东方红货币市场基金
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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。

本报告中财务资料未经审计。

本基金于 2019 年 9 月 5 日新增 C 类份额，本报告中本基金 C 类份额的“基金合同生效日”特指 2019 年 9 月 5 日；本基金于 2020 年 4 月 27 日新增 D 类份额，本报告中本基金 D 类份额的“基金合同生效日”特指 2020 年 4 月 27 日。本基金于 2026 年 2 月 11 日新增 F 类份额，本报告中本基金 F 类份额的“基金合同生效日”特指 2026 年 2 月 11 日。

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	东方红货币
基金主代码	005056
基	契约型开放式

金运作方式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 25 日
报告期末基金份额总额	48,333,768,369.18 份
投资目标	在本金安全的前提下，确保基金资产的高流动性，追求超越业绩比较基准的稳定收益。

投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	当期银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 C	东方红货币 D	东方红货币 E	东方红货币 F
下属分级基金的交易代码	005056	005057	007864	007865	005058	026586
报告期末下	167,219,162.85 份	14,002,242,601.00 份	8,932,996,341.24 份	15,742,647,910.06 份	9,488,561,282.63 份	101,071.40 份

属分级基金的份额总额						

§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）					
	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 C	东方红货币 D	东方红货币 E	东方红货币 F
1.本期已实现收益	252,879.28	31,632,690.18	24,291,091.44	42,536,567.10	25,735,145.61	61.17
2.本期利润	252,879.28	31,632,690.18	24,291,091.44	42,536,567.10	25,735,145.61	61.17
3.期末基	167,219,162.85	14,002,242,601.00	8,932,996,341.24	15,742,647,910.06	9,488,561,282.63	101,071.40

金资产净值						

注：1、本基金不同类别份额适用不同的销售服务费率。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3、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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.2706%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.1824%	0.0008%
过去六个月	0.5571%	0.0009%	0.1755%	0.0000%	0.3816%	0.0009%
过去一年	1.1561%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	0.8061%	0.0008%
过去三年	4.3426%	0.0011%	1.0510%	0.0000%	3.2916%	0.0011%
过去五年	8.2350%	0.0011%	1.7510%	0.0000%	6.4840%	0.0011%
过去七年	12.8658%	0.0012%	2.4519%	0.0000%	10.4139%	0.0012%
自基金合同生效起至今	20.3825%	0.0022%	3.1874%	0.0000%	17.1951%	0.0022%

东方红货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.3058%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.2176%	0.0008%
过去六个月	0.6276%	0.0009%	0.1755%	0.0000%	0.4521%	0.0009%
过去一年	1.3107%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	0.9607%	0.0008%
过去三年	5.0050%	0.0011%	1.0510%	0.0000%	3.9540%	0.0011%
过去五年	9.4460%	0.0012%	1.7510%	0.0000%	7.6950%	0.0012%
过去七年	14.6781%	0.0013%	2.4519%	0.0000%	12.2262%	0.0013%
自基金合同生效起至今	22.9329%	0.0022%	3.1874%	0.0000%	19.7455%	0.0022%

东方红货币 C

阶段	净值收益率	净值收益率	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④

	①	标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	0.2448%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.1566%	0.0008%
过去六个月	0.5061%	0.0009%	0.1755%	0.0000%	0.3306%	0.0009%
过去一年	1.0671%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	0.7171%	0.0008%
过去三年	4.2510%	0.0011%	1.0510%	0.0000%	3.2000%	0.0011%
过去五年	8.1395%	0.0012%	1.7510%	0.0000%	6.3885%	0.0012%
过去七年	12.7701%	0.0013%	2.4519%	0.0000%	10.3182%	0.0013%
自基金合同生效起至今	12.9507%	0.0013%	2.4768%	0.0000%	10.4739%	0.0013%

东方红货币 D

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.2831%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.1949%	0.0008%
过去六个月	0.5822%	0.0009%	0.1755%	0.0000%	0.4067%	0.0009%
过去一年	1.2196%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	0.8696%	0.0008%
过去三年	4.7224%	0.0011%	1.0510%	0.0000%	3.6714%	0.0011%
过去五年	8.9555%	0.0012%	1.7510%	0.0000%	7.2045%	0.0012%
自基金合同生效起至今	12.4437%	0.0013%	2.2515%	0.0000%	10.1922%	0.0013%

