东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金
2026 年中期报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本基金于 2022 年 12 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 2022 年 12 月 5 日。

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

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 42

7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 48
7.6 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 48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 48
7.8 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贵金属投资明细 48

7.9 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 48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 48
7.12 投资组合报告附注 49
§8 基金份额持有人信息 49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49
8.2 盈利投资者数量占比 50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 50
§9 开放式基金份额变动 51
§10 重大事件揭示 51
10.1 基金份额持有人大会决议 51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51
10.4 基金投资策略的改变 51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 52
10.8 其他重大事件 55
§11 影响投资者决策的其他重要信息 56
11.1 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 56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 56
§12 备查文件目录 56
12.1 备查文件目录 56
12.2 存放地点 56
12.3 查阅方式 56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东方红优享红利混合	
基金主代码	003396	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	354,139,637.32 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方红优享红利混合 A	东方红优享红利混合 C
下属分级基金的交易代码	003396	017536
报告期末下属分级基金的份额总额	310,766,283.34 份	43,373,353.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于现金股息率高、分红稳定的优质上市公司，通过上市公司的高比例分红收益，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用定量和定性相结合的方式，通过大类资产配置、红利证券筛选，精选股息率高、分红稳定的优质公司作为本基金的主要投资对象。在中国经济增长模式转型的大背景下，红利策略为证券提供了高安全边际，同时在震荡市中具有较高的防御性。本基金重点关注具有良好盈利能力和持续成长能力的红利型股票，通过构建证券基础库、精选证券，力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海东方证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周陶	张姗
	联系电话	021-53952888	400-61-95555
	电子邮箱	service@dfham.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	400-61-95555
传真		021-63326381	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040
法定代表人		杨斌	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dfham.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司 C 类份额：上海东方证券资产管理有限公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号 C 类份额：上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	东方红优享红利混合 A	东方红优享红利混合 C
本期已实现收益	179,531,489.01	23,331,061.19
本期利润	106,616,427.49	-4,473,722.07
加权平均基金份额本期利润	0.3152	-0.1556
本期加权平均净值利润率	11.05%	-5.46%

本期基金份额净值增长率	11.52%	11.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	602,794,429.39	81,890,858.47
期末可供分配基金份额利润	1.9397	1.8880
期末基金资产净值	913,560,712.73	125,264,212.45
期末基金份额净值	2.9397	2.8880
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	193.97%	50.35%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

东方红优享红利混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	7.70%	0.91%	-8.88%	0.69%	16.58%	0.22%
过去六个月	11.52%	0.96%	-7.16%	0.73%	18.68%	0.23%
过去一年	34.38%	0.90%	-5.20%	0.62%	39.58%	0.28%
过去三年	47.79%	1.09%	5.74%	0.74%	42.05%	0.35%
过去五年	18.25%	1.10%	-1.86%	0.81%	20.11%	0.29%
过去七年	119.92%	1.18%	9.34%	0.82%	110.58	0.36%

					%	
自基金合同生效起至今	193.97%	1.19%	21.21%	0.80%	172.76%	0.39%

东方红优享红利混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	7.57%	0.91%	-8.88%	0.69%	16.45%	0.22%
过去六个月	11.24%	0.96%	-7.16%	0.73%	18.40%	0.23%
过去一年	33.70%	0.90%	-5.20%	0.62%	38.90%	0.28%
过去三年	45.63%	1.09%	5.74%	0.74%	39.89%	0.35%
自基金合同生效起至今	50.35%	1.05%	4.60%	0.72%	45.75%	0.33%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人上海东方证券资产管理有限公司成立于 2010 年 7 月 28 日，是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2010]518 号）批准，由东方证券股份有限公司出资 3 亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013 年 8 月，公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。公司管理的公募基金类型涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金、指数型基金、货币型基金、QDII 基金、FOF 基金和公募 REITs 基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周云	上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资一部总经理、基金经理	2022 年 7 月 16 日	-	17 年	上海东方证券资产管理有限公司公募权益投资一部总经理、基金经理，2015 年 09 月至今任东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2015 年 09 月至今任东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2016 年 06 月至 2018 年 08 月任东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017 年 04

