

东方红中证港股通高股息投资指数型证券  
投资基金  
2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 04 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 03 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 东方红中证港股通高股息投资指数  |
| 基金主代码      | 024227   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2025 年 8 月 19 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 820,497,162.08 份   |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  |
| 投资策略       | <p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票投资组合。同时为实现对标的指数更好地跟踪，本基金将辅以适当的替代性策略调整组合。本基金力争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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>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</p> |

|                 |   |                   |
|-----------------|---|-------------------|
|                 | 等。  |                   |
| 业绩比较基准          | 中证港股通高股息投资指数收益率(经估值汇率调整)×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%   |                   |
| 风险收益特征          | <p>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。</p> <p>本基金是指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金主要投资于香港证券市场，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，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。</p> |                   |
| 基金管理人           | 上海东方证券资产管理有限公司  |                   |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司  |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 东方红中证港股通高股息投资指数 A   | 东方红中证港股通高股息投资指数 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 024227  | 024228            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 686,440,090.34 份  | 134,057,071.74 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 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日） |                   |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------|
|                 | 东方红中证港股通高股息投资指数 A                   | 东方红中证港股通高股息投资指数 C |
| 1. 本期已实现收益      | 12,328,608.17                       | 2,326,869.08      |
| 2. 本期利润         | 40,889,613.21                       | 8,114,339.71      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0468                              | 0.0469            |
| 4. 期末基金资产净值     | 697,702,033.22                      | 136,110,773.87    |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0164                              | 1.0153            |

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

东方红中证港股通高股息投资指数 A

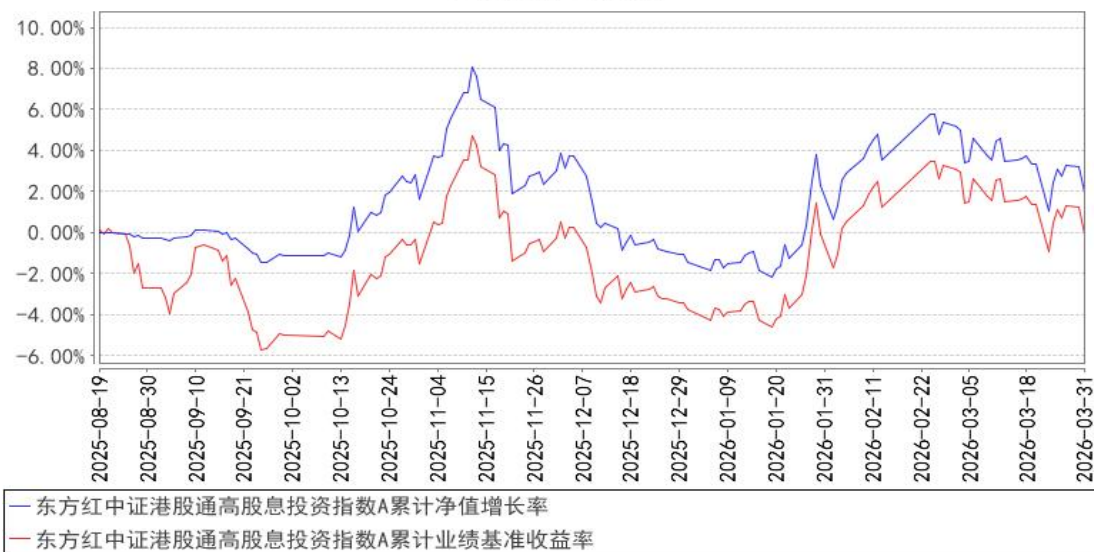
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 3.42%  | 0.87%     | 3.85%      | 0.88%         | -0.43% | -0.01% |
| 过去六个月      | 3.08%  | 0.82%     | 5.16%      | 0.85%         | -2.08% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.94%  | 0.73%     | -0.06%     | 0.82%         | 2.00%  | -0.09% |

