

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

2025 年 12 月 31 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

报告送出日期：2026 年 1 月 22 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 01 月 20 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 2025 年 10 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	57,069,112.16 份
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。	
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	
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	24,121,301.21 份	32,947,810.95 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（2025 年 10 月 1 日-2025 年 12 月 31 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
1. 本期已实现收益	731,232.09	1,103,436.15
2. 本期利润	454,895.87	907,544.14
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0195	0.0250
4. 期末基金资产净值	32,402,919.20	43,998,591.30
5. 期末基金份额净值	1.3433	1.3354

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

东方红中证 500 指数增强发起 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	1.15%	1.07%	0.71%	1.18%	0.44%	-0.11%
过去六个月	14.88%	0.98%	24.81%	1.11%	-9.93%	-0.13%
过去一年	18.17%	1.12%	28.81%	1.20%	-10.64%	-0.08%
自基金合同生效起至今	34.33%	1.23%	52.99%	1.48%	-18.66%	-0.25%

东方红中证 500 指数增强发起 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	1.05%	1.07%	0.71%	1.18%	0.34%	-0.11%
过去六个月	14.65%	0.98%	24.81%	1.11%	-10.16%	-0.13%
过去一年	17.70%	1.12%	28.81%	1.20%	-11.11%	-0.08%
自基金合同生效起至今	33.54%	1.23%	52.99%	1.48%	-19.45%	-0.25%

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

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



注：本基金建仓期 6 个月，即从 2024 年 07 月 09 日起至 2025 年 01 月 08 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（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	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

	公司量化投资部总经理、基金经理			投资基金基金经理、2021 年 12 月至今任东方红中证东方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

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 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

投资策略回顾和展望

报告期内，稳增长政策与资本市场改革预期延续，A 股在高位震荡中偏强运行：上证指数在三季度末 3882.78 点的基础上，四季度累计涨约 2.2%，12 月 31 日收于 3968.84 点。整体呈现“高位震荡、结构分化”特征：10 月底至 11 月中旬指数数次突破 4000 点整数关口，风险偏好一度抬升；而进入 12 月后波动加大、热点轮动加快，成交额维持在较高水平但边际有所降温，显示资金在估值与盈利验证之间更趋审慎。

宏观层面仍处于“温和修复、内需偏弱”的组合：价格端边际回暖，11 月 CPI 同比上涨 0.7%（核心 CPI 同比约 1.2%），食品价格回升对通胀形成支撑；景气端改善，12 月制造业 PMI 回升至 50.1%，重返扩张区间。货币端维持适度宽松取向，11 月末 M2 同比增长 8.0%。信用端延续“社融韧性强、信贷偏弱”的结构：政府债融资对社融形成主要支撑，而居民与部分实体部门融资意愿仍偏谨慎（11 月新增社融约 2.49 万亿元、新增人民币贷款约 3,900 亿元）；同时，地方化债推进对贷款余额形成“存量回收”效应，也在统计层面对贷款增速带来阶段性下拉。外需方面，11 月外贸增速回升，出口同比增长约 5.7%，在市场多元化与高附加值产品支撑下保持韧性。

投资层面，四季度定价在强调“估值约束”与“主题热度”间反复。12 月下半月市场走势超出预料，截至 20251231，上证指数走出 11 连阳，有望打破历史连阳记录。但市场行情高度结构化的现象没有改变，行情高度收敛，风格内部缩圈。唯一观察到的新变化是非银中保险的破圈，存在成为阶段性新主线的条件。总体而言，强势个股或者板块在 11 月似乎经受住了调整考验，虽然不断缩圈，但人气较强，风险偏好不断提高，目前看强势地位得到确认，可能处在估值修复的

最后阶段。考虑到 2026 年市场将对 2025 年三季度以来拔估值行业的业绩增长进行考验，我们预计全年行情会有波动。但在短期无法证伪的情况下，涨跌速率主要由资金面博弈决定。

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。四季度三个月中，十和十一两个月的调整中产品超额收益显著恢复，但 12 月下半月以来主题品种的强势反弹使得产品回吐了约 80BP 的超额收益，结构化主题投资再次对于超额收益的积累造成冲击。回顾四季度行情，在宽基指数中，极致的结构化主题投资在中证 500 行业 and 市值分布中的矛盾更加突出。三个重点科技板块和有色金属在中证 500 中的占比在三季度的大涨后进一步提高到约 40%。虽然长期看只有少数个股能够困境反转或出现二次增长，但短期子行业景气带来的利润改善将改变投资者预期并基于这种改善将长期持续而给出估值并形成股价的大幅上涨。