					月至 2019 年 11 月任东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2018 年 01 月至 2019 年 11 月任东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2022 年 05 月至今任东方红睿轩三年持有期混合型证券投资基金（原东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、2022 年 07 月至今任东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2023 年 05 月至今任东方红智华三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2023 年 08 月至 2025 年 03 月任东方红鼎元 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2024 年 02 月至今任东方红智享三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2024 年 07 月至今任东方红创新趋势混合型证券投资基金基金经理、2024 年 07 月至今任东方红启华三年持有期混合型证券投资基金基金经理、2025 年 06 月至今任东方红核心价值混合型证券投资基金基金经理。清华大学生物学博士。曾任东方证券资产管理业务总部研究员，上海东方证券资产管理有限公司行业研究员、投资主办人。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。

4.1.3 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年全球市场呈现“科技领涨、结构极致分化”的鲜明特征。A 股在 AI 算力与半导体产业趋势驱动下走出结构性牛市，成长风格全面压制价值与消费。特别是 4 月以来，全球半导体龙头公司相继发布了超预期的财报，直接点燃了市场的做多情绪，AI 相关的 Capex 持续超预期，导致了部分瓶颈环节出现了涨价潮，进一步拉高了市场情绪。上半年 A 股的主要宽基指数均有所上涨，但是分化严重，其中半导体含量最高的科创 50 指数表现最为抢眼，上涨 64.2%，创业板指上涨 35.6%，沪深 300 指数上涨 7.55%，上证指数上涨 3.16%。行业指数的分化更为显著，31 个申万一级行业中，电子和通信领涨，只有 4 个行业是上涨幅度超过 10%，而 10 个行业的跌幅超过了 15%。本基金配置相对均衡，在上半年化工和科技行情表现极致的时候，根据个股的估值情况进行了适当的再平衡。

4.4.2 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 2.9397 元，份额累计净值为 2.9397 元;C 类份额净值为 2.8880 元，份额累计净值为 2.8880 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 11.52%，同期业绩比较基准收益率为-7.16%;C 类份额净值增长率为 11.24%,同期业绩比较基准收益率为-7.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回头看，过去几年美国 AI 资本开支几乎是全球需求端唯一大幅向上的 beta，不但拉动了美国经济，也拉动了中国经济。但是 K 型分化严重，和 AI 相关的行业在通胀，和 AI 无关的行业景气偏弱。AI 本身可能没有泡沫，但部分 AI 相关的股票泡沫严重，主要表现在技术壁垒没有那么高的话很难长期维持高盈利。所以关注与 AI Capex 相关的新技术、新环节的公司是一个比较好

的选择。另外，我们相信尽管 AI 对软件行业的颠覆不可避免，但这并不妨碍 AI 应用的下半场会异彩纷呈，尤其关注有独特数据和场景的公司。在 AI 以外，有很多公司都进入了可投资的区间，包括部分传统制造业、大众消费品企业、周期性行业等等，尽管这些公司与当前的 AI 叙事格格不入，我们也很难预测市场先生的偏好何时会改变，但拉长时间来看的话，大概率还是有机会获得不错的回报。我会积极地根据估值、基本面的变化，结合短、中、长期的判断对组合进行调整，争取为持有人创造可持续的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营部是估值委员会的日常办事机构。本基金管理人估值委员和估值人员均具有专业胜任能力和相关工作经历。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，

并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	269,769,251.21	210,606,010.28
结算备付金		2,208,743.27	1,475,200.63
存出保证金		114,197.99	135,152.03
交易性金融资产	6.4.7.2	772,631,562.03	799,189,546.70
其中：股票投资		772,631,562.03	799,189,546.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	50,890,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		831,571.19	1,224,602.01
应收股利		736,856.30	-
应收申购款		235,483.97	541,215.68
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,046,527,665.96	1,064,061,727.33
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		512,106.00	39,658,071.58
应付赎回款		5,403,690.36	5,305,487.74
应付管理人报酬		1,123,280.98	1,067,478.53
应付托管费		187,213.51	177,913.10
应付销售服务费		87,421.65	18,778.16
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	389,028.28	243,124.40
负债合计		7,702,740.78	46,470,853.51
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	354,139,637.32	386,252,605.67
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	684,685,287.86	631,338,268.15
净资产合计		1,038,824,925.18	1,017,590,873.82
负债和净资产总计		1,046,527,665.96	1,064,061,727.33

