

# 东方红汇裕债券型证券投资基金

## 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。  
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       | 东方红汇裕债券                                                                                                                                                                                                                       |
| 基金主代码      | 026055                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金合同生效日    | 2025 年 12 月 24 日                                                                                                                                                                                                              |
| 报告期末基金份额总额 | 117,016,581.67 份                                                                                                                                                                                                              |
| 投资目标       | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略       | 1、资产配置：根据定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置；<br>2、固定收益类投资策略：在债券个券选择方面，综合运用久期控制、期限结构配置、市场比较、相对价值判断、信用风险评估等方法严控风险，通过债券投资策略、信用债投资策略、可转换债券、可分离交易可转债和可交换债的投资策略、债券回购杠杆策略、证券公司短期公司债券投资策略等对固定收益类资产进行投资。 |

|                 |                                                                                                                                                                         |                 |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                 | 3、此外，本基金还会运用行业配置策略、个股选择策略、港股投资策略、存托凭证的投资策略、基金投资策略、国债期货投资策略及信用衍生品投资策略等。                                                                                                  |                 |
| 业绩比较基准          | 中债新综合财富指数收益率×80%+中证 800 指数收益率×12%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×3%+银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                   |                 |
| 风险收益特征          | 本基金是一只债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。<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     | 东方红汇裕债券 A                                                                                                                                                               | 东方红汇裕债券 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 026055                                                                                                                                                                  | 026056          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 50,355,816.94 份                                                                                                                                                         | 66,660,764.73 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） |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
|                 | 东方红汇裕债券 A                           | 东方红汇裕债券 C     |
| 1. 本期已实现收益      | 1,042,699.59                        | 1,132,412.24  |
| 2. 本期利润         | 3,469,427.59                        | 3,349,140.14  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0431                              | 0.0382        |
| 4. 期末基金资产净值     | 51,834,644.35                       | 68,476,243.59 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0294                              | 1.0272        |

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

东方红汇裕债券 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      | 3.64%  | 0.30%     | 2.30%      | 0.19%         | 1.34% | 0.11% |
| 过去六个月      | 2.99%  | 0.28%     | 2.57%      | 0.18%         | 0.42% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.94%  | 0.28%     | 2.62%      | 0.18%         | 0.32% | 0.10% |

东方红汇裕债券 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      | 3.53%  | 0.30%     | 2.30%      | 0.19%         | 1.23% | 0.11% |
| 过去六个月      | 2.78%  | 0.28%     | 2.57%      | 0.18%         | 0.21% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.72%  | 0.28%     | 2.62%      | 0.18%         | 0.10% | 0.10% |

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

东方红汇裕债券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



东方红汇裕债券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 12 月 24 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 12 月 24 日起至 2026 年 06 月 23 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 |        |                                          |
| 余剑峰 | 上海东方证券资产 | 2025 年 12 月 24 日 | -    | 8 年    | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2021 年 07 月至今任东方红明鉴优选 |

|  |            |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--|------------|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 管理有限公司基金经理 |  |  |  | 两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2023 年 02 月至今任东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2024 年 04 月至今任东方红慧鑫甄选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理、2025 年 09 月至今任东方红汇诚债券型证券投资基金基金经理、2025 年 10 月至今任东方红汇明债券型证券投资基金基金经理、2025 年 12 月至今任东方红汇裕债券型证券投资基金基金经理。浙江大学管理学博士。曾任申万宏源证券研究所分析师、国泰君安证券研究所分析师、上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究员。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遵规守信情况的说明

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

2026 第二季度，国际地缘政治冲突风险趋于缓解，国内供需两端同步扩张，高技术制造业持续向好，市场预期有所回升。整个季度看来，沪深 300 上涨 11.90%，中证 A500 上涨 14.26%，中证 800 上涨 13.71%，恒生综指下跌 7.87%，中债 10 年期国债到期收益率下行至 1.75%附近震荡。

股票投资策略上，组合采用了量化的风险管理方式，自上而下对宏观经济、行业板块、细分行业、投资风格四个层次构建了相应的风险预算配置体系，并将转债映射到正股进行统一的风险管理。回顾 2026 第二季度，综合考虑股债资产的投资性价比以及回撤控制目标，组合总体上将权益资产以均衡分散的风格维持在目标年化波动率 4%左右的水平。板块配置上，为了实现股债对冲效果，组合总体在各个行业板块上保持了标配。

