118,694,533.73	15,032,553.44	133,727,087.17
2. 基金赎回款	-109,194,136.14	-14,089,428.87	-123,283,565.01

（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	64,280,875.74	10,702,991.17	74,983,866.91

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

东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(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 500 指数增强型发起式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[2024]474 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金，存续期限为不定期。本基金根据认购费、申购费、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 156,119,295.66 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(24)第 00094 号验资报告。基金合同于 2024 年 7 月 9 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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 500 指数增强型发起式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)、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、证券公司发行的短期债券等)、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%；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。如果法律法规或中国证监会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 500 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9

月 18 日上海证券交易所《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《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[2016]36 号《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]140 号《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《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继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[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]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》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 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，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的资管产品运营业务，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税。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；对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(3) 对证券投资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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳

证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	118,971.97
等于：本金	118,901.68
加：应计利息	70.29
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	8,238,200.96
等于：本金	8,237,730.45
加：应计利息	470.51
合计	8,357,172.93

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	50,946,914.83	-	54,622,175.68	3,675,260.85
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	50,946,914.83	-	54,622,175.68	3,675,260.85

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,923,720.00	-	-	-
其中：股指期货投资	4,923,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,923,720.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	3.00	5,356,920.00	433,200.00
合计				433,200.00
减：可抵销期货暂收款				433,200.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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	49,588.57
其他	3,794.20
合计	53,382.77

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东方红中证 500 指数增强发起 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	24,121,301.21	24,121,301.21
本期申购	7,491,522.55	7,491,522.55
本期赎回（以“-”号填列）	-10,728,454.27	-10,728,454.27
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	20,884,369.49	20,884,369.49
-----	---------------	---------------

东方红中证 500 指数增强发起 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	32,947,810.95	32,947,810.95
本期申购	58,818,979.24	58,818,979.24
本期赎回（以“-”号填列）	-72,706,491.00	-72,706,491.00
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	19,060,299.19	19,060,299.19

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

东方红中证 500 指数增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,674,088.59	-392,470.60	8,281,617.99
本期期初	8,674,088.59	-392,470.60	8,281,617.99
本期利润	4,497,549.07	1,070,033.50	5,567,582.57
本期基金份额交易产生的变动数	-1,510,553.83	68,479.00	-1,442,074.83
其中：基金申购款	3,565,416.87	-21,502.14	3,543,914.73
基金赎回款	-5,075,970.70	89,981.14	-4,985,989.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,661,083.83	746,041.90	12,407,125.73

东方红中证 500 指数增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,587,870.85	-537,090.50	11,050,780.35
本期期初	11,587,870.85	-537,090.50	11,050,780.35
本期利润	5,342,510.06	722,954.84	6,065,464.90
本期基金份额交易产生的变动数	-6,518,609.74	486,554.65	-6,032,055.09
其中：基金申购款	27,499,045.49	-786,667.10	26,712,378.39
基金赎回款	-34,017,655.23	1,273,221.75	-32,744,433.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,411,771.17	672,418.99	11,084,190.16

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	3,427.52
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	7,561.50
结算备付金利息收入	1,880.21
其他	42.62
合计	12,911.85

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	9,050,086.82
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	9,050,086.82

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	307,588,174.63
减：卖出股票成本总额	298,233,263.86
减：交易费用	304,823.95
买卖股票差价收入	9,050,086.82

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

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	884,333.13

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	349,551.55
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	349,551.55

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	1,645,188.34
股票投资	1,645,188.34
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	147,800.00
权证投资	—
期货投资	147,800.00
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	1,792,988.34

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	25,786.42
基金转换费收入	220.52
合计	26,006.94

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	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—

存托服务费	8.25
银行费用	185.00
合计	49,781.82

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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

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：本基金本报告期内及上年度可比期间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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间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	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	305,964.46	275,332.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	108,660.85	102,535.72
应支付基金管理人的净管理费	197,303.61	172,796.75

注：(1)支付基金管理人东证资管的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

(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	38,245.56	34,416.55

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

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 500 指数 增强发起 A	东方红中证 500 指数 增强发起 C	合计
东方证券	-	32.01	32.01
东证资管	-	3,924.09	3,924.09
兴业银行	-	13,578.14	13,578.14
合计	-	17,534.24	17,534.24
获得销售服务费的各关联	上年度可比期间		