东方红货币 E

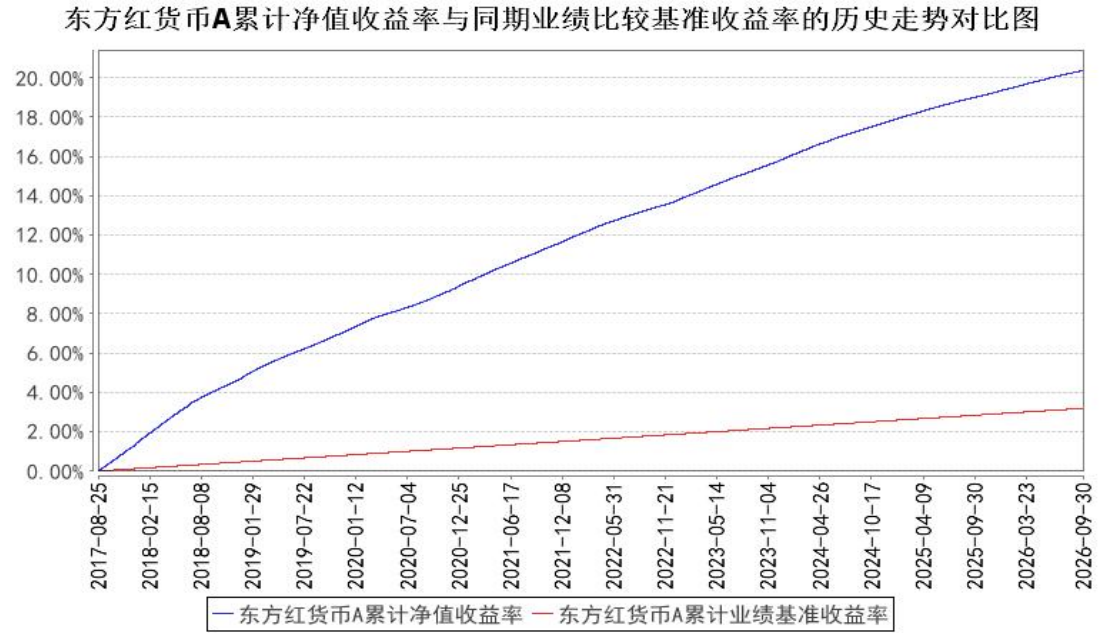
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.3058%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.2176%	0.0008%
过去六个月	0.6276%	0.0009%	0.1755%	0.0000%	0.4521%	0.0009%
过去一年	1.3107%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	0.9607%	0.0008%
过去三年	5.0051%	0.0011%	1.0510%	0.0000%	3.9541%	0.0011%
过去五年	9.2510%	0.0011%	1.7510%	0.0000%	7.5000%	0.0011%
过去七年	14.2660%	0.0012%	2.4519%	0.0000%	11.8141%	0.0012%
自基金合同生效起至今	22.2606%	0.0022%	3.1874%	0.0000%	19.0732%	0.0022%

