东方红景瑞精选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。

本报告期自 2026 年 01 月 27 日（基金合同生效日）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 10
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 10
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 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
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 11

§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 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 46

7.1 期末基金资产组合情况 46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 46
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 47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 51
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 51
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 51
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 51

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 51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51
7.12 本报告期投资基金情况 52
7.13 投资组合报告附注 53
§8 基金份额持有人信息 54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 54
8.3 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 55
§9 开放式基金份额变动 55
§10 重大事件揭示 55
10.1 基金份额持有人大会决议 55
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 55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
10.4 基金投资策略的改变 56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 56
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 56
10.8 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 56
10.9 其他重大事件 62
§11 影响投资者决策的其他重要信息 62
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 62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 62
§12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 63
12.3 查阅方式 63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红景瑞精选混合型证券投资基金	
基金简称	东方红景瑞精选混合	
基金主代码	022570	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 27 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	1,197,608,615.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方红景瑞精选混合 A	东方红景瑞精选混合 C
下属分级基金的交易代码	022570	022571
报告期末下属分级基金的份额总额	924,960,234.01 份	272,648,381.27 份

2.2 基金产品说明

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	本基金在资产配置方面，通过严谨的大类资产配置，使得股票、基金部分的行业暴露在宏观因子上和债券形成一定对冲，降低组合整体波动率；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；在股票和转债之间，优先选择估值性价比更优的品种进行配置；在个股选择方面，注重估值的安全边际和持仓比例的相对分散；在日常运作方面，密切关注宏观变量及组合运行状态的变化情况，并适时对组合进行优化调整，力争在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略努力实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×5%
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和货币市场基金，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	中国证券报
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	上海东方证券资产管理有限公司	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	2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	东方红景瑞精选混合 A	东方红景瑞精选混合 C
本期已实现收益	4,387,692.03	993,836.76
本期利润	-27,187,238.29	-9,271,395.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0260	-0.0260
本期加权平均净值利润率	-2.62%	-2.63%

本期基金份额净值增长率	-2.69%	-2.83%
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	-24,872,970.19	-7,724,169.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0269	-0.0283
期末基金资产净值	900,087,263.82	264,924,211.82
期末基金份额净值	0.9731	0.9717
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	-2.69%	-2.83%

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）。

4、本基金合同于 2026 年 01 月 27 日生效，自合同生效日起至本报告期末不满半年。

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

东方红景瑞精选混合 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	-1.30%	0.21%	1.79%	0.23%	-3.09%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-2.69%	0.20%	0.57%	0.23%	-3.26%	-0.03%

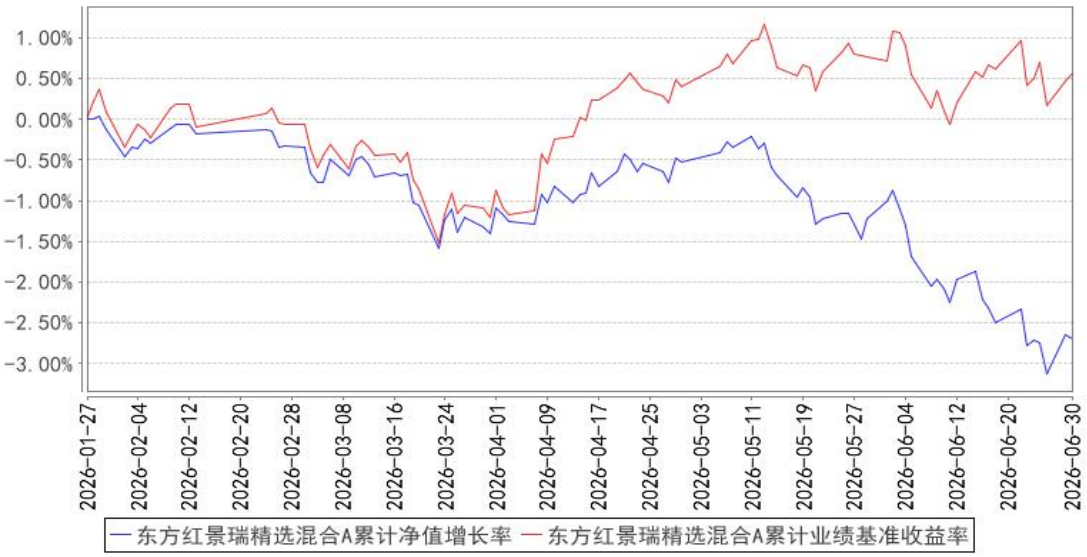
东方红景瑞精选混合 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④