债券投资策略上，组合整体保持了市场中性的久期和杠杆水平。债券组合部分整体以中债新综合财富总指数的关键期限结构作为基准，1 年以内的债券以满足产品流动性要求作为首要目的，1-5 年部分采用高等级信用债策略，5 年以上部分以利率债骑乘策略为主并择机采用了国债期货多头策略。债券组合整体以利率债和流动性好的高等级信用债构成，在保证流动性的前提下维持合理的杠杆水平以实现权益资产的风险对冲。

我始终坚信资产管理机构的专业性在于对风险的管理。理论上，获得超额收益的原因是承担了额外的风险。秉持这样的理念，我自上而下对宏观经济、行业板块、细分行业、投资风格四个层次构建了相应的风险预算配置体系，并将转债映射到相应正股进行统一的风险管理。在权益资产投资策略上，我坚持均衡配置的理念，采用宏观 Nowcast 模型、目标风险优化和回撤控制技术调整股债仓位，采用风险因子模型监控权益组合相对基准的跟踪误差。在行业板块和细分行业配置上，我采用了高频基本面的时序数据和行情截面数据进行跟踪建模，行业内部则采用了 SmartBeta 因子和基本面深度研究相结合的方式确定个股与权重。在债券资产投资策略上，我采用了关键期限模型来实现对基准指数的跟踪，并采用骑乘策略、高等级信用债、杠杆和久期调整等方式力求实现超额收益。通过纪律化、体系化的主动管理方式争取为组合带来相对稳健的表现。我将继续发挥自己在资产配置和风险管理上的优势，持续关注宏观环境变化带来的投资机会，在控制下行风险的同时争取获得超额收益。

#### 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 1.0294 元,份额累计净值为 1.0294 元;C 类份额净值为 1.0272 元,份额累计净值为 1.0272 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 3.64%,同期业绩比较基准收益率为 2.30%;C 类份额净值增长率为 3.53%,同期业绩比较基准收益率为 2.30%。

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              | 16,381,508.93  | 11.09        |
|    | 其中：股票             | 16,381,508.93  | 11.09        |
| 2  | 基金投资              | 7,748,674.01   | 5.25         |
| 3  | 固定收益投资            | 114,845,470.20 | 77.74        |
|    | 其中：债券             | 114,845,470.20 | 77.74        |
|    | 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      | 6,080,630.13   | 4.12         |
| 8  | 其他资产              | 2,675,272.16   | 1.81         |
| 9  | 合计                | 147,731,555.43 | 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 2,780,805.28 元人民币，占期末基金资产净值比例 2.31%。

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              | 760,603.00    | 0.63         |
| C  | 制造业              | 10,433,459.75 | 8.67         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 322,009.00    | 0.27         |



|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业             | 82,892.00     | 0.07  |
| F | 批发和零售业          | 120,000.00    | 0.10  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 164,105.00    | 0.14  |
| H | 住宿和餐饮业          | —             | —     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 475,473.90    | 0.40  |
| J | 金融业             | 817,228.00    | 0.68  |
| K | 房地产业            | —             | —     |
| L | 租赁和商务服务业        | 154,808.00    | 0.13  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 174,314.00    | 0.14  |
| 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       | 95,811.00     | 0.08  |
| S | 综合              | —             | —     |
|   | 合计              | 13,600,703.65 | 11.30 |

### 5.2.2 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   | —            | —            |
| 15 原材料  | —            | —            |
| 20 工业   | 174,543.81   | 0.15         |
| 25 可选消费 | 838,502.52   | 0.70         |
| 30 主要消费 | 113,615.02   | 0.09         |
| 35 医药卫生 | 877,986.80   | 0.73         |
| 40 金融   | 126,113.46   | 0.10         |
| 45 信息技术 | —            | —            |
| 50 通信服务 | 485,293.63   | 0.40         |
| 55 公用事业 | 100,525.98   | 0.08         |
| 60 房地产  | 64,224.06    | 0.05         |
| 合计      | 2,780,805.28 | 2.31         |