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 354,139,637.32 份，其中东方红优享红利混合 A 基金份额总额 310,766,283.34 份，基金份额净值 2.9397 元；东方红优享红利混合 C 基金份额总额 43,373,353.98 份，基金份额净值 2.8880 元。

6.2 利润表

会计主体：东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		109,678,959.88	27,084,471.36
1.利息收入		450,728.12	294,025.06
其中：存款利息收入	6.4.7.13	447,865.04	294,025.06
债券利息收入		-	-
资产支持证券利		-	-

息收入			
买入返售金融资产收入		2,863.08	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		208,703,766.27	52,550,109.06
其中：股票投资收益	6.4.7.14	200,450,685.96	43,743,400.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	840,745.07	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	7,412,335.24	8,806,708.40
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-100,719,844.78	-25,792,697.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,244,310.27	33,034.48
减：二、营业总支出		7,536,254.46	7,943,925.48
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	6,203,021.14	6,697,622.45
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	1,033,836.87	1,116,270.39
3．销售服务费	6.4.10.2.3	190,973.12	23,820.53
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		1.01	-
8．其他费用	6.4.7.23	108,422.32	106,212.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		102,142,705.42	19,140,545.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		102,142,705.42	19,140,545.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		102,142,705.42	19,140,545.88

6.3 净资产变动表

会计主体：东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	386,252,605.67	631,338,268.15	1,017,590,873.82
二、本期期初净资产	386,252,605.67	631,338,268.15	1,017,590,873.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-32,112,968.35	53,347,019.71	21,234,051.36
（一）、综合收益总额	-	102,142,705.42	102,142,705.42
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-32,112,968.35	-48,795,685.71	-80,908,654.06
其中：1.基金申购款	139,939,793.04	264,610,928.38	404,550,721.42
2.基金赎回款	-172,052,761.39	-313,406,614.09	-485,459,375.48
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	354,139,637.32	684,685,287.86	1,038,824,925.18
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	541,837,899.80	622,500,662.69	1,164,338,562.49
二、本期期初净资产	541,837,899.80	622,500,662.69	1,164,338,562.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-39,116,987.41	-25,645,257.31	-64,762,244.72
（一）、综合收益总额	-	19,140,545.88	19,140,545.88

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-39,116,987.41	-44,785,803.19	-83,902,790.60
其中：1.基金申购款	24,809,893.45	29,548,496.45	54,358,389.90
2.基金赎回款	-63,926,880.86	-74,334,299.64	-138,261,180.50
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	502,720,912.39	596,855,405.38	1,099,576,317.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

成飞	汤琳	陈培
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1258 号《关于准予东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 989,089,780.91 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第 1379 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 10 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 989,179,597.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 89,816.19 份基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司于 2022 年 12 月 2 日发布的《关于上海东方证券资产管理有限公司旗下 5 只基金增加 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公

告》，自 2022 年 12 月 5 日起，本基金增设 C 类基金份额。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，且不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票及存托凭证（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中股票资产（含存托凭证）投资比例为基金资产的 0-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票、存托凭证的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%）；本基金投资于红利型证券不低于非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证红利指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中国债券总指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30

日的财务状况、自 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2014] 81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中

华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入， 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c)对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12

月 31 日。

d)本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	269,769,251.21
等于：本金	269,742,863.40
加：应计利息	26,387.81
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	269,769,251.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		829,493,540.26	-	772,631,562.03	-56,861,978.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		829,493,540.26	-	772,631,562.03	-56,861,978.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,347.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	295,400.40
其中：交易所市场	295,400.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	91,280.45
合计	389,028.28

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	372,061,334.80	372,061,334.80
本期申购	20,315,775.01	20,315,775.01
本期赎回（以“-”号填列）	-81,610,826.47	-81,610,826.47
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	310,766,283.34	310,766,283.34

东方红优享红利混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,191,270.87	14,191,270.87
本期申购	119,624,018.03	119,624,018.03
本期赎回（以“-”号填列）	-90,441,934.92	-90,441,934.92
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	43,373,353.98	43,373,353.98