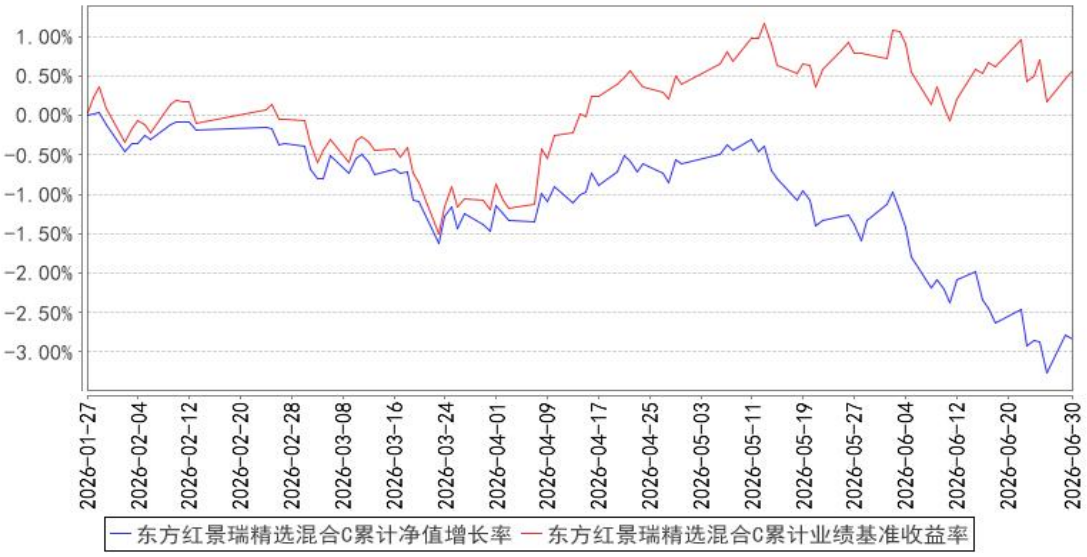
	率①	准差②		④		
过去三个月	-1.38%	0.21%	1.79%	0.23%	-3.17%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-2.83%	0.20%	0.57%	0.23%	-3.40%	-0.03%

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

东方红景瑞精选混合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



东方红景瑞精选混合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 2026 年 01 月 27 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 2026 年 01 月 27 日起至 2026 年 07 月 26 日，至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§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		
孔令超	上海东方证券资产管理有限公司混合资产投资部总经理、基金经理	2026 年 1 月 27 日	-	14 年	上海东方证券资产管理有限公司混合资产投资部总经理、基金经理，2016 年 08 月至今任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2016 年 08 月至今任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2018 年 03 月至 2024 年 01 月任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 05 月至今任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018 年 06 月至 2024 年 04 月任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 06 月至今任东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、2018 年 07 月至今任东方红稳健精选混合型证券投资基金基金经理、2019 年 09 月至今任东方红聚利债券型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至 2021 年 12 月任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2024 年 03 月至今任东方红收益增强

					债券型证券投资基金基金经理、2026 年 01 月至今任东方红景瑞精选混合型证券投资基金基金经理。北京大学金融学硕士。曾任平安证券有限责任公司总部综合研究所策略研究员，国信证券股份有限公司经济研究所策略研究研究员，上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究部总经理。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。

4.1.3 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

上半年上证指数上涨 3.16%，但行业之间表现分化较大，与 AI 硬件相关的行业大幅上涨，而

大部分行业表现不佳。本产品的权益部分行业较为分散，上半年除部分公司受益于 AI 的拉动以外，其他多数公司的表现均对组合产生了一定的阶段性拖累。债券方面，上半年债券市场波动较小，本产品债券部分整体持仓变化不大。

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 0.9731 元，份额累计净值为 0.9731 元;C 类份额净值为 0.9717 元，份额累计净值为 0.9717 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为-2.69%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%;C 类份额净值增长率为-2.83%，同期业绩比较基准收益率为 0.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，本产品看好权益市场的投资机会。目前权益市场仍然具备大量有投资价值的资产。本产品与 AI 相关的持仓仍然集中于存在一些壁垒的龙头公司，以及应用层面的一些公司，而一些短期紧缺的制造环节持仓较少。另外，消费、制造、周期、公用事业等多个领域中，很多具备竞争优势的公司在今年出现了较大幅度的下跌，目前这些公司的估值水平隐含了非常悲观的盈利预测，其中一些未来盈利预期相对稳定的资产，具备较好的配置价值。虽然上半年多数行业表现不佳，但本产品仍将坚持一贯的分散策略，构建一个多元化的组合。债券方面，目前收益率水平相对较低，本产品以中短久期债券为主。