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  | 603986 | 兆易创新 | 800   | 652,000.00 | 0.54         |
| 2  | 688498 | 源杰科技 | 290   | 546,940.00 | 0.45         |
| 3  | 300308 | 中际旭创 | 400   | 508,000.00 | 0.42         |
| 4  | 00700  | 腾讯控股 | 1,300 | 485,293.63 | 0.40         |
| 5  | 688256 | 寒武纪  | 298   | 475,473.90 | 0.40         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 6  | 688981 | 中芯国际 | 2,917  | 463,277.94 | 0.39 |
| 7  | 300502 | 新易盛  | 740    | 449,180.00 | 0.37 |
| 8  | 002371 | 北方华创 | 500    | 442,280.00 | 0.37 |
| 9  | 00175  | 吉利汽车 | 27,000 | 395,381.33 | 0.33 |
| 10 | 600183 | 生益科技 | 2,200  | 381,480.00 | 0.32 |

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

#### 5.4 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      | 23,004,524.88  | 19.12        |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 91,840,945.32  | 76.34        |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,384,921.21  | 33.57        |
| 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        | 114,845,470.20 | 95.46        |

#### 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  | 260214    | 26 国开 14       | 300,000 | 30,197,241.76 | 25.10        |
| 2  | 232380017 | 23 光大二级资本债 01A | 100,000 | 10,425,246.58 | 8.67         |
| 3  | 242400004 | 24 邮储永续债 01    | 100,000 | 10,360,827.40 | 8.61         |
| 4  | 242380008 | 23 中行永续债 01    | 100,000 | 10,335,750.68 | 8.59         |
| 5  | 243668    | 25 华安 G1       | 100,000 | 10,210,466.30 | 8.49         |

#### 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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债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）  | 风险指标说明     |
|-------------------|-----------------|----------|---------------|------------|------------|
| TL2612            | 30 年期国债<br>2612 | 12       | 13,663,200.00 | 110,300.00 | -          |
| 公允价值变动总额合计（元）     |                 |          |               |            | 110,300.00 |
| 国债期货投资本期收益（元）     |                 |          |               |            | 57,760.79  |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） |                 |          |               |            | 240,876.47 |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期国债期货投资在一定程度上对冲了利率波动的风险，符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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，华安证券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安徽省分行的处罚，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，中国邮政储蓄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，国家开发银行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、中国人民银行的处罚，中国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国家外汇管理局北京市分局、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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 650,084.07   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,998,795.06 |
| 3  | 应收股利    | 23,316.84    |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | 3,076.19     |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 2,675,272.16 |

### 5.10.4 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。

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 5.10.6 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 基金中基金

### 6.1 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基金投资明细

| 序号 | 基金代码   | 基金名称         | 运作方式        | 持有份额（份）      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|--------------|-------------|--------------|--------------|--------------|------------------------|
| 1  | 510580 | 易方达中证500ETF  | 交易型开放式(ETF) | 654,062.00   | 3,091,097.01 | 2.57         | 否                      |
| 2  | 159532 | 易方达中证2000ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,713,600.00 | 3,075,912.00 | 2.56         | 否                      |
| 3  | 159361 | 易方达中证A500ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,154,500.00 | 1,581,665.00 | 1.31         | 否                      |

注：本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金，本基金管理人根据

基金合同约定并参照《证券投资基金信息披露 XBRL 模板》中“基金中基金”的要求披露本报告期投资基金的情况。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目                   | 本期费用 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费(元)      | -                                    | -                               |
| 当期交易基金产生的赎回费(元)      | -                                    | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | -                                    | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元）   | 3,475.08                             | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元）   | 1,158.28                             | -                               |
| 当期持有基金产生的应支付交易费用（元）  | 504.30                               | -                               |

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金（ETF 除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。交易本基金管理人管理的基金产生的申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的该类申购费为零，当期交易基金产生的该类赎回费仅为按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费。交易本基金管理人管理的基金产生的销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还。当期持有基金产生的应支付管理费、应支付托管费、应支付销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 东方红汇裕债券 A      | 东方红汇裕债券 C      |
|----------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 123,825,488.97 | 107,533,357.52 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 49,632.98      | 548,722.58     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 73,519,305.01  | 41,421,315.37  |

|                           |               |               |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 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               | 50,355,816.94 | 66,660,764.73 |

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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。

8.2 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。

§ 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

| 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(%) |
| 个人                                                                                                                                                  | 1              | 20260521-20260630       | 30,001,166.67 | 0.00 | 0.00 | 30,001,166.67 | 25.6384 |
| 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。 |                |                         |               |      |      |               |         |

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汇裕债券型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红汇裕债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红汇裕债券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。

## 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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2026 年 7 月 21 日