

# 东方红新海混合型证券投资基金

## 2026 年第 2 季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 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规定，于 2026 年 07 月 17 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。

2021 年 7 月 9 日东方红新海混合型证券投资基金由东方红-新睿 2 号集合资产管理计划变更而来，基金合同当日生效。由大集合份额转型而来的 A 类基金份额生效日为基金合同生效日。

本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 东方红新海混合                                                                                                        |
| 基金主代码      | 910010                                                                                                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式，原东方红-新睿 2 号集合资产管理计划份额变更为 A 类基金份额，基金合同生效后，基金管理人<br>不办理该类基金份额的申购业务，红利再投资份额除外，<br>投资者可在开放赎回业务后每个开放日办理赎回业务。 |
| 基金合同生效日    | 2021 年 7 月 9 日                                                                                                 |
| 报告期末基金份额总额 | 37,119,946.23 份                                                                                                |
| 投资目标       | 本基金以自上而下和自下而上相结合的方式，深入研究和挖掘权益类资产、可转债和其他债券类资产的投资价值，在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。                 |
| 投资策略       | 1、资产配置：本基金将动态跟踪全球主要经济体的 GDP、CPI、PMI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利                                                        |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>预期、流动性、投资者心态等市场指标，全面评估上述关键指标，预测其变动趋势，从而对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。在目标收益条件下，追求风险最小化，最终确定股票、债券等大类资产投资权重，实现资产合理配置。</p> <p>2、股票投资策略：（1）自上而下和自下而上相结合的投资策略：通过综合使用自上而下和自下而上的投资策略，进一步提高研究和投资的效率，尽量避免使用单一策略可能造成的“过度自信”风险，力争实现资产的长期稳健增值。（2）基于行业轮动和风格轮动的投资策略：本基金以宏观经济短、中、长周期的研究为基础，通过对不同行业、不同市场风格的制度性、结构性或周期性的发展趋势或发展动力进行前瞻性的研究与分析，挖掘并投资能集中代表行业发展趋势、市场风格演绎趋势的上市公司。（3）基本面选股投资策略：本基金基本面选股策略重点关注三个方面：公司素质、成长空间及未来公司盈利增速、目前的估值。（4）逆向投资策略：本基金还将关注市场中存在的逆向投资机会，通过适度逆向策略来选择个股。</p> <p>3、港股投资策略：本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。</p> <p>4、存托凭证的投资策略：本基金投资存托凭证的策略依照上述内地上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>5、可转债投资策略：（1）可转债基本投资策略：本基金在可转债投资上，同样会使用自上而下和自下而上相结合的投资策略。（2）套利策略：在可转债的发行期内，对于优先配售条款较好、配售收益较高的可转债，本基金将买入对应股票并积极参与可转债配售；待可转债上市后，将根据其合理内在价值的高低决定继续持有或者</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                 |                                                                                                                                                                           |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | 卖出，以增强投资组合收益。<br><br>6、此外，本基金还会运用折价套利策略、衍生品投资策略、债券等其他固定收益类投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资业务策略等。                                                                       |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）*10%+中债综合指数收益率*40%。                                                                                                                      |
| 风险收益特征          | 本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。<br><br>本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
| 基金管理人           | 上海东方证券资产管理有限公司                                                                                                                                                            |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                                                              |
| 下属分级基金的基金简称     | 东方红新海混合 A                                                                                                                                                                 |
| 下属分级基金的交易代码     | 910010                                                                                                                                                                    |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 37,119,946.23 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 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
|                 | 东方红新海混合 A                           |
| 1. 本期已实现收益      | 10,068,682.17                       |
| 2. 本期利润         | 32,052,670.33                       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.8286                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 93,339,753.73                       |
| 5. 期末基金份额净值     | 2.5145                              |