方名称	2025 年 1 月 1 日至 2025 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 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C	合计
东方证券	-	0.74	0.74
东证资管	-	3,455.06	3,455.06
兴业银行	-	20,750.63	20,750.63
合计	-	24,206.43	24,206.43

注：根据基金合同的规定，东方红中证 500 指数增强发起 A 不收取销售服务费，东方红中证 500 指数增强发起 C 的销售服务费按基金前一日的基金资产净值×0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：东方红中证 500 指数增强发起 C 的日销售服务费=前一日东方红中证 500 指数增强发起 C 基金资产净值×0.40%÷当年天数。

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 30 日	
	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
基金合同生效日（2024 年 7 月 9 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,003,600.36	-
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	10,003,600.36	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	47.8999%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
基金合同生效日（2024 年 7 月 9 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,003,600.36	-
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	10,003,600.36	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	40.7484%	-

注：1、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。

2、分类基金持有的基金份额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。

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
兴业银行	118,971.97	3,427.52	1,317,190.58	3,111.38

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

本基金支付给东证期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2026 年 06 月 30 日，本基金无应付交易手续费余额(2025 年 12 月 31 日：同)。于 2026 年上半年，本基金当期交易手续费支出 793.08 元(2025 年同期：703.38 元)。

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 702,612.69 元，存出保证金余额为 696,399.60 元(2025 年 12 月 31 日：结算备付金余额 806,896.65 元，存出保证金余额 581,505.60 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 1,880.21 元(2025 年同期：1,050.86 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

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

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	8,357,172.93	-	-	-	-	-8,357,172.93	
结算备付金	702,711.79	-	-	-	-	-702,711.79	
存出保证金	-	-	-	-	-696,399.60	696,399.60	
交易性金融资产	-	-	-	-	54,622,175.68	54,622,175.68	
应收申购款	1,760.85	-	-	-	-249,555.76	251,316.61	
资产总计	9,061,645.57	-	-	-	55,568,131.04	64,629,776.61	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	1,076,276.02	1,076,276.02	
应付管理人报酬	-	-	-	-	42,535.93	42,535.93	
应付托管费	-	-	-	-	5,317.01	5,317.01	
应付销售服务费	-	-	-	-	10,759.47	10,759.47	
应交税费	-	-	-	-	5,520.84	5,520.84	
其他负债	-	-	-	-	53,382.77	53,382.77	
负债总计	-	-	-	-	1,193,792.04	1,193,792.04	
利率敏感度缺口	9,061,645.57	-	-	-	54,374,339.00	63,435,984.57	
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	8,673,213.40	-	-	-	-	-8,673,213.40	
结算备付金	807,038.66	-	-	-	-	-807,038.66	
存出保证金	-	-	-	-	-581,505.60	581,505.60	

交易性金融资产	-	-	-	-	-	66,798,704.20	66,798,704.20
应收申购款	8,095.73	-	-	-	-	2,277,069.35	2,285,165.08
资产总计	9,488,347.79	-	-	-	-	69,657,279.15	79,145,626.94
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,569,195.73	2,569,195.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	52,508.76	52,508.76
应付托管费	-	-	-	-	-	6,563.59	6,563.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,848.36	15,848.36
其他负债	-	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	2,744,116.44	2,744,116.44
利率敏感度缺口	9,488,347.79	-	-	-	-	66,913,162.71	76,401,510.50

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	54,622,175.68	86.11	66,798,704.20	87.43
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	54,622,175.68	86.11	66,798,704.20	87.43

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%	3,337,309.05	3,987,546.10
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-3,337,309.05	-3,987,546.10

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	54,622,175.68	66,689,694.20
第二层次	-	109,010.00
第三层次	-	-
合计	54,622,175.68	66,798,704.20

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	54,622,175.68	84.52
	其中：股票	54,622,175.68	84.52
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	9,059,884.72	14.02
8	其他各项资产	947,716.21	1.47
9	合计	64,629,776.61	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	136,779.00	0.22
B	采矿业	737,087.00	1.16
C	制造业	33,590,044.38	52.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	701,790.00	1.11
E	建筑业	192,723.00	0.30
F	批发和零售业	3,745,634.00	5.90
G	交通运输、仓储和邮政业	374,391.00	0.59
H	住宿和餐饮业	68,362.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,460,958.80	2.30
J	金融业	2,854,755.60	4.50
K	房地产业	98,890.00	0.16
L	租赁和商务服务业	108,939.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	144,144.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	417,320.00	0.66
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	317,791.00	0.50
S	综合	-	-