东方红中证港股通高股息投资指数 C

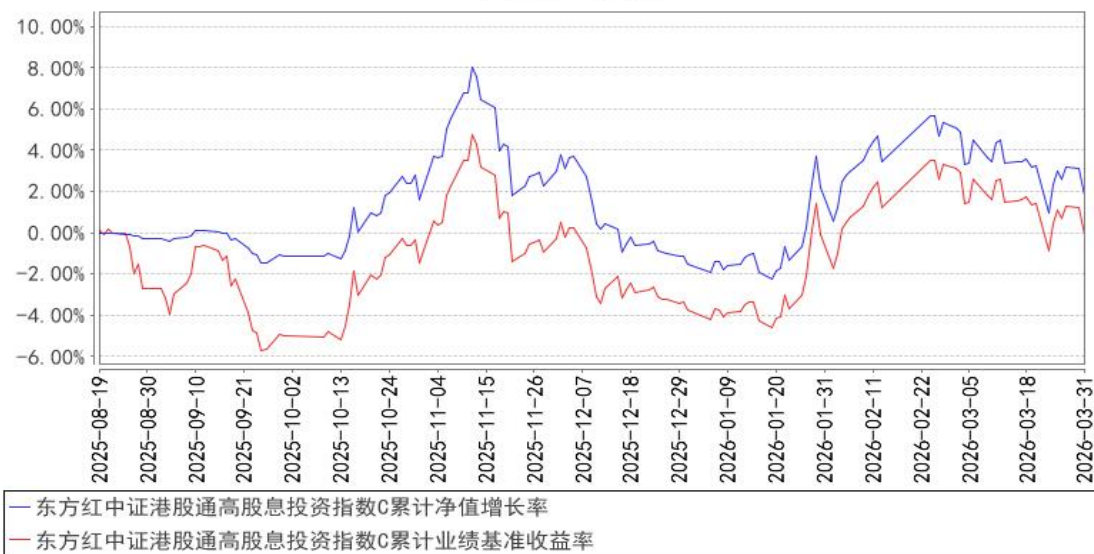
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 3.39%  | 0.87%     | 3.85%      | 0.88%         | -0.46% | -0.01% |
| 过去六个月      | 2.99%  | 0.82%     | 5.16%      | 0.85%         | -2.17% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.83%  | 0.73%     | -0.06%     | 0.82%         | 1.89%  | -0.09% |

#### 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

东方红中证港股通高股息投资指数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



东方红中证港股通高股息投资指数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：1、本基金合同于 2025 年 08 月 19 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

2、本基金建仓期 6 个月，即从 2025 年 08 月 19 日起至 2026 年 02 月 18 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 |        |  |
| 戎逸洲 | 上海东方证券资产 | 2025 年 8 月 19 日 | -    | 10 年   | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2019 年 11 月至今任东方红中证竞争 |

|     |                             |                 |   |   |
|-----|-----------------------------|-----------------|---|---|
|     | 管理有限公司基金经理                  |                 |   | 力指数发起式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、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 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、2025 年 12 月至今任东方红中证全指指数增强型证券投资基金基金经理。福特汉姆大学理学硕士。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化研究员。具备证券投资基金从业资格。  |
| 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 | 2025 年 8 月 19 日 | - | 25 年<br>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        |
|-----|----------|---------|------------------|-------------|
| 戎逸洲 | 公募基金     | 6       | 1,987,341,041.55 | 2019年11月29日 |
|     | 私募资产管理计划 | 3       | 251,056,796.62   | 2025年1月13日  |
|     | 其他组合     | -       | -                | -           |
|     | 合计       | 9       | 2,238,397,838.17 | -           |
| 徐习佳 | 公募基金     | 10      | 9,293,826,545.68 | 2019年7月31日  |
|     | 私募资产管理计划 | 1       | 71,624,578.44    | 2026年1月23日  |
|     | 其他组合     | -       | -                | -           |
|     | 合计       | 11      | 9,365,451,124.12 | -           |