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：东方红景瑞精选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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	8,994,451.32
结算备付金		1,849,153.69
存出保证金		95,974.55
交易性金融资产	6.4.7.2	1,334,721,278.79
其中：股票投资		258,720,389.46
基金投资		1,620.00
债券投资		1,075,999,269.33
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	-
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		12,765,913.84
应收股利		606,955.40
应收申购款		7,065.82
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		1,359,040,793.41
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 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		177,500,000.00
应付清算款		-
应付赎回款		15,485,725.67
应付管理人报酬		613,062.75
应付托管费		153,265.67
应付销售服务费		84,056.63
应付投资顾问费		-
应交税费		34,307.25
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	158,899.80
负债合计		194,029,317.77
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	1,197,608,615.28
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-32,597,139.64
净资产合计		1,165,011,475.64
负债和净资产总计		1,359,040,793.41

注：1.报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,197,608,615.28 份，其中东方红景瑞精选混合 A 基金份额总额 924,960,234.01 份，基金份额净值 0.9731 元；东方红景瑞精选混合 C 基金份额总额 272,648,381.27 份，基金份额净值 0.9717 元。

2.本财务报表的实际编制期间为 2026 年 01 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日止期

间，无上年度可比数据。

6.2 利润表

会计主体：东方红景瑞精选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-31,284,705.60
1.利息收入		695,842.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	75,471.14
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		620,371.13
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,483,900.22
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,970,222.99
基金投资收益	6.4.7.15	-0.07
债券投资收益	6.4.7.16	8,222,837.39
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	3,231,285.89
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）	6.4.7.21	-41,840,162.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	375,714.32
减：二、营业总支出		5,173,928.02
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,523,959.60
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	880,989.88
3．销售服务费	6.4.10.2.3	522,777.00
4．投资顾问费		-
5．利息支出		134,195.05
其中：卖出回购金融资产支出		134,195.05
6．信用减值损失	6.4.7.24	-
7．税金及附加		14,880.72
8．其他费用	6.4.7.25	97,125.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号		-36,458,633.62

填列）		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-36,458,633.62
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-36,458,633.62

6.3 净资产变动表

会计主体：东方红景瑞精选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	1,455,567,783.05	-	1,455,567,783.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-257,959,167.77	-32,597,139.64	-290,556,307.41
（一）、综合收益总额	-	-36,458,633.62	-36,458,633.62
（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）	-257,959,167.77	3,861,493.98	-254,097,673.79
其中：1.基金申购款	2,849,965.15	-55,063.21	2,794,901.94
2. 基金赎回款	-260,809,132.92	3,916,557.19	-256,892,575.73
（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	1,197,608,615.28	-32,597,139.64	1,165,011,475.64

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

东方红景瑞精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《东方红景瑞精选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2025]1651 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 1,455,567,783.05 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(26)第 00032 号验资报告。基金合同于 2026 年 1 月 27 日正式生效。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《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《东方红景瑞精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国家债券、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债券、公开发行的次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券(含证券公司公开发行的短期公司债券)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债)、经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金(仅包括全市场的股票型 ETF、基金管理人旗下的股票型基金以及计入权益类资产的混合型基金)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品以及经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相关规定)。本基金可根据法律法规和基金合同的约定，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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于权益类资产、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债的比例占基金资产的 10%-30%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%，投资于可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%；投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不超过基金资产净值的 10%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权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的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。其中，权益类资产包括股票、存托凭证、港股通标的股票、股票型基金，以及满足下述条件之一的混合型基金(下同)：1、基金合同约定股票资产(含存托凭证)投资比例不低于基金资产的 60%；2、最近四个季度定期报告披露的股票资产(含存托凭证)投资比例均不低于基金资产的 60%。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率(经汇率估值调整)×5%。

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

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 27 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2)金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始

确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同

资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2)投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的金额确认，逐日确认债券利息并计入投资收益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息并计入投资收益。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息并记入投资收益。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券投资收益。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除权(息)日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(3)公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4)信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金分红自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取销售服务费情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布<基金中基金估值业务指引(试行)>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

(2)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未

上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6 号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(3)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(4)根据中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日上海交易所《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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[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[2016]36 号《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]127 号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140 号《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《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继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[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]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》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 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，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的资管产品运营业务，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2)2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税。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；对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(4)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。对基金通过港股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。基金通

过港股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。

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、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。