	合计	44,949,608.78	70.86
--	----	---------------	-------

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	23,581.20	0.04
B	采矿业	52,888.00	0.08
C	制造业	6,029,803.70	9.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,840.00	0.11
E	建筑业	79,053.00	0.12
F	批发和零售业	19,745.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	99,950.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,264,520.00	3.57
J	金融业	303,700.00	0.48
K	房地产业	128,892.00	0.20
L	租赁和商务服务业	62,916.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	257,833.00	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	237,319.00	0.37
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	40,526.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	9,672,566.90	15.25

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	301536	星宸科技	21,200	2,728,652.00	4.30
2	300475	香农芯创	9,000	2,700,000.00	4.26
3	300073	当升科技	33,000	1,585,320.00	2.50
4	688002	睿创微纳	10,022	1,550,303.18	2.44
5	300054	鼎龙股份	11,700	1,239,849.00	1.95

6	001309	德明利	1,200	1,131,480.00	1.78
7	002008	大族激光	6,900	1,035,759.00	1.63
8	002281	光迅科技	3,600	924,984.00	1.46
9	600535	天士力	67,200	889,056.00	1.40
10	688498	源杰科技	400	754,400.00	1.19
11	002738	中矿资源	10,500	619,395.00	0.98
12	000155	川能动力	48,800	584,624.00	0.92
13	300604	长川科技	1,700	580,414.00	0.91
14	688120	华海清科	1,620	521,931.60	0.82
15	601869	长飞光纤	900	491,310.00	0.77
16	600499	科达制造	34,500	476,100.00	0.75
17	000034	神州数码	16,440	456,210.00	0.72
18	000783	长江证券	46,200	450,450.00	0.71
19	002407	多氟多	8,800	442,024.00	0.70
20	300136	信维通信	3,700	441,225.00	0.70
21	688475	萤石网络	15,700	429,395.00	0.68
22	002926	华西证券	51,500	420,755.00	0.66
23	000703	恒逸石化	30,000	407,100.00	0.64
24	603338	浙江鼎力	9,200	391,000.00	0.62
25	300383	光环新网	30,500	379,420.00	0.60
26	000878	云南铜业	23,700	376,356.00	0.59
27	688200	华峰测控	700	367,570.00	0.58
28	600109	国金证券	41,500	364,370.00	0.57
29	000951	中国重汽	18,500	360,935.00	0.57
30	002271	东方雨虹	30,100	357,287.00	0.56
31	301358	湖南裕能	4,700	356,589.00	0.56
32	300390	天华新能	3,800	355,338.00	0.56
33	600511	国药股份	13,600	354,144.00	0.56
34	002517	恺英网络	21,400	347,750.00	0.55
35	603225	新凤鸣	17,400	341,910.00	0.54
36	300142	沃森生物	26,300	341,637.00	0.54
37	000800	一汽解放	56,600	336,770.00	0.53
38	688019	安集科技	970	329,276.20	0.52
39	601665	齐鲁银行	56,000	323,120.00	0.51
40	002064	华峰化学	33,900	321,711.00	0.51
41	600595	中孚实业	57,200	321,464.00	0.51
42	603256	宏和科技	1,200	318,396.00	0.50
43	601233	桐昆股份	14,700	318,255.00	0.50
44	002851	麦格米特	1,900	317,642.00	0.50
45	000983	山西焦煤	45,400	263,320.00	0.42
46	600497	驰宏锌锗	20,900	253,099.00	0.40
47	300223	北京君正	1,000	248,900.00	0.39
48	600392	盛和资源	8,300	247,091.00	0.39