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

东方红优享红利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	641,539,663.30	-32,852,570.56	608,687,092.74
本期期初	641,539,663.30	-32,852,570.56	608,687,092.74
本期利润	179,531,489.01	-72,915,061.52	106,616,427.49
本期基金份额交易产生的变动数	-117,697,852.19	5,188,761.35	-112,509,090.84
其中：基金申购款	39,183,028.26	-1,120,748.96	38,062,279.30
基金赎回款	-156,880,880.45	6,309,510.31	-150,571,370.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	703,373,300.12	-100,578,870.73	602,794,429.39

东方红优享红利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	23,921,529.74	-1,270,354.33	22,651,175.41
本期期初	23,921,529.74	-1,270,354.33	22,651,175.41
本期利润	23,331,061.19	-27,804,783.26	-4,473,722.07
本期基金份额交易产生的变动数	48,549,691.05	15,163,714.08	63,713,405.13
其中：基金申购款	239,840,138.31	-13,291,489.23	226,548,649.08
基金赎回款	-191,290,447.26	28,455,203.31	-162,835,243.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	95,802,281.98	-13,911,423.51	81,890,858.47

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	442,204.96
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,655.54
其他	1,004.54
合计	447,865.04

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	200,450,685.96
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	200,450,685.96

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	572,773,995.00
减：卖出股票成本总额	371,446,631.46
减：交易费用	876,677.58
买卖股票差价收入	200,450,685.96

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	206.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	840,538.59
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	840,745.07

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,054,833.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,214,000.00
减：应计利息总额	212.87
减：交易费用	82.32
买卖债券差价收入	840,538.59

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,412,335.24
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,412,335.24

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-100,719,844.78
股票投资	-100,719,844.78
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-100,719,844.78

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,240,726.17
基金转换费收入	3,584.10
合计	1,244,310.27

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
证券组合费	5,453.91
银行费用	2,687.96
账户维护费	13,500.00
合计	108,422.32

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海东方证券资产管理有限公司(“东证资管”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海东证期货有限公司（“东证期货”）	受东方证券控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	29,211,678.72	2.87	155,070,067.63	24.58

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	12,731.84	2.84	11,654.37	3.95
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	69,161.77	23.98	2,082.63	1.85

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,203,021.14	6,697,622.45
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,641,192.29	2,992,683.63
应支付基金管理人的净管理费	3,561,828.85	3,704,938.82

注：（1）本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

(2)实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,033,836.87	1,116,270.39

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红优享红利混合 A	东方红优享红利混合 C	合计
东方证券	-	27.86	27.86

东证资管	-	1,891.68	1,891.68
招商银行	-	123,159.04	123,159.04
合计	-	125,078.58	125,078.58

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红优享红利混合 A	东方红优享红利混合 C	合计
东方证券	-	7.08	7.08
东证资管	-	187.33	187.33
招商银行	-	13,762.05	13,762.05
合计	-	13,956.46	13,956.46

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X0.50%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	东方红优享红利混合 A	东方红优享红利混合 C
基金合同生效日（ 2016 年 10 月 31 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	5,975,617.04	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,975,617.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.9229%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	东方红优享红利混合 A	东方红优享红利混合 C
基金合同生效日（ 2016 年 10 月 31 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,975,617.04	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,975,617.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.2042%	-

注：1、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

2、分类基金持有的基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	269,769,251.21	442,204.96	176,623,067.78	275,532.83

注：本基金的上述银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按协议利率计息，存出保证金不计息。于 2026 年 06 月 30 日，本基金存放于东证期货的结算备付金余额（不含应计利息）为 855,761.16 元，存出保证金余额为 0 元(2025 年 12 月 31 日：结算备付金余额 853,121.94 元，存出保证金余额 0 元)。于报告期内，本基金存放于东证期货的结算备付金利息收入为 2,625.18 元(2025 年同期：2,958.70 元)。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	13,153	132,976.83	132,976.83	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	30,693	310,306.23	310,306.23	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001365	天海	2026 年 5	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-

	电子	月 11 日								
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	5,573	56,398.76	154,539.29	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股锁定	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰	2026 年 4	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