展望 2026 年第一季度，外部环境仍可能围绕关税问题在“加码—谈判—延期”间反复切换，对风险偏好与外需预期形成扰动；但市场对相关博弈框架已更为熟悉，若更多体现为节奏调整而非范围外溢，边际冲击将不断弱化。除关税外，还需关注国际政治与全球秩序重塑带来的不确定性：供应链重构、科技与安全议题外溢，以及区域冲突反复，可能在关键事件窗口推升风险溢价，扰动外资配置节奏，并放大市场波动。

国内政策延续“稳中求进、托底与结构优化”主线，但叙事正从“需求不足”转向“物价回升”。随着财政支出强度提升，一季度需重点跟踪 CPI 与 PPI 的边际改善能否兑现，这决定实际利率能否有效下行，并带动基本面与估值的双重修复；同时，“财政脉冲→信用扩张→盈利修复”的传导仍需通过社融“开门红”、政府债发行与基建强度进行高频验证。

风格层面，在总体风险偏好提升的前提下，不同资金主体的诉求仍然会有不同。部分机构投资者或更偏好“确定性”与“股东回报”，高质量、高分红资产年初具有配置价值。市场活跃资金仍将主攻科技方向，但无论是 AI 应用还是新质生产力（低空经济、人形机器人、高端芯片等），都将更看重订单与产业化节奏。市场在上涨中主题交易都不会缺席，而且会随着政策催化与事件节点形成阶段性高弹性波段，关键在于把握机会的同时控制波动。

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 1.3433 元，份额累计净值为 1.3433 元；C 类份额净值为 1.3354 元，份额累计净值为 1.3354 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 1.15%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%；C 类份额净值增长率为 1.05%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%。

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	权益投资	66,798,704.20	84.40
	其中：股票	66,798,704.20	84.40
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	9,480,252.06	11.98
8	其他资产	2,866,670.68	3.62
9	合计	79,145,626.94	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	40,500.00	0.05
B	采矿业	2,242,693.00	2.94
C	制造业	36,986,102.00	48.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,743,365.00	2.28
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,943,896.00	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	1,124,285.00	1.47
H	住宿和餐饮业	60,648.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,257,018.00	4.26
J	金融业	4,716,325.20	6.17
K	房地产业	212,700.00	0.28
L	租赁和商务服务业	29,200.00	0.04

M	科学研究和技术服务业	246,173.00	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	67,700.00	0.09
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	1,176,246.00	1.54
S	综合	246,730.00	0.32
	合计	54,093,581.20	70.80

5.2.2 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	78,954.00	0.10
B	采矿业	219,708.00	0.29
C	制造业	10,011,412.00	13.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	273,818.00	0.36
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	196,489.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	77,634.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	400,289.00	0.52
J	金融业	658,511.00	0.86
K	房地产业	52,792.00	0.07
L	租赁和商务服务业	281,473.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	81,576.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	146,847.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,880.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	192,794.00	0.25
S	综合	11,946.00	0.02
	合计	12,705,123.00	16.63

5.2.3 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。

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 报告期末指数投资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	600549	厦门钨业	46,300	1,901,078.00	2.49

2	002841	视源股份	44,100	1,747,683.00	2.29
3	301308	江波龙	6,600	1,615,944.00	2.12
4	000783	长江证券	159,500	1,299,925.00	1.70
5	601865	福莱特	65,000	1,018,550.00	1.33
6	600998	九州通	189,800	971,776.00	1.27
7	600332	白云山	36,600	942,084.00	1.23
8	002008	大族激光	22,000	906,180.00	1.19
9	688002	睿创微纳	8,700	876,960.00	1.15
10	002156	通富微电	22,200	836,940.00	1.10

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	300296	利亚德	82,500	521,400.00	0.68
2	603890	春秋电子	31,600	509,708.00	0.67
3	600490	鹏欣资源	60,500	467,665.00	0.61
4	603185	弘元绿能	10,700	326,350.00	0.43
5	000049	德赛电池	11,700	314,496.00	0.41

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
----	----	----------	---------	-----------	------

IC2601	IC2601	3	4,473,120.00	285,400.00	-
公允价值变动总额合计（元）					285,400.00
股指期货投资本期收益（元）					64,549.23
股指期货投资本期公允价值变动（元）					111,600.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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：本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末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发行主体中，长江证券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湖北省分局的处罚。

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规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	581,505.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,285,165.08
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,866,670.68

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

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告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。

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	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
报告期期初基金份额总额	24,728,316.40	39,238,667.00
报告期期间基金总申购份额	6,512,508.75	61,174,000.04
减：报告期期间基金总赎回份额	7,119,523.94	67,464,856.09
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	24,121,301.21	32,947,810.95

§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	东方红中证 500 指数增强发起 A	东方红中证 500 指数增强发起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,003,600.36	-
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	10,003,600.36	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	41.47	-

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	10,003,600.36	17.53	10,000,000.00	17.52	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	17.53	10,000,000.00	17.52	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

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。

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、东方红中证 500 指数增强型发起式证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、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 1 月 22 日