49	000960	锡业股份	5,700	243,333.00	0.38
50	600885	宏发股份	7,000	241,430.00	0.38
51	688578	艾力斯	2,200	240,240.00	0.38
52	688385	复旦微电	3,300	235,257.00	0.37
53	000629	钒钛股份	69,700	232,798.00	0.37
54	600166	福田汽车	79,700	231,927.00	0.37
55	300623	捷捷微电	5,100	229,449.00	0.36
56	300458	全志科技	5,800	228,868.00	0.36
57	002266	浙富控股	44,500	225,170.00	0.35
58	000060	中金岭南	29,400	222,558.00	0.35
59	000987	越秀资本	27,700	216,614.00	0.34
60	601108	财通证券	24,200	209,330.00	0.33
61	002078	太阳纸业	16,600	207,334.00	0.33
62	603379	三美股份	2,700	204,903.00	0.32
63	603659	璞泰来	7,000	202,510.00	0.32
64	002402	和而泰	7,500	193,725.00	0.31
65	603308	应流股份	3,200	193,280.00	0.30
66	603345	安井食品	2,300	184,437.00	0.29
67	300666	江丰电子	500	184,300.00	0.29
68	002299	圣农发展	12,100	183,436.00	0.29
69	002414	高德红外	13,800	182,988.00	0.29
70	603129	春风动力	700	179,060.00	0.28
71	000709	河钢股份	91,200	176,928.00	0.28
72	002487	大金重工	3,000	173,910.00	0.27
73	300953	震裕科技	1,300	173,810.00	0.27
74	000729	燕京啤酒	17,100	173,223.00	0.27
75	002850	科达利	900	170,370.00	0.27
76	300857	协创数据	500	169,950.00	0.27
77	300699	光威复材	5,900	169,035.00	0.27
78	688347	华虹宏力	500	168,150.00	0.27
79	300919	中伟新材	3,800	166,250.00	0.26
80	601128	常熟银行	28,230	164,298.60	0.26
81	600801	华新建材	10,500	163,800.00	0.26
82	600177	雅戈尔	21,600	162,648.00	0.26
83	002841	视源股份	4,700	162,291.00	0.26
84	603699	纽威股份	3,200	160,960.00	0.25
85	600100	同方股份	23,300	159,605.00	0.25
86	000893	亚钾国际	3,900	159,471.00	0.25
87	600711	盛屯矿业	14,400	157,968.00	0.25
88	300373	扬杰科技	1,000	157,230.00	0.25
89	000032	深桑达 A	6,200	154,690.00	0.24
90	600765	中航重机	11,600	149,872.00	0.24
91	002262	恩华药业	7,900	148,125.00	0.23

92	002152	广电运通	15,700	147,266.00	0.23
93	688692	达梦数据	600	146,574.00	0.23
94	601156	东航物流	9,000	145,080.00	0.23
95	002065	东华软件	20,200	144,228.00	0.23
96	300012	华测检测	10,400	144,144.00	0.23
97	603444	吉比特	400	143,368.00	0.23
98	601928	凤凰传媒	15,400	135,366.00	0.21
99	600378	昊华科技	1,700	128,146.00	0.20
100	300627	华测导航	4,500	127,800.00	0.20
101	002273	水晶光电	3,600	127,728.00	0.20
102	000898	鞍钢股份	67,700	126,599.00	0.20
103	603233	大参林	8,400	126,252.00	0.20
104	688220	翱捷科技	1,000	124,320.00	0.20
105	688099	晶晨股份	1,200	123,480.00	0.19
106	601098	中南传媒	12,000	118,080.00	0.19
107	600292	电投水电	9,700	116,788.00	0.18
108	603565	中谷物流	11,900	116,739.00	0.18
109	002120	韵达股份	17,700	112,572.00	0.18
110	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.17
111	688266	泽璟制药	900	104,994.00	0.17
112	600352	浙江龙盛	8,600	104,146.00	0.16
113	601997	贵阳银行	20,000	102,600.00	0.16
114	600153	建发股份	12,300	97,539.00	0.15
115	002340	格林美	14,700	97,167.00	0.15
116	688301	奕瑞科技	760	94,240.00	0.15
117	600517	国网英大	20,000	93,600.00	0.15
118	600598	北大荒	8,600	93,224.00	0.15
119	002155	湖南黄金	3,900	93,093.00	0.15
120	601099	太平洋	27,500	92,675.00	0.15
121	600884	杉杉股份	6,800	92,140.00	0.15
122	688331	荣昌生物	700	91,182.00	0.14
123	002130	沃尔核材	4,800	91,008.00	0.14
124	688538	和辉光电	33,900	88,140.00	0.14
125	603606	东方电缆	2,100	87,171.00	0.14
126	601577	长沙银行	9,800	85,358.00	0.13
127	002673	西部证券	13,000	84,370.00	0.13
128	002318	久立特材	3,500	83,650.00	0.13
129	688018	乐鑫科技	640	81,868.80	0.13
130	600704	物产中大	16,900	79,768.00	0.13
131	002223	鱼跃医疗	3,100	79,546.00	0.13
132	002252	上海莱士	18,100	78,554.00	0.12
133	600312	平高电气	4,400	77,704.00	0.12
134	003022	联泓新科	3,000	77,700.00	0.12