注：戎逸洲管理的 1 只单一产品已于 2026 年 2 月 11 日离任。

#### 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，H 股市场整体呈现“冲高回落、结构分化”的运行特征。恒生指数一季度盘中一度冲突 28000 点，季末收于 24730.56 点，单季度下跌 3.29%，为连续第二个季度下跌。整体来看，市场定价逻辑由前期风险偏好抬升驱动的普涨，逐步切换至对景气验证、盈利质量与估值匹配度的再评估，风格分化有所加大。

宏观层面，国内经济延续“温和修复、结构改善”的组合。价格端边际回暖，1—2 月 CPI 同比上涨 0.8%，核心 CPI 同比上涨 1.3%；其中 2 月单月 CPI 同比上涨 1.3%，核心 CPI 同比上涨 1.8%。PPI 降幅继续收窄，2 月同比下降 0.9%，1—2 月平均同比下降 1.2%。生产端表现相对较强，1—2 月规模以上工业增加值同比增长 6.3%，社会消费品零售总额同比增长 2.8%，固定资产投资同比增长 1.8%，其中基础设施投资同比增长 11.4%。3 月制造业 PMI 回升至 50.4%，重新回到扩张区间，表明企业生产经营景气水平在春节后有所修复。

货币与信用环境方面，前两个月金融总量仍保持较强支持力度。2026 年前两个月社会融资规模增量累计为 9.6 万亿元，2 月末社会融资规模存量同比增长 8.2%，M2 同比增长 9.0%；但人民币贷款余额同比增长 6.0%，前两个月新增人民币贷款 5.61 万亿元，仍体现出“社融较强、信贷偏弱”的结构特征。政府债融资继续是社融的重要支撑，同时地方化债推进过程中，再融资债置换存量隐性债务和平台贷款，也对贷款余额形成一定“存量回收”效应，在统计层面对贷款增速带来阶段性下拉。

投资层面，一季度市场从 2025 年三季度以来“风险偏好抬升+估值扩张”的普涨逻辑，逐步切换至“景气验证+结构分层”的定价阶段。从 A 股内部表现看，红利类资产和部分资源品方向相对占优，背后既有现金流稳定、股东回报清晰的“确定性”支撑，也有涨价预期、供给约束和盈利韧性带来的“稳定增速”逻辑；与此同时，科技方向并非全面走弱，而是从主题扩散逐步转向业绩筛选，部分受益于 AI 算力建设、存储涨价、光通信景气以及高端制造升级的细分领域，仍具备较强的增长预期和阶段性弹性，但市场对相关方向的定价也更加重视订单落地、产业化进展与业绩兑现。整体而言，市场交易并未消失，而是由此前的普涨转向更聚焦盈利质量、景气持续性与兑现能力的结构性演绎，板块内部的分化和缩圈特征较上年末进一步强化。

东方红中证港股通高股息投资指数基金致力于通过布局业务稳健、分红水平卓越的一揽子优质标的，构建具备长期复利潜力的投资组合。2026 年一季度，本基金 A 类份额小幅跑输业绩比较基准。

展望 2026 年二季度，外部环境仍面临经贸摩擦、贸易政策不确定性及地缘政治反复等多重扰动，外需与风险偏好可能仍有波动；但市场对相关不确定性的交易框架已较此前更为熟悉，若后续更多体现为节奏反复而非全面升级，其边际冲击有望趋于减弱。国内政策方面，2026 年政府工作报告继续强调“实施更加积极有为的宏观政策”，并将经济增长目标设定为 4.5%—5%、居民消费价格涨幅目标设定为 2%左右，政策主线仍是“稳中求进、托底增长、推动物价合理回升”。后续仍需继续观察价格端改善、财政脉冲向信用扩张和企业盈利传导的斜率，以及市场对盈利修复的验证情况。

风格层面，在年报和一季报逐步披露的窗口期，市场对“确定性”“股东回报”以及“稳定增速”的重视预计仍将维持。高质量、高分红资产在低利率环境和分红制度持续强化背景下，仍是绝对收益资金和配置盘的重要底仓；同时，科技成长与新质生产力方向仍不乏阶段性机会，但市场将更重视产业化节奏、订单落地与业绩兑现，板块内部的分化预计仍会较大。