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

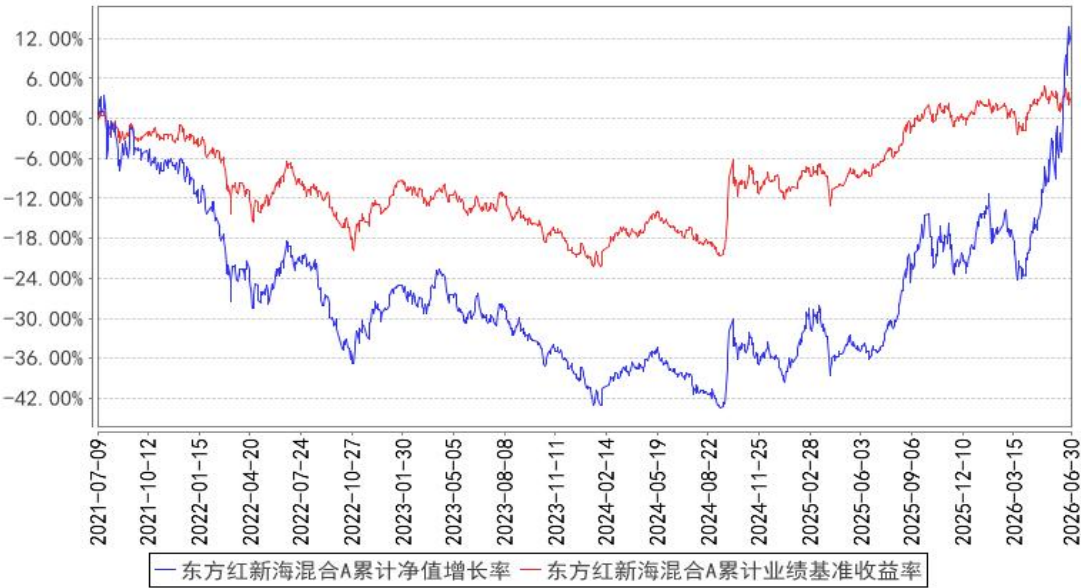
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方红新海混合 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      | 50.01% | 2.05%     | 5.16%      | 0.70%         | 44.85% | 1.35% |
| 过去六个月      | 41.78% | 1.86%     | 2.72%      | 0.65%         | 39.06% | 1.21% |
| 过去一年       | 74.84% | 1.62%     | 11.53%     | 0.58%         | 63.31% | 1.04% |
| 过去三年       | 61.53% | 1.30%     | 19.41%     | 0.65%         | 42.12% | 0.65% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.93% | 1.26%     | 3.30%      | 0.66%         | 10.63% | 0.60% |

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

东方红新海混合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



§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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 高义 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理 | 2021 年 7 月 9 日 | -    | 17 年   | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2021 年 01 月至 2023 年 04 月任东方红多元策略混合型证券投资基金基金经理、2021 年 03 月至 2023 年 10 月任东方红启瑞三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 07 月至今任东方红新源三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 07 月至今任东方红新海混合型证券投资基金基金经理、2025 年 09 月至今任东方红医疗创新混合型证券投资基金（QDII）基金经理。北京大学经济学博士。曾任东方证券研究所宏观策略高级研究员、资产管理业务总部首席策略师，上海东方证券资产管理有限公司宏观策略研究员、投资主办人、投资经理。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

二季度 A 股市场整体在政策托底支撑下稳步修复、震荡上行，但板块、行业轮动较快，结构分化显著，成长风格和科技行业占据绝对优势。其中，上证指数小幅上涨，创业板、科创板指数大幅上涨。行业层面，与全球人工智能浪潮关联密切的电子、半导体、通信等科技行业，景气度持续走高，成为资金核心配置方向；而前期强势的有色、锂电、黄金等周期资源板块在通胀、加息预期下，热度回落、估值承压；传统行业如石油石化、农林牧渔、钢铁、商贸零售、美容护理、食品饮料则表现落后。结合宏观状态、产业趋势和市场风格的变化，报告期内，本产品积极运作，对持仓品种进行适度调整，投资重心从资源、锂电等品类，更多的转向电子、半导体、通信等高端科技赛道，科技板块成为组合核心底仓，以匹配当前高端制造、科创成长为主的市场主线。债券方面，主要是减配部分达到强赎条件的转债，增配国债等高等级固收品种。总体上，本产品组合配置体现为成长进攻+固收防守的均衡架构。前瞻来看，当前及今后一段时间，预计弱复苏的经济状态、偏强的市场趋势和行业景气分化的特征仍会持续，市场可能继续维持偏强状态，发生系统性风险的概率较低。但由于二季度的快速上涨和极致分化，预计市场的波动性会明显加大。本产品将灵活调整仓位和组合，力争为投资者获取稳健回报。

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 2.5145 元，份额累计净值为 3.2725 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 50.01%，同期业绩比较基准收益率为 5.16%。

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              | 63,946,303.96 | 68.15  |
|   | 其中：股票             | 63,946,303.96 | 68.15  |
| 2 | 基金投资              | —             | —      |
| 3 | 固定收益投资            | 23,635,541.82 | 25.19  |
|   | 其中：债券             | 23,635,541.82 | 25.19  |
|   | 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      | 6,210,484.13  | 6.62   |
| 8 | 其他资产              | 42,270.99     | 0.05   |
| 9 | 合计                | 93,834,600.90 | 100.00 |