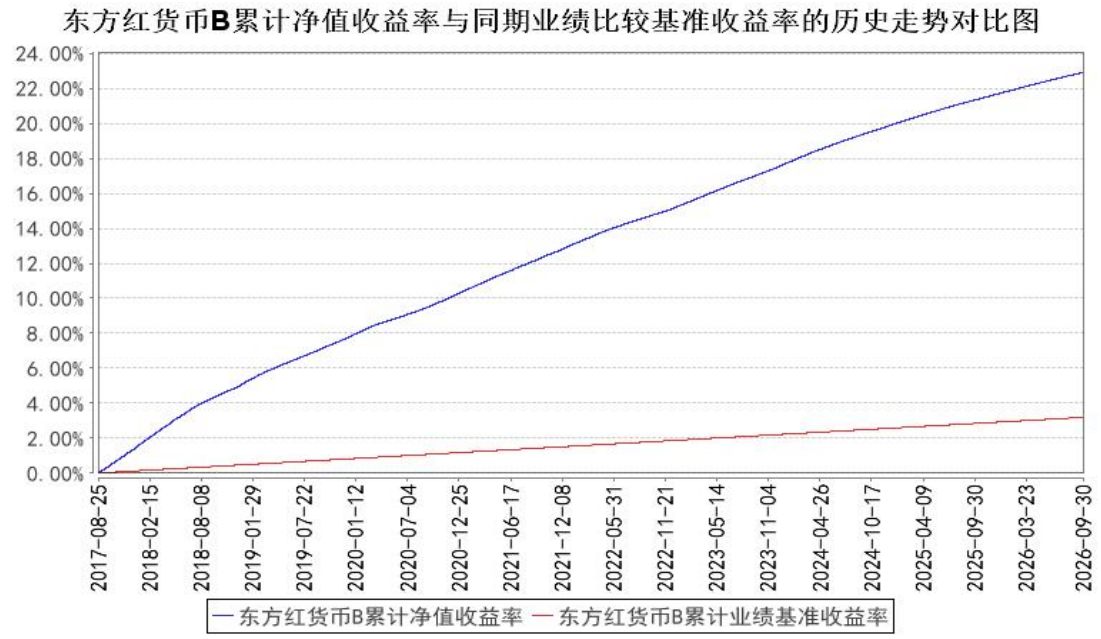
东方红货币 F

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.2706%	0.0009%	0.0882%	0.0000%	0.1824%	0.0009%
过去六个月	0.5562%	0.0009%	0.1755%	0.0000%	0.3807%	0.0009%
自基金合同生效起至今	0.7212%	0.0010%	0.2215%	0.0000%	0.4997%	0.0010%