	克	月 9 日								
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	1,291	25,406.88	182,663.59	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责对合规管理和风险管理的总体目标、基本政策进行审议并提出意见；对合规管理和风险管理的机构设置及其职责进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见等。在经营层层面设立全面风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；根据董事会制定的风险管理原则制订相关风险控制政策，使公司整体业务发展战略与风险承受能力保持相当；督促各职能部门在日常工作中识别各项业务所涉及的各类重大风险，组织对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，就相关解决方案进行评审；督促各职能部门识别和评估新产品、新业务的风险，就相关控制措施进行评审；督促各职能部门重点关注内控机制薄弱环节和可能给公司带来重大损失的事件，审议并决定相应的控制措施和解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，指导实施风险应对方案；审议公司投资授权有关的风险控制方案等。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均

以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放日内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	269,769,251.21	-	-	-	-	-	269,769,251.21
结算备付金	2,208,743.27	-	-	-	-	-	2,208,743.27
存出保证金	114,197.99	-	-	-	-	-	114,197.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	772,631,562.03	772,631,562.03
应收股利	-	-	-	-	-	736,856.30	736,856.30

应收申购款	6,804.70	-	-	-	-	228,679.27	235,483.97
应收清算款	-	-	-	-	-	831,571.19	831,571.19
资产总计	272,098,997.17	-	-	-	-	774,428,668.79	1,046,527,665.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,403,690.36	5,403,690.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,123,280.98	1,123,280.98
应付托管费	-	-	-	-	-	187,213.51	187,213.51
应付清算款	-	-	-	-	-	512,106.00	512,106.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	87,421.65	87,421.65
其他负债	-	-	-	-	-	389,028.28	389,028.28
负债总计	-	-	-	-	-	7,702,740.78	7,702,740.78
利率敏感度缺口	272,098,997.17	-	-	-	-	766,725,928.01	1,038,824,925.18
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	210,606,010.28	-	-	-	-	-	210,606,010.28
结算备付金	1,475,200.63	-	-	-	-	-	1,475,200.63
存出保证金	135,152.03	-	-	-	-	-	135,152.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	799,189,546.70	799,189,546.70
买入返售金融资产	50,890,000.00	-	-	-	-	-	50,890,000.00
应收申购款	51.08	-	-	-	-	541,164.60	541,215.68
应收清算款	-	-	-	-	-	1,224,602.01	1,224,602.01
资产总计	263,106,414.02	-	-	-	-	800,955,313.31	1,064,061,727.33
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,305,487.74	5,305,487.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,067,478.53	1,067,478.53
应付托管费	-	-	-	-	-	177,913.10	177,913.10
应付清算款	-	-	-	-	-	39,658,071.58	39,658,071.58
应付销售服务	-	-	-	-	-	18,778.16	18,778.16

费							
其他负债	-	-	-	-	-	243,124.40	243,124.40
负债总计	-	-	-	-	-	46,470,853.51	46,470,853.51
利率敏感度缺口	263,106,414.02	-	-	-	-	754,484,459.80	1,017,590,873.82

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	114,534,399.80	-	114,534,399.80
资产合计	-	114,534,399.80	-	114,534,399.80
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	114,534,399.80	-	114,534,399.80
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	143,441,276.90	-	143,441,276.90
资产合计	-	143,441,276.90	-	143,441,276.90
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	143,441,276.90	-	143,441,276.90

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	1、港币相对人民币升值 5%	5,726,719.99	7,172,063.85
	2、港币相对人民币贬值 5%	-5,726,719.99	-7,172,063.85

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行其他价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	772,631,562.03	74.38	799,189,546.70	78.54
交易性金融资	-	-	-	-

产－基金投资				
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	772,631,562.03	74.38	799,189,546.70	78.54

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	1.沪深 300 指数上升 5%	34,746,170.60	36,119,627.01
	2.沪深 300 指数下降 5%	-34,746,170.60	-36,119,627.01

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深 300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

第一层次	770,483,111.89	797,522,656.72
第二层次	443,283.06	-
第三层次	1,705,167.08	1,666,889.98
合计	772,631,562.03	799,189,546.70

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	772,631,562.03	73.83
	其中：股票	772,631,562.03	73.83
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	271,977,994.48	25.99
8	其他各项资产	1,918,109.45	0.18
9	合计	1,046,527,665.96	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 114,534,399.80 元人民币，占期末基金资产净值比例 11.03%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	3,903,939.00	0.38
B	采矿业	13,237,301.82	1.27
C	制造业	471,989,806.19	45.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,468,413.06	1.30
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,614,886.00	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	29,662,808.46	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,888,878.58	7.79
J	金融业	5,435,596.00	0.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,698,971.20	0.55
M	科学研究和技术服务业	1,447,053.92	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	16,634,520.00	1.60
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	114,988.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	658,097,162.23	63.35