#### 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 1.0164 元，份额累计净值为 1.0194 元；C 类份额净值为 1.0153 元，份额累计净值为 1.0183 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 3.42%，同期业绩比较基准收益率为 3.85%；C 类份额净值增长率为 3.39%，同期业绩比较基准收益率为 3.85%。

#### 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   | 767,329,149.97 | 90.29        |
|    | 其中：股票  | 767,329,149.97 | 90.29        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 60,541,528.77  | 7.12         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：债券             | 60,541,528.77  | 7.12   |
|   | 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      | 16,383,126.62  | 1.93   |
| 8 | 其他资产              | 5,561,538.57   | 0.65   |
| 9 | 合计                | 849,815,343.93 | 100.00 |

注：1、本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 767,329,149.97 元人民币，占期末基金资产净值比例 92.03%。

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

注：本基金本报告期末未持有指数投资的境内股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 10 能源   | 151,619,573.60 | 18.18        |
| 15 原材料  | -              | -            |
| 20 工业   | 183,325,495.77 | 21.99        |
| 25 可选消费 | 46,737,368.94  | 5.61         |
| 30 主要消费 | 32,839,117.88  | 3.94         |
| 35 医药卫生 | -              | -            |
| 40 金融   | 260,172,214.65 | 31.20        |
| 45 信息技术 | -              | -            |
| 50 通信服务 | 51,508,627.67  | 6.18         |
| 55 公用事业 | 23,913,588.23  | 2.87         |
| 60 房地产  | 17,213,163.23  | 2.06         |
| 合计      | 767,329,149.97 | 92.03        |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

## 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  | 01919 | 中远海控   | 3,466,000 | 45,598,540.03 | 5.47         |
| 2  | 03808 | 中国重汽   | 1,154,000 | 39,513,884.35 | 4.74         |
| 3  | 00883 | 中国海洋石油 | 1,390,000 | 34,364,414.00 | 4.12         |
| 4  | 00288 | 万洲国际   | 3,625,000 | 32,839,117.88 | 3.94         |
| 5  | 01088 | 中国神华   | 800,500   | 32,597,684.03 | 3.91         |
| 6  | 01308 | 海丰国际   | 1,069,000 | 32,167,210.58 | 3.86         |
| 7  | 01898 | 中煤能源   | 2,742,000 | 31,957,845.48 | 3.83         |
| 8  | 00857 | 中国石油股份 | 3,270,000 | 31,037,899.88 | 3.72         |
| 9  | 03360 | 远东宏信   | 4,809,000 | 29,892,590.11 | 3.59         |
| 10 | 01988 | 民生银行   | 8,553,500 | 27,716,988.07 | 3.32         |

注：对于同时在 A+H 股上市股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 5.4 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      | 60,541,528.77 | 7.26         |
|    | 其中：政策性金融债 | 60,541,528.77 | 7.26         |
| 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） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 60,541,528.77 | 7.26         |

### 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 250431 | 25 农发 31 | 600,000 | 60,541,528.77 | 7.26         |

### 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：本基金本报告期末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，达到有效跟踪标的指数的目标。

## 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，中国农业发展银行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。

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   | -            |
| 2  | 应收证券清算款 | 4,794,922.73 |
| 3  | 应收股利    | 568,001.49   |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 198,614.35   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 5,561,538.57 |

### 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                        | 东方红中证港股通高股息<br>投资指数 A | 东方红中证港股通高股息<br>投资指数 C |
|---------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,033,394,955.05      | 204,992,280.95        |
| 报告期期间基金总申购份额              | 39,306,827.18         | 60,108,905.97         |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 386,261,691.89        | 131,044,115.18        |
| 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 | 686,440,090.34 | 134,057,071.74 |
|-------------|----------------|----------------|

## §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

注：本报告期，本基金管理人未持有本基金份额。

### 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 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中证港股通高股息投资指数型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红中证港股通高股息投资指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红中证港股通高股息投资指数型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。

### 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 4 月 22 日