

# 东方红核心价值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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 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合规守信情况的说明              | 11        |
| 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             | 12        |
| 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                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>46</b> |
| 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 .....             | 52        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 52        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>53</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 53        |
| 8.2 盈利投资者数量占比 .....                         | 53        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 54        |
| 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 .....      | 54        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>54</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>55</b> |
| 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 .....           | 55        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 55        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 55        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 55        |
| 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 .....      | 56        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 57        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>57</b> |
| 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 .....    | 57        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 57        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>57</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 57        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 58        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 58        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                  |                  |
|---------------------|------------------|------------------|
| 基金名称                | 东方红核心价值混合型证券投资基金 |                  |
| 基金简称                | 东方红核心价值混合        |                  |
| 基金主代码               | 024429           |                  |
| 基金运作方式              | 契约型开放式           |                  |
| 基金合同生效日             | 2025 年 6 月 6 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               | 上海浦东发展银行股份有限公司   |                  |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 608,934,109.70 份 |                  |
| 基金合同存续期             | 不定期              |                  |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 东方红核心价值混合 A      | 东方红核心价值混合 C      |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 024429           | 024430           |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 327,299,298.46 份 | 281,634,811.24 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，通过积极主动的投资管理，追求超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略 | <p>本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中股票、债券和现金类大类资产的配置比例。</p> <p>本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。</p> <p>在股票投资方面，本基金利用基金管理人投研团队的资源，对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出价格低估、质地优秀、未来预期成长性良好的上市公司股票（含存托凭证）进行投资。</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                      |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>在债券投资方面，基金管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。</p> <p>此外，本基金还会运用可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券的投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、信用衍生品投资策略以及参与融资业务策略等。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+中债综合指数收益率×20%                                                                                                                                                                                 |
| 风险收益特征 | <p>本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>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。</p>                                                     |

## 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               | 上海浦东发展银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 周陶                           | 汪小敏                   |
|             | 联系电话 | 021-53952888                 | 021-31888888          |
|             | 电子邮箱 | service@dfham.com            | wangxm8@spdb.com.cn   |
| 客户服务电话      |      | 4009200808                   | 95528                 |
| 传真          |      | 021-63326381                 | 021-63602540          |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层    | 上海市中山东一路 12 号         |
| 办公地址        |      | 上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层-11 层 | 上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋 |
| 邮政编码        |      | 200010                       | 200126                |
| 法定代表人       |      | 杨斌                           | 张为忠                   |

## 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<br>据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |                |
|-------------------|-------------------------------------|----------------|
|                   | 东方红核心价值混合 A                         | 东方红核心价值混合 C    |
| 本期已实现收益           | 83,069,497.96                       | 70,418,202.81  |
| 本期利润              | 26,807,889.73                       | 24,694,195.79  |
| 加权平均基金份<br>额本期利润  | 0.0692                              | 0.0703         |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 5.97%                               | 6.09%          |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 6.14%                               | 5.89%          |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |                |
|                   |                                     |                |
| 期末可供分配利<br>润      | 56,595,945.23                       | 46,944,467.94  |
| 期末可供分配基<br>金份额利润  | 0.1729                              | 0.1667         |
| 期末基金资产净<br>值      | 383,895,243.69                      | 328,579,279.18 |
| 期末基金份额净<br>值      | 1.1729                              | 1.1667         |
| 3.1.3 累计期<br>末指标  | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |                |
|                   |                                     |                |
| 基金份额累计净<br>值增长率   | 17.29%                              | 16.67%         |

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

东方红核心价值混合 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      | 7.18%    | 0.92%       | 5.25%      | 0.91%         | 1.93% | 0.01% |
| 过去六个月      | 6.14%    | 0.98%       | 1.59%      | 0.86%         | 4.55% | 0.12% |
| 过去一年       | 16.86%   | 0.80%       | 13.52%     | 0.77%         | 3.34% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.29%   | 0.77%       | 14.84%     | 0.76%         | 2.45% | 0.01% |

东方红核心价值混合 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      | 7.06%    | 0.92%       | 5.25%      | 0.91%         | 1.81% | 0.01% |
| 过去六个月      | 5.89%    | 0.99%       | 1.59%      | 0.86%         | 4.30% | 0.13% |
| 过去一年       | 16.29%   | 0.80%       | 13.52%     | 0.77%         | 2.77% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.67%   | 0.77%       | 14.84%     | 0.76%         | 1.83% | 0.01% |

### 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

东方红核心价值混合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



东方红核心价值混合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：本基金建仓期 6 个月，即从 2025 年 06 月 06 日起至 2025 年 12 月 05 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金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<br>（助理）期限 |      | 证券从<br>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 | 2025 年 6 月 6 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 1.1729 元，份额累计净值为 1.1729 元;C 类份额净值为 1.1667 元，份额累计净值为 1.1667 元。本报告期基金 A 类份额净值增长率为 6.14%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%;C 类份额净值增长率为 5.89%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%。