7.2.2 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	7,285.00	0.00
20 工业	53,730,325.00	5.17
25 可选消费	37,948,116.00	3.65
30 主要消费	3,251,640.00	0.31

35 医药卫生	2,250,692.00	0.22
40 金融	-	-
45 信息技术	963,000.00	0.09
50 通信服务	16,383,341.80	1.58
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	114,534,399.80	11.03

注：以上分类采用中证行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	600585	海螺水泥	2,474,700	41,946,165.00	4.04
1	00914	海螺水泥	500	7,285.00	0.00
2	02057	中通快递-W	261,750	39,011,220.00	3.76
3	002475	立讯精密	550,200	38,734,080.00	3.73
4	601333	广深铁路	10,785,900	29,661,225.00	2.86
4	00525	广深铁路股份	4,252,000	7,568,560.00	0.73
5	600460	士兰微	669,400	36,589,404.00	3.52
6	601012	隆基绿能	2,765,500	36,283,360.00	3.49
7	688798	艾为电子	461,334	33,825,008.88	3.26
8	09988	阿里巴巴-W	362,100	29,199,744.00	2.81
9	002415	海康威视	735,800	25,164,360.00	2.42
10	002011	盾安环境	1,894,700	20,102,767.00	1.94
11	603997	继峰股份	1,676,700	19,835,361.00	1.91
12	300566	激智科技	500,000	18,475,000.00	1.78
13	688484	南芯科技	320,852	18,124,929.48	1.74
14	002841	视源股份	511,200	17,651,736.00	1.70
15	000035	中国天楹	3,444,000	16,634,520.00	1.60
16	600998	九州通	3,329,400	15,614,886.00	1.50
17	000725	京东方 A	1,789,100	15,529,388.00	1.49
18	600150	中国船舶	397,041	13,416,015.39	1.29
19	00700	腾讯控股	35,700	13,326,810.00	1.28
20	002705	新宝股份	1,187,576	13,158,342.08	1.27
21	601619	嘉泽新能	3,029,100	13,025,130.00	1.25
22	300083	创世纪	920,400	12,535,848.00	1.21
23	688396	华润微	119,894	11,695,659.70	1.13
24	002609	捷顺科技	1,532,100	11,674,602.00	1.12
25	603338	浙江鼎力	272,400	11,577,000.00	1.11
26	002833	弘亚数控	579,200	11,172,768.00	1.08
27	600966	博汇纸业	2,316,100	11,070,958.00	1.07
28	688099	晶晨股份	103,569	10,657,250.10	1.03

29	301039	中集车辆	1,484,500	10,465,725.00	1.01
30	300494	盛天网络	1,191,500	10,044,345.00	0.97
31	600570	恒生电子	468,600	9,929,634.00	0.96
32	02015	理想汽车-W	218,600	8,748,372.00	0.84
33	600782	新钢股份	3,170,500	7,862,840.00	0.76
34	300413	芒果超媒	514,600	7,528,598.00	0.72
35	300383	光环新网	602,400	7,493,856.00	0.72
36	600547	山东黄金	318,200	7,347,238.00	0.71
37	688677	海泰新光	71,466	7,227,356.58	0.70
38	300911	亿田智能	276,600	5,877,750.00	0.57
39	600583	海油工程	1,163,800	5,853,914.00	0.56
40	03899	中集安瑞科	918,000	5,728,320.00	0.55
41	601636	旗滨集团	556,300	5,690,949.00	0.55
42	000938	紫光股份	197,000	5,685,420.00	0.55
43	300525	博思软件	730,600	5,435,664.00	0.52
44	601878	浙商证券	491,100	4,665,450.00	0.45
45	300791	仙乐健康	284,100	4,551,282.00	0.44
46	603298	杭叉集团	189,200	4,514,312.00	0.43
47	603218	日月股份	414,200	4,233,124.00	0.41
48	688036	传音控股	68,410	4,032,769.50	0.39
49	603339	四方科技	280,400	4,006,916.00	0.39
50	300761	立华股份	237,900	3,903,939.00	0.38
51	01579	颐海国际	294,000	3,251,640.00	0.31
52	300161	华中数控	101,400	2,952,768.00	0.28
53	688320	禾川科技	68,056	2,820,921.20	0.27
54	00772	阅文集团	166,400	2,733,952.00	0.26
55	300226	上海钢联	168,120	2,573,917.20	0.25
56	300662	科锐国际	147,900	2,511,342.00	0.24
57	603915	国茂股份	165,100	2,342,769.00	0.23
58	600166	福田汽车	679,800	1,978,218.00	0.19
59	301459	丰茂股份	51,380	1,589,697.20	0.15
60	603018	华设集团	281,528	1,447,053.92	0.14
61	00586	海螺创业	150,500	1,422,225.00	0.14
62	002959	小熊电器	44,200	1,402,024.00	0.13
63	01789	爱康医疗	280,000	1,248,800.00	0.12
64	002092	中泰化学	281,800	1,079,294.00	0.10
65	06699	时代天使	17,400	1,001,892.00	0.10
66	603025	大豪科技	71,800	979,352.00	0.09
67	03888	金山软件	50,000	963,000.00	0.09
68	603712	七一二	64,400	830,116.00	0.08
69	300059	东方财富	37,700	768,326.00	0.07
70	002027	分众传媒	126,800	613,712.00	0.06
71	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05