135	603077	和邦生物	33,300	77,256.00	0.12
136	603568	伟明环保	4,900	75,362.00	0.12
137	600685	中船防务	2,900	73,776.00	0.12
138	000738	航发控制	4,000	73,160.00	0.12
139	600282	南钢股份	15,900	72,981.00	0.12
140	601106	中国一重	22,000	72,600.00	0.11
141	600060	海信视像	2,600	72,462.00	0.11
142	688349	三一重能	4,730	71,801.40	0.11
143	600435	北方导航	6,400	71,680.00	0.11
144	600380	健康元	7,600	71,592.00	0.11
145	601399	国机重装	20,400	71,400.00	0.11
146	688778	厦钨新能	1,300	70,720.00	0.11
147	000683	博源化工	12,100	69,696.00	0.11
148	600901	江苏金租	12,100	69,575.00	0.11
149	600816	建元信托	28,300	69,052.00	0.11
150	300146	汤臣倍健	7,600	68,704.00	0.11
151	000598	兴蓉环境	10,700	68,694.00	0.11
152	600754	锦江酒店	3,800	68,362.00	0.11
153	600126	杭钢股份	10,900	66,817.00	0.11
154	600871	石化油服	32,900	66,787.00	0.11
155	688708	佳驰科技	1,300	66,040.00	0.10
156	603486	科沃斯	1,300	65,975.00	0.10
157	000723	美锦能源	19,200	64,320.00	0.10
158	600764	中国海防	3,600	62,748.00	0.10
159	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.10
160	600968	海油发展	18,500	61,605.00	0.10
161	601019	山东出版	9,600	61,440.00	0.10
162	688169	石头科技	600	56,982.00	0.09
163	000967	盈峰环境	5,300	55,809.00	0.09
164	600927	永安期货	4,400	54,780.00	0.09
165	600390	五矿资本	11,800	53,808.00	0.08
166	002756	永兴材料	900	50,976.00	0.08
167	600808	马钢股份	20,000	50,000.00	0.08
168	000997	新大陆	2,900	47,270.00	0.07
169	601666	平煤股份	6,600	47,190.00	0.07
170	601699	潞安环能	3,300	47,124.00	0.07
171	688777	中控技术	400	47,000.00	0.07
172	002436	兴森科技	900	45,855.00	0.07
173	600008	首创环保	16,400	44,608.00	0.07
174	002157	正邦科技	15,500	43,555.00	0.07
175	603899	晨光股份	2,100	43,323.00	0.07
176	600820	隧道股份	7,300	38,033.00	0.06
177	603816	顾家家居	1,700	38,012.00	0.06

178	600208	衢州发展	12,600	35,658.00	0.06
179	603156	养元饮品	700	34,349.00	0.05
180	601155	新城控股	3,200	32,832.00	0.05
181	002244	滨江集团	4,000	30,400.00	0.05
182	002568	百润股份	1,700	28,764.00	0.05
183	002461	珠江啤酒	3,700	28,009.00	0.04
184	600398	海澜之家	5,300	27,719.00	0.04
185	600105	永鼎股份	400	26,992.00	0.04
186	600298	安琪酵母	700	25,340.00	0.04
187	300957	贝泰妮	800	25,208.00	0.04
188	603605	珀莱雅	400	23,968.00	0.04
189	002773	康弘药业	1,100	22,495.00	0.04
190	688363	华熙生物	600	21,462.00	0.03
191	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.03
192	600655	豫园股份	2,900	11,919.00	0.02
193	000785	居然智家	5,700	11,400.00	0.02
194	600316	洪都航空	300	8,382.00	0.01
195	600688	上海石化	2,600	7,618.00	0.01
196	600879	航天电子	300	6,387.00	0.01
197	600157	永泰能源	2,400	3,864.00	0.01
198	300144	宋城演艺	500	2,905.00	0.00