(6)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	8,994,451.32
等于：本金	8,993,667.97
加：应计利息	783.35
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	8,994,451.32

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		301,121,675.45	-	258,720,389.46	-42,401,285.99
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,044,948,133.42	10,331,111.80	1,055,834,611.80	555,366.58
	银行间市场	20,014,080.00	144,657.53	20,164,657.53	5,920.00

	合计	1,064,962,213.42	10,475,769.33	1,075,999,269.33	561,286.58
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,783.00	-	1,620.00	-163.00
其他		-	-	-	-
合计		1,366,085,671.87	10,475,769.33	1,334,721,278.79	-41,840,162.41

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	19,692.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	52,407.12
其中：交易所市场	52,257.12
银行间市场	150.00

应付利息	-
预提费用	86,800.35
合计	158,899.80

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东方红景瑞精选混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,076,230,656.07	1,076,230,656.07
本期申购	1,244,257.01	1,244,257.01
本期赎回（以“-”号填列）	-152,514,679.07	-152,514,679.07
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	924,960,234.01	924,960,234.01

东方红景瑞精选混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	379,337,126.98	379,337,126.98
本期申购	1,605,708.14	1,605,708.14
本期赎回（以“-”号填列）	-108,294,453.85	-108,294,453.85
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	272,648,381.27	272,648,381.27

注：1、本基金合同生效日为 2026 年 01 月 27 日。本基金(A 类)在募集期间有效净认购资金共计 1,076,006,740.57 元，折合基金份额 1,076,006,740.57 份，产生的利息收入 223,915.50 元，折合基金份额 223,915.50 份，划入基金份额持有人账户;本基金(C 类)在募集期间有效净认购资金共计 379,270,211.16 元，折合基金份额 379,270,211.16 份，产生的利息收入 66,915.82 元，折合基金份额 66,915.82 份，划入基金份额持有人账户。

2、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

东方红景瑞精选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,387,692.03	-31,574,930.32	-27,187,238.29
本期基金份额交易产生的变动数	-595,107.10	2,909,375.20	2,314,268.10
其中：基金申购款	4,098.30	-20,579.85	-16,481.55
基金赎回款	-599,205.40	2,929,955.05	2,330,749.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,792,584.93	-28,665,555.12	-24,872,970.19

东方红景瑞精选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	993,836.76	-10,265,232.09	-9,271,395.33
本期基金份额交易产生的变动数	-276,263.54	1,823,489.42	1,547,225.88
其中：基金申购款	5,277.73	-43,859.39	-38,581.66
基金赎回款	-281,541.27	1,867,348.81	1,585,807.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	717,573.22	-8,441,742.67	-7,724,169.45

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	55,549.30
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	19,806.40
其他	115.44
合计	75,471.14

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27日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,970,222.99
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	-1,970,222.99

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 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	40,767,351.80
减：卖出股票成本总额	42,357,960.10
减：交易费用	379,614.69
买卖股票差价收入	-1,970,222.99

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 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	0.07
基金投资收益	-0.07

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	8,202,247.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	20,589.72
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	8,222,837.39

6.4.7.16.2 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27日（基金合同生效日）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	32,218,315.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,994,220.28
减：应计利息总额	203,305.19
减：交易费用	200.00
买卖债券差价收入	20,589.72

6.4.7.16.3 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。

6.4.7.16.4 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。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.18.3 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。

6.4.7.18.4 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。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 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。

6.4.7.19.2 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。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,231,285.89
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	3,231,285.89

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-41,840,162.41
股票投资	-42,401,285.99
债券投资	561,286.58
资产支持证券投资	-
基金投资	-163.00
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	-41,840,162.41

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	367,076.95
基金转换费收入	8,637.37
合计	375,714.32

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
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）	3.36
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	0.40

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	27,433.45
信息披露费	54,866.90
证券出借违约金	-
证券组合费	3,076.35
银行费用	6,849.07
账户维护费	4,500.00
其他	400.00
合计	97,125.77

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
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

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 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
东方证券	190,318,677.84	49.76

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
东方证券	986,303,292.89	88.94

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
东方证券	3,999,400,000.00	35.15

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
东方证券	1,783.00	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 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27日（基金合同生效日）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	87,409.74	49.55	-	-

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 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,523,959.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,743,784.84
应支付基金管理人的净管理费	1,780,174.76

注：1.本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人管理的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值扣除所持有本基金管理人管理的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）×0.60%÷当年天数。

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 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	880,989.88

注：本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人托管的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值扣除所持有本基金托管人托管的公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）×0.15%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期