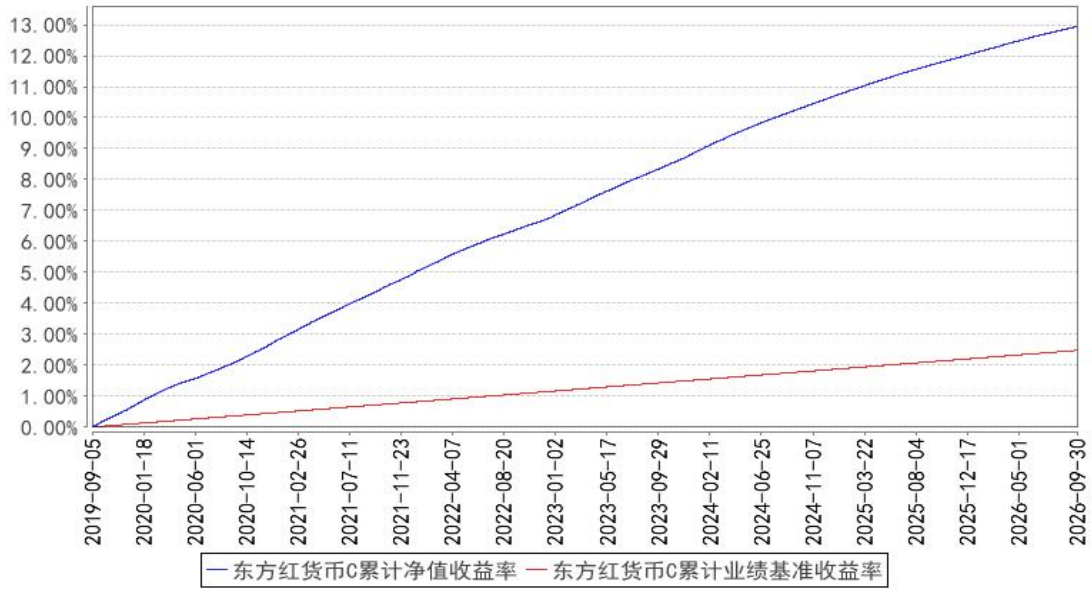
注：本基金收益分配按日结转份额。

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

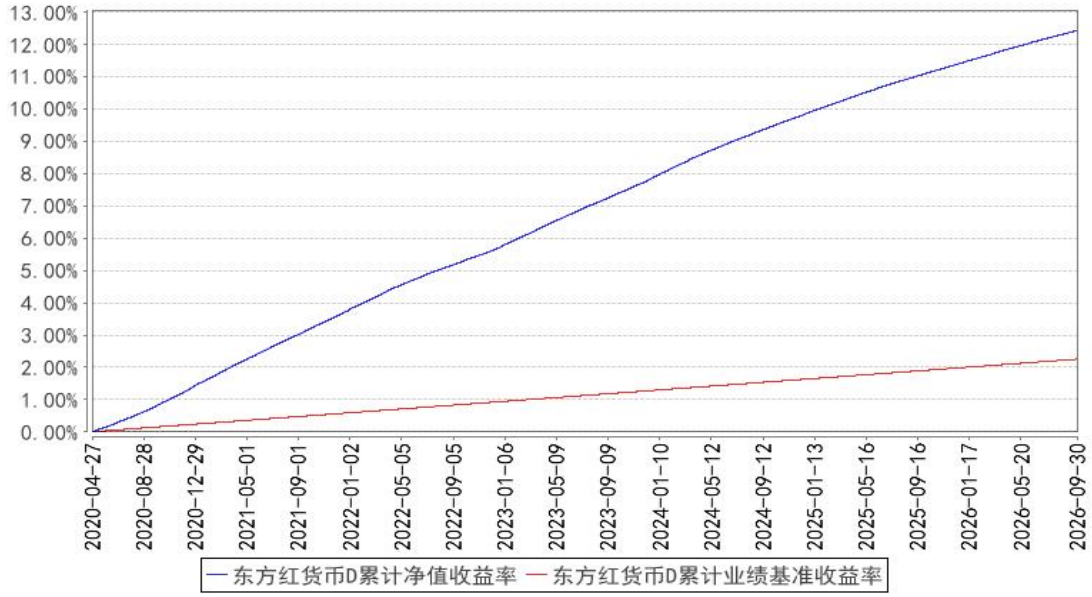


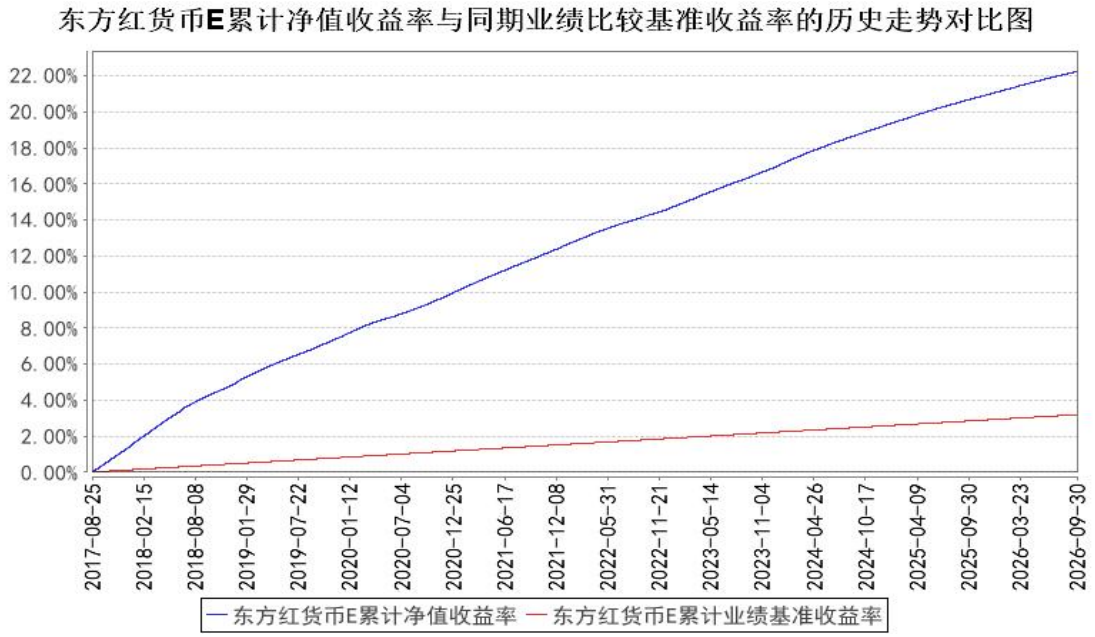


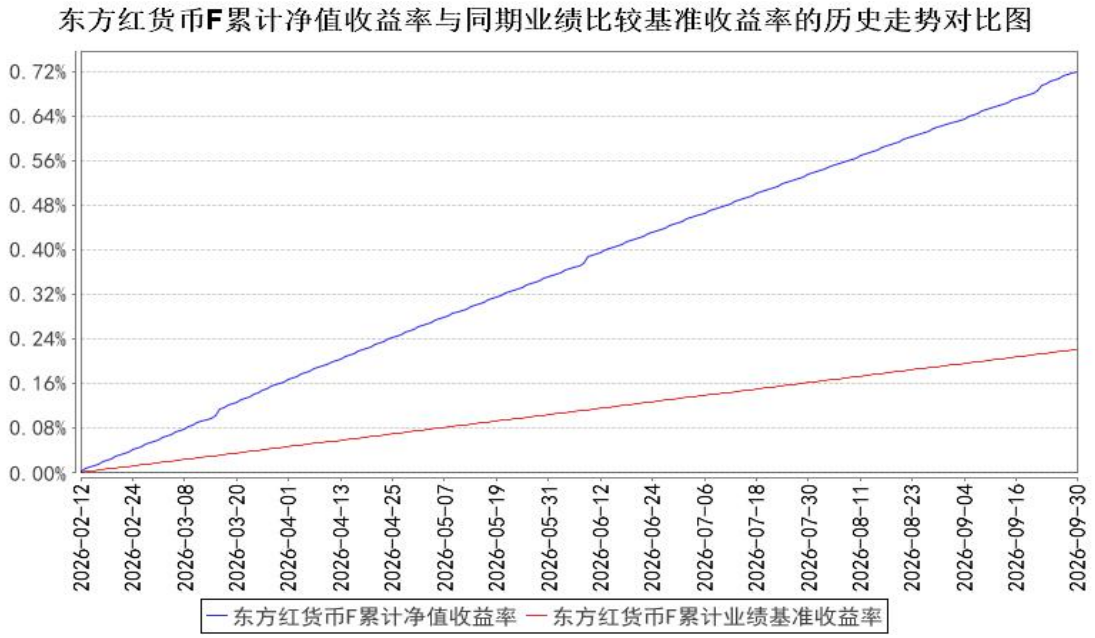
东方红货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方红货币D累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图







§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李燕	上海东方证券资产管理有限公司基金经理	2017 年 10 月 25 日	-	25 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2017 年 10 月至今任东方红货币市场基金基金经理、2022 年 05 月至今任东方红短债债券型证券投资基金基金经理、2022 年 12 月至今任东方红中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理、2023 年 11 月至今任东方红 90 天持

					有期纯债债券型证券投资基金基金经理、2023 年 12 月至今任东方红 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理。东北财经大学金融学硕士。曾任国信证券股份有限公司电子商务部职员，富国基金管理有限公司运营部基金会计、基金会计主管、总监助理、副总监，上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部业务总监。具备证券投资基金从业资格。