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —             | —            |
| B  | 采矿业              | —             | —            |
| C  | 制造业              | 63,183,623.96 | 67.69        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —             | —            |
| E  | 建筑业              | —             | —            |
| F  | 批发和零售业           | —             | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —             | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 762,680.00    | 0.82         |
| J  | 金融业              | —             | —            |
| K  | 房地产业             | —             | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —             | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —             | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —             | —            |
| P  | 教育               | —             | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —             | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —             | —            |
| S  | 综合               | —             | —            |

|  |    |               |       |
|--|----|---------------|-------|
|  | 合计 | 63,946,303.96 | 68.51 |
|--|----|---------------|-------|

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 300604 | 长川科技 | 17,000 | 5,804,140.00 | 6.22         |
| 2  | 603986 | 兆易创新 | 5,700  | 4,645,500.00 | 4.98         |
| 3  | 688072 | 拓荆科技 | 5,272  | 4,636,882.16 | 4.97         |
| 4  | 002384 | 东山精密 | 16,500 | 4,328,775.00 | 4.64         |
| 5  | 300308 | 中际旭创 | 3,400  | 4,318,000.00 | 4.63         |
| 6  | 688498 | 源杰科技 | 2,192  | 4,134,112.00 | 4.43         |
| 7  | 300502 | 新易盛  | 6,540  | 3,969,780.00 | 4.25         |
| 8  | 688808 | 联讯仪器 | 1,524  | 3,539,230.92 | 3.79         |
| 9  | 002463 | 沪电股份 | 22,300 | 3,407,440.00 | 3.65         |
| 10 | 600584 | 长电科技 | 28,400 | 2,940,820.00 | 3.15         |

### 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      | 11,693,237.10 | 12.53        |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | —             | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —             | —            |
| 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） | 11,942,304.72 | 12.79        |
| 8  | 同业存单      | —             | —            |
| 9  | 其他        | —             | —            |
| 10 | 合计        | 23,635,541.82 | 25.32        |

### 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  | 019827 | 26 国债 01 | 71,000 | 7,146,021.62 | 7.66         |
| 2  | 019792 | 25 国债 19 | 45,000 | 4,547,215.48 | 4.87         |
| 3  | 113052 | 兴业转债     | 19,350 | 2,226,945.91 | 2.39         |
| 4  | 118031 | 天 23 转债  | 13,100 | 1,589,471.45 | 1.70         |
| 5  | 110085 | 通 22 转债  | 13,870 | 1,552,760.94 | 1.66         |

### 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原则，以套期保值为目的，回避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合的超额收益。

### 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，回避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约，并与债券现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得债券组合的超额收益。

#### 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

本基金本报告期末进行国债期货投资。

### 5.11 投资组合报告附注

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

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

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同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   | 42,270.99 |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | —         |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | —         |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 其他      | —         |
| 8  | 合计      | 42,270.99 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 113052 | 兴业转债    | 2,226,945.91 | 2.39         |
| 2  | 118031 | 天 23 转债 | 1,589,471.45 | 1.70         |
| 3  | 110085 | 通 22 转债 | 1,552,760.94 | 1.66         |
| 4  | 127064 | 杭氧转债    | 953,333.17   | 1.02         |
| 5  | 128136 | 立讯转债    | 884,082.88   | 0.95         |
| 6  | 127038 | 国微转债    | 839,001.45   | 0.90         |
| 7  | 127089 | 晶澳转债    | 816,298.04   | 0.87         |
| 8  | 123142 | 申昊转债    | 410,706.39   | 0.44         |
| 9  | 113638 | 台 21 转债 | 381,415.28   | 0.41         |
| 10 | 113059 | 福莱转债    | 381,234.24   | 0.41         |
| 11 | 118034 | 晶能转债    | 377,938.15   | 0.40         |
| 12 | 123122 | 富瀚转债    | 256,038.03   | 0.27         |
| 13 | 118036 | 力合转债    | 249,797.85   | 0.27         |
| 14 | 118015 | 芯海转债    | 242,541.98   | 0.26         |
| 15 | 123262 | 神宇转债    | 238,524.53   | 0.26         |
| 16 | 127046 | 百润转债    | 191,527.50   | 0.21         |
| 17 | 127045 | 牧原转债    | 188,947.62   | 0.20         |
| 18 | 118011 | 银微转债    | 161,739.31   | 0.17         |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 688072 | 拓荆科技 | 4,636,882.16   | 4.97         | 重大事项停牌   |

### 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                        | 东方红新海混合 A     |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 40,222,881.96 |
| 报告期期间基金总申购份额              | —             |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 3,102,935.73  |
| 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               | 37,119,946.23 |

§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新海混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红新海混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红新海混合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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2026 年 7 月 21 日