各关联方名称	2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东方红景瑞精选混合 A	东方红景瑞精选混合 C	合计
东方证券	-	278.27	278.27
东证资管	-	12.61	12.61
招商银行	-	462,646.83	462,646.83
合计	-	462,937.71	462,937.71

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.35%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.35%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

注：本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	8,994,451.32	55,549.30

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期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

注：本基金本报告期内无交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理的基金。

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
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	15,895	160,698.45	160,698.45	-
001248	华润新能	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	37,090	374,979.90	374,979.90	-

	源									
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
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	6,488	65,658.56	179,912.24	-
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	-
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	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
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	-
688797	臻宝科	2026 年 6 月 16	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

	技	日								
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	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	1,971	38,789.28	278,876.79	-

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

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 177,500,000.00 元，于 2026 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	85,686,604.11
合计	85,686,604.11

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
AAA	664,173,165.50
AAA 以下	-
未评级	326,139,499.72

合计	990,312,665.22

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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	8,994,451.32	-	-	-	-	-	8,994,4
结算备付金	1,849,153.69	-	-	-	-	-	1,849,1
存出保证金	95,974.55	-	-	-	-	-	95,9
交易性金融资产	-	50,772,844.93	216,752,486.30	776,423,220.29	32,050,717.81	258,722,009.46	1,334,721,2
应收股利	-	-	-	-	-	606,955.40	606,9
应收申购款	-	-	-	-	-	7,065.82	7,0
应收清算	-	-	-	-	-	12,765,913.84	12,765,9

款							
资产总计	10,939,579.56	50,772,844.93	216,752,486.30	776,423,220.29	32,050,717.81	272,101,944.52	1,359,040,7
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,485,725.67	15,485,7
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	613,062.75	613,0
应付托管费	-	-	-	-	-	153,265.67	153,2
卖出回购金融资产款	177,500,000.00	-	-	-	-	-	177,500,0
应付销售服务费	-	-	-	-	-	84,056.63	84,0
应交税费	-	-	-	-	-	34,307.25	34,3
其他负债	-	-	-	-	-	158,899.80	158,8
负债总计	177,500,000.00	-	-	-	-	16,529,317.77	194,029,3
利率敏感度缺口	-166,560,420.44	50,772,844.93	216,752,486.30	776,423,220.29	32,050,717.81	255,572,626.75	1,165,011,4

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

假设	除市场利率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）
	1.市场利率下降 25	5,507,136.99

	个基点	
	2.市场利率上升 25 个基点	-5,380,101.76

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	-	103,635,450.00	-	103,635,450.00
资产合计	-	103,635,450.00	-	103,635,450.00
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	-	103,635,450.00	-	103,635,450.00

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）

	1、港币相对人民币升值 5%	5,181,772.50
	2、港币相对人民币贬值 5%	-5,181,772.50

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	258,720,389.46	22.21
交易性金融资产－基金投资	1,620.00	0.00
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	258,722,009.46	22.21

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）
	1.沪深 300 指数上升 5%	9,071,338.31
	2.沪深 300 指数下降 5%	-9,071,338.31

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
第一层次	257,198,846.65
第二层次	1,076,534,947.68
第三层次	987,484.46
合计	1,334,721,278.79

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	258,720,389.46	19.04
	其中：股票	258,720,389.46	19.04
2	基金投资	1,620.00	0.00
3	固定收益投资	1,075,999,269.33	79.17
	其中：债券	1,075,999,269.33	79.17
	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	10,843,605.01	0.80
8	其他各项资产	13,475,909.61	0.99
9	合计	1,359,040,793.41	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 103,635,450.00 元人民币，占期末基金资产净值比例 8.90%。

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	1,749,500.00	0.15
B	采矿业	9,351,900.00	0.80
C	制造业	103,193,295.11	8.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,564,678.35	0.65
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,366,382.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,090,184.00	1.55
J	金融业	5,746,000.00	0.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,904,000.00	0.25

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,119,000.00	0.35
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	155,084,939.46	13.31

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	3,530,000.00	0.30
15 原材料	-	-
20 工业	-	-
25 可选消费	36,131,400.00	3.10
30 主要消费	9,640,700.00	0.83
35 医药卫生	17,961,100.00	1.54
40 金融	6,484,800.00	0.56
45 信息技术	6,452,600.00	0.55
50 通信服务	20,578,850.00	1.77
55 公用事业	2,856,000.00	0.25
60 房地产	-	-
合计	103,635,450.00	8.90