72	600416	湘电股份	56,500	553,700.00	0.05
73	001248	华润新能源	43,846	443,283.06	0.04
74	300653	正海生物	25,800	370,488.00	0.04
75	09626	哔哩哔哩-W	2,820	322,579.80	0.03
76	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
77	688108	赛诺医疗	12,028	222,878.84	0.02
78	688820	盛合晶微	1,291	182,663.59	0.02
79	001399	惠科股份	5,573	154,539.29	0.01
80	300796	贝斯美	23,000	144,670.00	0.01
81	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
82	600977	中国电影	8,900	114,988.00	0.01
83	000039	中集集团	13,800	111,918.00	0.01
84	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
85	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
86	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
87	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
88	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
89	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
90	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
91	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
92	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
93	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
94	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
95	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
96	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
97	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
98	603355	莱克电气	500	13,190.00	0.00
99	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
100	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
101	601026	道生天合	451	6,575.58	0.00
102	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
103	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
104	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
105	601211	国泰海通	100	1,820.00	0.00
106	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
107	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)

1	09988	阿里巴巴-W	37,978,690.32	3.73
2	600460	士兰微	25,710,273.00	2.53
3	600999	招商证券	24,078,947.60	2.37
4	688798	艾为电子	22,055,339.05	2.17
5	002475	立讯精密	21,852,148.00	2.15
6	000725	京东方 A	19,344,231.00	1.90
7	603338	浙江鼎力	14,882,276.00	1.46
8	688484	南芯科技	14,616,631.08	1.44
9	601012	隆基绿能	14,488,671.08	1.42
10	600570	恒生电子	13,976,417.80	1.37
11	600966	博汇纸业	13,520,701.00	1.33
12	301039	中集车辆	11,918,805.00	1.17
13	600998	九州通	11,607,699.84	1.14
14	600782	新钢股份	10,393,450.00	1.02
15	600585	海螺水泥	10,082,078.00	0.99
16	300566	激智科技	10,074,696.00	0.99
17	688099	晶晨股份	9,981,982.60	0.98
18	300083	创世纪	9,776,900.00	0.96
19	002415	海康威视	9,487,627.00	0.93
20	300911	亿田智能	9,143,370.00	0.90

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	605376	博迁新材	85,465,808.58	8.40
2	688677	海泰新光	75,595,911.23	7.43
3	000725	京东方 A	37,453,318.89	3.68
4	02057	中通快递-W	35,654,578.48	3.50
5	600999	招商证券	30,437,051.10	2.99
6	300037	新宙邦	29,824,995.03	2.93
7	600893	航发动力	21,610,907.00	2.12
8	002897	意华股份	20,406,370.80	2.01
9	601866	中远海发	19,811,910.00	1.95
10	300776	帝尔激光	14,010,489.24	1.38
11	600163	中闽能源	13,236,535.00	1.30
12	600820	隧道股份	12,588,801.00	1.24
13	603688	石英股份	9,304,758.00	0.91
14	002705	新宝股份	9,299,915.00	0.91
15	03899	中集安瑞科	8,921,263.70	0.88
16	600352	浙江龙盛	8,252,953.00	0.81
17	600426	华鲁恒升	8,239,926.00	0.81
18	301327	华宝新能	8,107,628.46	0.80