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	688045	必易微	17,900	1,445,962.00	2.28
2	688388	嘉元科技	12,125	533,500.00	0.84
3	300823	建科智能	18,200	265,356.00	0.42
4	300590	移为通信	18,300	262,605.00	0.41
5	002566	益盛药业	31,500	190,260.00	0.30
6	688179	阿拉丁	5,900	163,489.00	0.26
7	688456	有研粉材	1,100	153,560.00	0.24
8	000938	紫光股份	5,300	152,958.00	0.24
9	002463	沪电股份	1,000	152,800.00	0.24
10	002049	紫光国微	1,700	150,875.00	0.24
11	688659	元琛科技	12,900	134,676.00	0.21
12	688426	康为世纪	7,300	133,882.00	0.21
13	603506	南都物业	13,800	128,892.00	0.20
14	600150	中国船舶	3,800	128,402.00	0.20
15	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.20
16	688573	信宇人	6,900	122,268.00	0.19
17	300513	恒实科技	16,600	120,184.00	0.19
18	688638	誉辰智能	3,800	118,446.00	0.19
19	002197	证通电子	20,500	117,670.00	0.19

20	688429	时创能源	11,400	116,166.00	0.18
21	002875	安奈儿	7,600	112,936.00	0.18
22	300417	南华仪器	11,000	112,860.00	0.18
23	002377	国创高新	44,500	112,140.00	0.18
24	688435	英方软件	3,400	108,800.00	0.17
25	688653	康希通信	6,200	107,756.00	0.17
26	301192	泰祥股份	5,700	107,730.00	0.17
27	002415	海康威视	3,100	106,020.00	0.17
28	605151	西上海	6,000	105,660.00	0.17
29	601995	中金公司	2,800	101,220.00	0.16
30	301418	协昌科技	1,800	100,584.00	0.16
31	688059	华锐精密	500	99,855.00	0.16
32	605069	正和生态	5,700	93,936.00	0.15
33	688279	峰昭科技	400	89,776.00	0.14
34	301159	三维天地	3,000	87,300.00	0.14
35	688620	安凯微	5,300	85,860.00	0.14
36	603588	高能环境	4,400	84,480.00	0.13
37	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.13
38	002384	东山精密	300	78,705.00	0.12
39	002861	瀛通通讯	3,500	77,980.00	0.12
40	688262	国芯科技	1,800	77,814.00	0.12
41	002494	华斯股份	17,400	77,256.00	0.12
42	600460	士兰微	1,400	76,524.00	0.12
43	603669	灵康药业	13,300	75,411.00	0.12
44	000553	安道麦 A	13,600	72,760.00	0.11
45	301027	华蓝集团	3,400	70,346.00	0.11
46	002963	豪尔赛	3,300	69,498.00	0.11
47	002028	思源电气	400	69,200.00	0.11
48	600487	亨通光电	600	65,604.00	0.10
49	688221	前沿生物	2,900	64,960.00	0.10
50	688619	罗普特	4,000	64,920.00	0.10
51	603703	盛洋科技	5,600	62,160.00	0.10
52	300691	联合光电	3,900	61,659.00	0.10
53	300502	新易盛	100	60,700.00	0.10
54	300169	天晟新材	11,900	59,381.00	0.09
55	002250	联化科技	4,300	58,781.00	0.09
56	603879	永悦科技	12,900	58,308.00	0.09
57	601988	中国银行	9,900	56,628.00	0.09
58	000520	凤凰航运	15,000	55,950.00	0.09
59	688560	明冠新材	4,700	55,695.00	0.09
60	603709	中源家居	4,100	55,514.00	0.09
61	301097	天益医疗	1,541	55,013.70	0.09
62	300865	大宏立	2,500	54,625.00	0.09