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	00700	腾讯控股	35,000	13,065,500.00	1.12
2	000333	美的集团	130,700	9,871,771.00	0.85
3	603986	兆易创新	12,000	9,780,000.00	0.84
4	002475	立讯精密	123,900	8,722,560.00	0.75
5	300750	宁德时代	22,000	8,646,220.00	0.74
6	000338	潍柴动力	295,400	8,049,650.00	0.69
7	600938	中国海油	150,000	4,072,500.00	0.35
7	00883	中国海洋石油	200,000	3,530,000.00	0.30
8	03998	波司登	2,000,000	7,440,000.00	0.64
9	02020	安踏体育	110,000	6,788,100.00	0.58
10	600887	伊利股份	280,000	6,708,800.00	0.58
11	09896	名创优品	320,000	6,553,600.00	0.56
12	02628	中国人寿	280,000	6,484,800.00	0.56
13	600941	中国移动	70,000	6,029,100.00	0.52
14	06160	百济神州	40,000	5,920,000.00	0.51

15	600011	华能国际	400,000	3,036,000.00	0.26
15	00902	华能国际电力股份	600,000	2,856,000.00	0.25
16	02400	心动公司	150,000	5,797,500.00	0.50
17	600893	航发动力	150,000	5,751,000.00	0.49
18	600030	中信证券	200,000	5,746,000.00	0.49
19	02319	蒙牛乳业	400,000	5,588,000.00	0.48
20	601899	紫金矿业	210,000	5,279,400.00	0.45
21	02331	李宁	400,000	5,116,000.00	0.44
22	688777	中控技术	38,000	4,465,000.00	0.38
23	00175	吉利汽车	300,000	4,392,000.00	0.38
24	002078	太阳纸业	350,000	4,371,500.00	0.38
25	01801	信达生物	60,000	4,148,400.00	0.36
26	600323	瀚蓝环境	150,000	4,119,000.00	0.35
27	01318	毛戈平	90,000	4,052,700.00	0.35
28	600886	国投电力	300,000	3,993,000.00	0.34
29	00981	中芯国际	50,000	3,882,500.00	0.33
30	002223	鱼跃医疗	150,000	3,849,000.00	0.33
31	002345	潮宏基	400,000	3,668,000.00	0.31
32	600426	华鲁恒升	150,000	3,588,000.00	0.31
33	688052	纳芯微	12,000	3,459,720.00	0.30
34	002415	海康威视	100,000	3,420,000.00	0.29
35	603365	水星家纺	200,000	3,114,000.00	0.27
36	002293	罗莱生活	300,000	2,967,000.00	0.25
37	002027	分众传媒	600,000	2,904,000.00	0.25
38	603171	税友股份	72,400	2,885,140.00	0.25
39	688169	石头科技	30,145	2,862,870.65	0.25
40	06618	京东健康	100,000	2,852,000.00	0.24
41	09992	泡泡玛特	20,000	2,687,200.00	0.23
42	00853	微创医疗	500,000	2,680,000.00	0.23
43	002352	顺丰控股	75,700	2,366,382.00	0.20
44	09606	映恩生物-B	15,000	2,360,700.00	0.20
45	600352	浙江龙盛	183,400	2,220,974.00	0.19
46	000977	浪潮信息	31,100	2,177,000.00	0.19
47	002891	中宠股份	81,200	2,169,664.00	0.19
48	00992	联想集团	90,000	1,799,100.00	0.15
49	002714	牧原股份	50,000	1,749,500.00	0.15
50	09626	哔哩哔哩-W	15,000	1,715,850.00	0.15
51	00325	布鲁可	45,000	1,624,500.00	0.14
52	603816	顾家家居	70,400	1,574,144.00	0.14
53	02333	长城汽车	200,000	1,530,000.00	0.13
54	300628	亿联网络	43,300	1,464,406.00	0.13
55	301061	匠心家居	39,000	1,367,730.00	0.12
56	600309	万华化学	19,300	1,320,313.00	0.11