陈玄璇	上海东方证券资产管理有限公司基金经理、基金经理助理	2025 年 11 月 28 日	-	9 年	上海东方证券资产管理有限公司基金经理、基金经理助理，2023 年 08 月至今任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理、2023 年 08 月至今任东方红信用债债券型证券投资基金基金经理助理、2023 年 10 月至 2026 年 09 月任东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理助理、2023 年 10 月至今任东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、2023 年 10 月至今任东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理、2025 年 02 月至今任东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理、2024 年 08 月至今任东方红季鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理、2025 年 11 月至今任东方红货币市场基金基金经理、2026 年 01 月至今任东方红鑫泰 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、2026 年 01 月至今任东方红鑫安 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、2026 年 04 月至今任东方红鼎鸿债券型证券投资基金基金经理。上海交通大学金融硕士。曾任上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究员、固定收益研究部信用组组长。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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

2026 年三季度国内经济整体走势相比二季度变化不大，结构上依然延续外需明显强于内需，生产强于消费的特征，科技为代表的新质生产力增速加快，传统行业仍有所走弱，固定资产投资同比负值有所扩大，整体投融资需求依然偏弱；CPI 同比保持低位，PPI 同比受油价波动的影响先下后上。政策方面，财政端仍以用好用足现有政策为主，支出进度整体偏慢；货币政策数量上相比二季度更偏呵护，价格上在海外加息预期高企的背景下仍按兵不动。流动性整体保持宽松，资金利率保持低位，在隔夜逆回购的呵护下，资金利率更加平稳，一年 AAA 同业存单收益率先上后下，整体窄幅波动。