63	300405	科隆股份	10,500	54,390.00	0.09
64	002205	国统股份	5,300	53,477.00	0.08
65	300422	博世科	12,700	53,467.00	0.08
66	600198	大唐电信	5,400	52,110.00	0.08
67	000589	贵州轮胎	12,800	51,968.00	0.08
68	600116	三峡水利	8,800	49,280.00	0.08
69	300334	津膜科技	4,700	48,974.00	0.08
70	600961	株冶集团	1,500	48,585.00	0.08
71	000637	茂化实华	13,500	47,250.00	0.07
72	000952	广济药业	8,600	46,612.00	0.07
73	002128	电投能源	1,900	43,928.00	0.07
74	002297	博云新材	1,500	43,485.00	0.07
75	601138	工业富联	600	43,290.00	0.07
76	002443	金洲管道	4,500	42,885.00	0.07
77	605016	百龙创园	1,600	41,360.00	0.07
78	605577	龙版传媒	4,600	40,526.00	0.06
79	301592	六九一二	300	39,705.00	0.06
80	603329	上海雅仕	4,200	37,716.00	0.06
81	002392	北京利尔	4,600	37,122.00	0.06
82	002513	蓝丰生化	7,500	35,850.00	0.06
83	000776	广发证券	1,500	35,100.00	0.06
84	601066	中信建投	1,200	34,884.00	0.05
85	002609	捷顺科技	4,500	34,290.00	0.05
86	601059	信达证券	2,000	32,380.00	0.05
87	601360	三六零	3,600	31,284.00	0.05
88	301280	珠城科技	600	30,342.00	0.05
89	600928	西安银行	9,100	29,757.00	0.05
90	000933	神火股份	1,400	29,680.00	0.05
91	600037	歌华有线	4,500	28,215.00	0.04
92	300350	华鹏飞	7,100	28,187.00	0.04
93	000906	浙商中拓	5,000	25,200.00	0.04
94	688309	恒誉环保	400	24,352.00	0.04
95	300970	华绿生物	1,290	23,581.20	0.04
96	000958	电投产融	4,000	22,560.00	0.04
97	000810	创维数字	1,600	21,200.00	0.03
98	600228	返利科技	2,000	18,600.00	0.03
99	600419	天润乳业	2,400	18,168.00	0.03
100	601872	招商轮船	900	15,813.00	0.02
101	605122	四方新材	1,400	15,092.00	0.02
102	000779	甘咨询	1,800	14,022.00	0.02
102	000869	张裕 A	900	14,022.00	0.02
104	000567	海德股份	2,300	13,731.00	0.02
105	601011	宝泰隆	5,100	13,362.00	0.02

106	600356	恒丰纸业	1,600	11,856.00	0.02
107	300938	信测标准	200	9,976.00	0.02
108	002752	昇兴股份	1,800	9,936.00	0.02
109	002848	高斯贝尔	700	9,744.00	0.02
110	601117	中国化学	1,300	9,555.00	0.02
111	000552	甘肃能化	4,000	8,960.00	0.01
112	000778	新兴铸管	2,400	8,904.00	0.01
113	301469	恒达新材	300	8,274.00	0.01
114	000551	创元科技	400	8,252.00	0.01
115	605599	菜百股份	600	8,220.00	0.01
116	002646	天佑德酒	1,200	7,572.00	0.01
117	300740	水羊股份	400	7,364.00	0.01
118	300867	圣元环保	300	5,436.00	0.01
119	301371	敷尔佳	200	5,200.00	0.01
120	002746	仙坛股份	1,000	5,100.00	0.01
121	605138	盛泰集团	800	4,416.00	0.01
122	603719	良品铺子	500	4,325.00	0.01
123	605089	味知香	200	4,198.00	0.01
124	600858	银座股份	900	3,969.00	0.01
125	603778	国晟科技	300	3,690.00	0.01
126	601061	中信金属	300	3,231.00	0.01
127	000809	和展能源	1,000	3,170.00	0.00
128	002511	中顺洁柔	400	2,660.00	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	688002	睿创微纳	3,067,448.25	4.01
2	300054	鼎龙股份	2,805,843.00	3.67
3	000960	锡业股份	2,745,767.70	3.59
4	300373	扬杰科技	2,709,840.00	3.55
5	300073	当升科技	2,661,889.00	3.48
6	301358	湖南裕能	2,651,623.00	3.47
7	000623	吉林敖东	2,624,949.48	3.44
8	688349	三一重能	2,618,250.88	3.43
9	002841	视源股份	2,519,660.00	3.30
10	301536	星宸科技	2,508,420.00	3.28
11	600739	辽宁成大	2,379,850.00	3.11
12	688578	艾力斯	2,214,027.60	2.90
13	603659	璞泰来	2,007,212.00	2.63
14	300475	香农芯创	1,990,785.00	2.61
15	688281	华秦科技	1,950,967.79	2.55