57	300818	耐普矿机	68,900	1,302,210.00	0.11
58	002558	巨人网络	45,400	1,251,224.00	0.11
59	002946	新乳业	86,800	1,222,144.00	0.10
60	301087	可孚医疗	20,000	953,000.00	0.08
61	00268	金蝶国际	150,000	771,000.00	0.07
62	301498	乖宝宠物	15,000	608,850.00	0.05
63	001248	华润新能源	52,985	535,678.35	0.05
64	002327	富安娜	76,600	455,004.00	0.04
65	688820	盛合晶微	1,971	278,876.79	0.02
66	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
67	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.02
68	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
69	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
70	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
71	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
72	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
73	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
74	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
75	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
76	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
77	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
78	603293	埃泰克	72	2,442.96	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	17,575,663.67	1.51
2	02331	李宁	10,764,103.82	0.92
3	000333	美的集团	9,954,304.42	0.85
4	02400	心动公司	9,943,780.91	0.85
5	09896	名创优品	9,861,884.15	0.85
6	600938	中国海油	5,171,519.26	0.44
6	00883	中国海洋石油	4,534,238.18	0.39
7	600011	华能国际	5,691,913.00	0.49
7	00902	华能国际电力股份	3,233,692.45	0.28
8	603171	税友股份	8,690,217.80	0.75
9	02628	中国人寿	8,651,352.48	0.74
10	300750	宁德时代	8,310,778.00	0.71
11	03998	波司登	7,949,569.82	0.68

12	601899	紫金矿业	7,617,554.00	0.65
13	600941	中国移动	7,519,031.00	0.65
14	600893	航发动力	7,331,384.00	0.63
15	600887	伊利股份	7,330,464.00	0.63
16	000338	潍柴动力	7,115,737.00	0.61
17	02020	安踏体育	7,089,886.65	0.61
18	06160	百济神州	6,901,866.91	0.59
19	002475	立讯精密	6,134,848.00	0.53
20	02319	蒙牛乳业	5,913,729.48	0.51

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688012	中微公司	4,589,608.46	0.39
2	688111	金山办公	3,171,162.20	0.27
3	600011	华能国际	2,989,007.00	0.26
4	03996	中国能源建设	2,914,732.81	0.25
5	02331	李宁	2,871,789.16	0.25
6	600585	海螺水泥	2,755,750.00	0.24
7	603171	税友股份	1,929,838.00	0.17
8	688249	晶合集成	1,558,301.52	0.13
9	002153	石基信息	1,541,331.00	0.13
10	600760	中航沈飞	1,532,736.00	0.13
11	688820	盛合晶微	1,357,845.73	0.12
12	300274	阳光电源	1,322,320.00	0.11
13	688808	联讯仪器	1,227,240.00	0.11
14	300433	蓝思科技	1,195,840.00	0.10
15	601595	上海电影	1,164,290.00	0.10
16	300893	松原安全	1,078,167.80	0.09
17	03800	协鑫科技	884,829.61	0.08
18	600941	中国移动	869,034.00	0.07
19	300818	耐普矿机	753,479.00	0.06
20	688797	臻宝科技	746,839.44	0.06

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	343,479,635.55
卖出股票收入（成交）总额	40,767,351.80

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	87,407,223.29	7.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	613,595,324.40	52.67
	其中：政策性金融债	20,164,657.53	1.73
4	企业债券	374,996,721.64	32.19
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	1,075,999,269.33	92.36

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	137769	22 银河 G5	700,000	72,501,282.19	6.22
2	241231	24 信投 G5	700,000	71,595,048.77	6.15
3	524409	25 招港 K1	700,000	71,236,621.92	6.11
4	243736	25 国能 K2	700,000	71,157,144.11	6.11
5	524551	25 申证 11	700,000	70,860,160.00	6.08

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将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。

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。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金仅投资于全市场的股票型 ETF、本基金管理人管理的股票型基金以及计入权益类资产的混合型基金。

本基金基于权益类基金投资目标的不同，将标的基金分为主动和被动两大类，并根据基金产品特征，综合定量和定性两个维度优选拟投资基金标的。其中，针对主动管理类基金，本基金从基金风格、业绩表现、稳定性、规模变化等多角度进行考量，主要参考基金规模、历史业绩、风险调整后的收益、风险控制指标等一系列量化指标对基金进行分析，选取出预期能够获得良好业绩的基金；针对被动管理类基金，本基金从标的指数表现、跟踪误差、超额收益、规模变化等多角度进行分析，选取出表现稳定，符合未来市场发展方向的基金。同时，本基金还将结合标的基金基金管理人的资产管理规模、团队稳定性、风险控制能力等定性因素，对标的基金的业绩稳定性、风险控制能力等进行评估。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他基金品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围并相应调整投资策略。

本基金所持有的基金的业绩表现、持有基金的基金管理人水平等因素将影响到本基金的基金业绩表现；同时，本基金可能会面临所持有的证券投资基金的基金运作风险、价格波动风险、流动性风险，具体包括：

（1）被投资基金的投资运作会受到宏观经济环境、行业周期、基金经理管理能力和基金管理人自身经营状况等因素的影响，导致交易价格和/或基金份额净值产生波动。本基金整体表现可能受所投资基金的影响。