19	603888	新华网	7,749,518.20	0.76
20	002092	中泰化学	7,690,787.00	0.76

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	445,608,491.57
卖出股票收入（成交）总额	572,773,995.00

注:“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场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。

7.12.2 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约定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	114,197.99
2	应收清算款	831,571.19
3	应收股利	736,856.30
4	应收利息	-
5	应收申购款	235,483.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,918,109.45

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
东方红优享红利混合 A	14,625	21,248.98	12,693,274.25	4.08	298,073,009.09	95.92
东方红优享红利混合 C	7,673	5,652.72	35,719,169.39	82.35	7,654,184.59	17.65
合计	22,298	15,882.13	48,412,443.64	13.67	305,727,193.68	86.33

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	95.01

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	东方红优享红利混合 A	644,588.92	0.21
	东方红优享红利混合 C	297,994.36	0.69
	合计	942,583.28	0.27

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东方红优享红利混合 A	10~50
	东方红优享红利混合 C	0~10
	合计	10~50

本基金基金经理持有本开放式基金	东方红优享红利混合 A	10~50
	东方红优享红利混合 C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红优享红利混合 A	东方红优享红利混合 C
基金合同生效日（2016 年 10 月 31 日）基金份额总额	989,179,597.10	-
本报告期期初基金份额总额	372,061,334.80	14,191,270.87
本报告期基金总申购份额	20,315,775.01	119,624,018.03
减：本报告期基金总赎回份额	81,610,826.47	90,441,934.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	310,766,283.34	43,373,353.98

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未发生基金份额持有人大会决议事项。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人基金投资业务、基金财产的重大诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期

内本基金未发生改聘会计师事务所的情形。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
摩根大通证券	2	258,987,449.46	25.49	116,906.78	26.03	-
国金证券	2	105,062,300.43	10.34	45,796.97	10.20	-
野村东方国际证券	2	92,544,309.06	9.11	41,027.15	9.14	-
华创证券	2	88,573,267.90	8.72	38,607.06	8.60	-
东方财富证券	2	84,354,788.57	8.30	37,257.81	8.30	-
国联民生	3	81,263,636.32	8.00	35,532.09	7.91	-
国盛证券	2	70,808,763.92	6.97	30,866.42	6.87	-
中金公司	2	66,100,985.06	6.51	28,815.59	6.42	-
兴业证券	2	61,670,867.46	6.07	26,885.24	5.99	-
东方证券	5	29,211,678.72	2.87	12,731.84	2.84	-
招商证券	1	24,278,862.7	2.39	10,583.24	2.36	-

		9				
中信建投证券	1	17,910,674.27	1.76	8,015.75	1.78	-
广发证券	2	10,006,196.34	0.98	4,361.79	0.97	-
华泰证券	1	9,608,722.61	0.95	4,586.71	1.02	-
长江证券	2	7,929,061.03	0.78	3,456.67	0.77	-
国泰海通	3	4,213,693.04	0.41	1,836.75	0.41	-
申万宏源	1	3,599,937.30	0.35	1,799.92	0.40	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛中国证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

（1）选择标准

证券公司财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的合规风控能力和交易服务能力；针对除被动股票型基金外的其余基金将研究服务能力纳入考量。

（2）选择程序

基金管理人根据以上标准对不同证券公司进行综合评价和选择，与其签订交易单元租用协议。

2、本基金租用的证券公司交易单元变更情况：减少国泰海通交易单元 2 个。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)

摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2,054,833.78	62.86	-	-	-	-
华创证券	1,214,000.00	37.14	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛中国证券	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-

券						
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 13 日
2	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 13 日
3	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 13 日
4	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
5	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 30 日
6	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
7	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日

	日申购、赎回等业务安排更新的公告		
8	东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
9	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排更新的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 5 月 21 日
10	上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日申购、赎回等业务安排更新的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 29 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予注册东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金的文件；

2、《东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《东方红优享红利沪港深灵活配置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。

12.2 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。

12.3 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 8 月 31 日