16	605358	立昂微	1,942,036.00	2.54
17	000733	振华科技	1,746,245.00	2.29
18	002926	华西证券	1,704,832.00	2.23
19	688045	必易微	1,696,607.30	2.22
20	600511	国药股份	1,646,990.00	2.16
21	002850	科达利	1,635,736.00	2.14
22	301308	江波龙	1,535,293.00	2.01

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	002841	视源股份	3,932,260.21	5.15
2	301308	江波龙	3,455,304.00	4.52
3	300373	扬杰科技	3,164,268.00	4.14
4	600549	厦门钨业	3,085,317.00	4.04
5	688002	睿创微纳	3,072,273.32	4.02
6	000960	锡业股份	2,707,720.00	3.54
7	002008	大族激光	2,630,483.00	3.44
8	301358	湖南裕能	2,624,989.00	3.44
9	300054	鼎龙股份	2,616,264.36	3.42
10	000623	吉林敖东	2,537,261.00	3.32
11	000733	振华科技	2,521,705.00	3.30
12	605358	立昂微	2,504,183.73	3.28
13	600739	辽宁成大	2,276,437.00	2.98
14	601865	福莱特	2,219,157.00	2.90
15	688281	华秦科技	2,186,861.29	2.86
16	688578	艾力斯	2,174,453.44	2.85
17	688349	三一重能	2,141,678.19	2.80
18	603659	璞泰来	1,988,045.00	2.60
19	601019	山东出版	1,963,156.00	2.57
20	300207	欣旺达	1,914,056.00	2.51
21	603699	纽威股份	1,867,334.00	2.44
22	600487	亨通光电	1,861,894.80	2.44
23	688183	生益电子	1,847,413.80	2.42
24	688525	佰维存储	1,758,032.99	2.30
25	600511	国药股份	1,634,308.00	2.14
26	600332	白云山	1,603,328.00	2.10
27	000783	长江证券	1,582,567.00	2.07
28	002850	科达利	1,579,729.00	2.07
29	002156	通富微电	1,568,267.00	2.05

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	284,411,547.00
卖出股票收入（成交）总额	307,588,174.63

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。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。

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	696,399.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	251,316.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	947,716.21

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 500 指	495	42,190.65	10,003,600.36	47.90	10,880,769.13	52.10

数增强发起 A						
东方红中证 500 指数增强发起 C	975	19,549.02	6,958.96	0.04	19,053,340.23	99.96
合计	1,470	27,173.24	10,010,559.32	25.06	29,934,109.36	74.94

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 500 指数增强发起 A	188,686.28	0.90
	东方红中证 500 指数增强发起 C	20.03	0.00
	合计	188,706.31	0.47

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负责人持有本开放式基金	东方红中证 500 指数增强发起 A	10~50
	东方红中证 500 指数增强发起 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红中证 500 指数增强发起 A	0
	东方红中证 500 指数增强发起 C	0
	合计	0

8.4 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	10,003,600.36	25.04	10,000,000.00	25.03	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	10,003,600.36	25.04	10,000,000.00	25.03	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
基金合同生效日 (2024 年 7 月 9 日)	44,603,210.79	111,516,084.87
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	24,121,301.21	32,947,810.95
本报告期基金总申购份额	7,491,522.55	58,818,979.24
减：本报告期基金总赎回份额	10,728,454.27	72,706,491.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,884,369.49	19,060,299.19

§ 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。
报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

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德勤华永会计师事务所（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：报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无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：报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无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(%)	
华福证券	2	591,999,721.63	100.00	113,065.40	100.00	-

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(%)
华福证券	-	-	-	-	-	-

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 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
2	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
3	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
4	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 3 日
5	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 3 日
6	东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 3 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

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	20260109-20260113, 20260507-2026063	10,003,600.36	0.00	0.00	10,003,600.36	25.0436

		0					
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。							

注：上表列示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，分类基金按总份额占比计算。

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 500 指数增强型发起式证券投资基金的文件；
- 2、《东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红中证 500 指数增强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。

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