（2）虽然本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费，投资于本基金托管人所托管的公开募集证券投资基金的部分不收取托管费，申购本基金管理人管理的基金（ETF 除外）不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，但当本基金投资于其他基金管理人管理和/或其他基金托管人托管的基金时，投资者所承担的相关基金费用可能比投资普通的开放式基金高。

（3）若被投资基金拒绝或暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌，本基金可能无法及时办

理赎回或卖出被投资基金，从而产生一定的流动性风险。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

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	560860	万家中证工业有色金属主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,000.00	1,620.00	0.00	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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	95,974.55
2	应收清算款	12,765,913.84
3	应收股利	606,955.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,065.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,475,909.61

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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（%）
东方红景瑞精选混合 A	2,455	376,765.88	31,686,811.52	3.43	893,273,422.49	96.57
东方红景瑞精选混合 C	1,689	161,425.92	11,800,393.33	4.33	260,847,987.94	95.67
合计	4,144	288,998.22	43,487,204.85	3.63	1,154,121,410.43	96.37

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 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	东方红景瑞精选混合 A	10,255.18	0.00
	东方红景瑞精选混合 C	1,245,230.35	0.46
	合计	1,255,485.53	0.10

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）。

8.3 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	东方红景瑞精选混合 A	0
	东方红景瑞精选混合 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	东方红景瑞精选混合 A	0
	东方红景瑞精选混合 C	>100
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方红景瑞精选混合 A	东方红景瑞精选混合 C
基金合同生效日（2026 年 1 月 27 日）基金份额总额	1,076,230,656.07	379,337,126.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,244,257.01	1,605,708.14
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	152,514,679.07	108,294,453.85
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	924,960,234.01	272,648,381.27

注：本基金基金合同生效日为 2026 年 01 月 27 日。

§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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期不涉及持有的基金发生重大影响事件的情形。

10.6 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德勤华永会计师事务所（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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 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。

10.7.4 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。

10.8 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

10.8.1 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(%)	
东方证券	5	190,318,677.84	49.76	87,409.74	49.55	-
东方财富证券	2	36,854,666.03	9.64	18,240.99	10.34	-

国泰海通	3	31,922,380.54	8.35	15,001.63	8.50	-
野村东方国际证券	2	26,511,525.42	6.93	11,556.57	6.55	-
中信建投证券	1	24,489,043.51	6.40	12,244.53	6.94	-
国金证券	2	16,501,585.40	4.31	7,193.37	4.08	-
申万宏源	1	12,075,041.72	3.16	5,576.51	3.16	-
中金公司	2	11,336,220.02	2.96	4,941.69	2.80	-
华创证券	2	9,037,537.17	2.36	3,939.36	2.23	-
摩根大通证券	2	6,678,265.55	1.75	3,006.80	1.70	-
广发证券	2	5,846,787.52	1.53	2,548.03	1.44	-
国联民生	3	5,758,353.00	1.51	2,509.94	1.42	-
招商证券	1	2,746,138.03	0.72	1,197.23	0.68	-
国盛证券	2	2,415,335.74	0.63	1,052.91	0.60	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	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	-	-	-	-	-
华泰证	1	-	-	-	-	-

券						
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	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
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、本基金合同生效日为 2026 年 01 月 27 日，上述交易单元均为本报告期新增。

10.8.2 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		基金交易	
	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(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
东方证	986,303,292.89	88.94	3,999,400,000.00	35.15	-	-	1,783.00	100.00

券								
东方财富证券	90,639,060.81	8.17	1,875,500,000.00	16.48	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	984,200,000.00	8.65	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	2,117,988,000.00	18.61	-	-	-	-
华创证券	5,003,300.00	0.45	1,068,500,000.00	9.39	-	-	-	-
摩根大	27,011,710.00	2.44	488,400,000.00	4.29	-	-	-	-

通证券								
广发证券	-	-	451,600,000.00	3.97	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	3,800,000.00	0.03	-	-	-	-
国盛证券	-	-	383,600,000.00	3.37	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	5,000,000.00	0.04	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.9 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	东方红景瑞精选混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 28 日
2	东方红景瑞精选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
3	东方红景瑞精选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 23 日
4	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
5	关于东方红景瑞精选混合型证券投资基金在招商银行股份有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 25 日
6	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景瑞精选混合型证券投资基金的文件；

2、《东方红景瑞精选混合型证券投资基金基金合同》；

3、《东方红景瑞精选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