本报告期内，本基金整体配置偏积极，并及时把握市场交易时机，做好流动性管理的同时，为投资者获取了较为稳健的回报。

展望 2026 年四季度，这是全年经济的收官之季，在内需偏弱、海外地缘关系更趋复杂化、前三季度财政进度偏慢的背景下，政策有托底的空间，货币政策预计仍将维持宽松，流动性将保持合理充裕，货币市场利率将保持低位波动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 类份额净值收益率为 0.2706%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%;B 类份额净值收益率为 0.3058%,同期业绩比较基准收益率为 0.0882%;C 类份额净值收益率为 0.2448%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%;D 类份额净值收益率为 0.2831%，同期业绩比较基准收益率

为 0.0882%;E 类份额净值收益率为 0.3058%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%;F 类份额净值收益率为 0.2706%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	25,939,368,317.60	52.10
	其中：债券	25,939,368,317.60	52.10
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,087,017,050.45	12.23
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	17,757,153,632.82	35.67
4	其他资产	170,323.77	0.00
5	合计	49,783,709,324.64	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.22	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	1,435,292,901.48	2.97
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	74

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	28.91	2.97
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.21	-
2	30 天（含）—60 天	7.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	36.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	22.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		103.00	2.97

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,644,300,800.82	3.40
	其中：政策性金融债	1,531,523,506.45	3.17
4	企业债券	20,333,049.14	0.04
5	企业短期融资券	1,244,774,235.08	2.58
6	中期票据	20,536,501.54	0.04
7	同业存单	23,009,423,731.02	47.61
8	其他	-	-
9	合计	25,939,368,317.60	53.67
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	100,613,751.87	0.21

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	公允价值（元）	占基金资

					产净值比例（%）
1	09250409	25 农发清发 09	4,960,000	496,739,954.65	1.03
2	112608251	26 中信银行 CD251	4,000,000	398,993,997.24	0.83
3	112615207	26 民生银行 CD207	4,000,000	398,927,213.48	0.83
4	112610169	26 兴业银行 CD169	4,000,000	398,699,158.55	0.82
5	112610172	26 兴业银行 CD172	4,000,000	398,620,929.85	0.82
6	112605062	26 建设银行 CD062	4,000,000	398,573,296.85	0.82
7	112617081	26 光大银行 CD081	4,000,000	394,259,053.36	0.82
8	240202	24 国开 02	3,500,000	356,930,455.70	0.74
9	112615108	26 民生银行 CD108	3,500,000	349,066,033.51	0.72
10	112681043	26 长沙银行 CD158	3,500,000	348,853,780.44	0.72

5.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0092%
报告期内偏离度的最低值	0.0027%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0066%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑买入时的溢价和折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

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

本基金投资的前十名证券发行主体中，长沙银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行湖南省分行的处罚，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚，中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局宁波监管局的处罚，中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	30,461.58
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	139,862.19
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	170,323.77

5.9.4 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	东方红货币 A	东方红货币 B	东方红货币 C	东方红货币 D	东方红货币 E	东方红货币 F
报告期期初	98,489,334.33	12,979,925,657.26	8,923,513,385.12	14,338,308,909.66	11,044,094,018.66	21,113.80

基金份额总额						
报告期期间基金总申购份额	88,755,063.30	16,887,760,960.00	76,179,366,966.02	59,516,311,667.45	41,891,632,328.14	80,258.60
报告期期间基金总赎回份额	20,025,234.78	15,865,444,016.26	76,169,884,009.90	58,111,972,667.05	43,447,165,064.17	301.00
报告期期末基金份额总额	167,219,162.85	14,002,242,601.00	8,932,996,341.24	15,742,647,910.06	9,488,561,282.63	101,071.40

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	红利再投资	-	2,402,028.97	0.00	0.0000
2	申购	2026-07-20	450,000,000.00	450,000,000.00	0.0000
3	申购	2026-08-14	100,000,000.00	100,000,000.00	0.0000
合计			552,402,028.97	550,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予注册东方红货币市场基金的文件；

2、《东方红货币市场基金基金合同》；

3、《东方红货币市场基金托管协议》；

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。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司

2026 年 10 月 27 日