#### 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验。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对东方红核心价值混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对东方红核心价值混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由上海东方证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：东方红核心价值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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|------------------------|--------------------------|
|-----|-----|------------------------|--------------------------|

|               |            |                                |                                  |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产:</b>   |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 99,697,661.33                  | 130,712,425.15                   |
| 结算备付金         |            | 32,728,708.98                  | 32,628,325.63                    |
| 存出保证金         |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 532,013,578.99                 | 691,200,463.48                   |
| 其中: 股票投资      |            | 516,199,178.99                 | 618,960,304.23                   |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 15,814,400.00                  | 72,240,159.25                    |
| 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    | 56,992,000.00                  | 150,075,000.00                   |
| 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         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | 117,385.93                     | -                                |
| 应收申购款         |            | 145,690.09                     | 886,659.21                       |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 721,695,025.32                 | 1,005,502,873.47                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>   |            |                                |                                  |
| 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         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | 4,546,408.09                   | 64,196,903.17                    |
| 应付管理人报酬       |            | 726,387.94                     | 1,013,350.96                     |
| 应付托管费         |            | 123,803.98                     | 172,012.16                       |
| 应付销售服务费       |            | 142,176.55                     | 222,714.99                       |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 2,328.39                       | 2,803.17                         |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 3,679,397.50                   | 2,993,664.51                     |
| 负债合计          |            | 9,220,502.45                   | 68,601,448.96                    |

|          |          |                |                  |
|----------|----------|----------------|------------------|
| 净资产：     |          |                |                  |
| 实收基金     | 6.4.7.10 | 608,934,109.70 | 849,093,563.06   |
| 其他综合收益   | 6.4.7.11 | -              | -                |
| 未分配利润    | 6.4.7.12 | 103,540,413.17 | 87,807,861.45    |
| 净资产合计    |          | 712,474,522.87 | 936,901,424.51   |
| 负债和净资产总计 |          | 721,695,025.32 | 1,005,502,873.47 |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 608,934,109.70 份，其中东方红核心价值混合 A 基金份额总额 327,299,298.46 份，基金份额净值 1.1729 元；东方红核心价值混合 C 基金份额总额 281,634,811.24 份，基金份额净值 1.1667 元。

6.2 利润表

会计主体：东方红核心价值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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 6 月 6 日（基金合<br>同生效日）至 2025 年 6<br>月 30 日 |
|-------------------------------|----------|------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| 一、营业总收入                       |          | 58,549,701.16                            | 9,142,363.13                                               |
| 1. 利息收入                       |          | 208,379.68                               | 638,941.65                                                 |
| 其中：存款利息收入                     | 6.4.7.13 | 199,898.68                               | 192,845.88                                                 |
| 债券利息收入                        |          | -                                        | -                                                          |
| 资产支持证券利<br>息收入                |          | -                                        | -                                                          |
| 买入返售金融资<br>产收入                |          | 8,481.00                                 | 446,095.77                                                 |
| 其他利息收入                        |          | -                                        | -                                                          |
| 2. 投资收益（损失以“-”<br>填列）         |          | 159,050,178.44                           | 2,469,134.85                                               |
| 其中：股票投资收益                     | 6.4.7.14 | 155,718,519.37                           | 932,944.45                                                 |
| 基金投资收益                        |          | -                                        | -                                                          |
| 债券投资收益                        | 6.4.7.15 | -1,144,211.05                            | 129,823.44                                                 |
| 资产支持证券投<br>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 | -                                        | -428.04                                                    |
| 股利收益                          | 6.4.7.19 | 4,475,870.12                             | 1,406,795.00                                               |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产<br>生的收益 |          | -                                        | -                                                          |
| 其他投资收益                        |          | -                                        | -                                                          |
| 3. 公允价值变动收益（损                 | 6.4.7.20 | -101,985,615.25                          | 6,034,286.63                                               |

|                            |                |                  |                 |
|----------------------------|----------------|------------------|-----------------|
| 失以“-”号填列)                  |                |                  |                 |
| 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, 276, 758. 29  | -               |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |                | 7, 047, 615. 64  | 2, 174, 398. 36 |
| 1. 管理人报酬                   | 6. 4. 10. 2. 1 | 4, 363, 268. 04  | 784, 761. 08    |
| 其中：暂估管理人报酬                 |                | -                | -               |
| 2. 托管费                     | 6. 4. 10. 2. 2 | 848, 957. 49     | 261, 587. 01    |
| 3. 销售服务费                   | 6. 4. 10. 2. 3 | 1, 008, 242. 45  | 326, 596. 37    |
| 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, 699. 27       | 414. 49         |
| 8. 其他费用                    | 6. 4. 7. 23    | 825, 448. 39     | 801, 039. 41    |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |                | 51, 502, 085. 52 | 6, 967, 964. 77 |
| 减：所得税费用                    |                | -                | -               |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |                | 51, 502, 085. 52 | 6, 967, 964. 77 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |                | -                | -               |
| <b>六、综合收益总额</b>            |                | 51, 502, 085. 52 | 6, 967, 964. 77 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东方红核心价值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<br>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            | 849, 093, 563. 06                     | 87, 807, 861. 45  | 936, 901, 424. 51  |
| 二、本期期初净资产            | 849, 093, 563. 06                     | 87, 807, 861. 45  | 936, 901, 424. 51  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -240, 159, 453. 36                    | 15, 732, 551. 72  | -224, 426, 901. 64 |
| (一)、综合收益总额           | -                                     | 51, 502, 085. 52  | 51, 502, 085. 52   |
| (二)、本期基金份            | -240, 159, 453. 36                    | -35, 769, 533. 80 | -275, 928, 987. 16 |

|                                          |                                                     |                |                  |
|------------------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|------------------|
| 额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）               |                                                     |                |                  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 255,502,888.86                                      | 43,258,605.70  | 298,761,494.56   |
| 2. 基金赎回款                                 | -495,662,342.22                                     | -79,028,139.50 | -574,690,481.72  |
| （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                                | 608,934,109.70                                      | 103,540,413.17 | 712,474,522.87   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2025 年 6 月 6 日（基金合同生效日）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                                | -                                                   | -              | -                |
| 二、本期期初净资产                                | 1,991,356,546.25                                    | -              | 1,991,356,546.25 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                                                   | 6,967,964.77   | 6,967,964.77     |
| （一）、综合收益总额                               | -                                                   | 6,967,964.77   | 6,967,964.77     |
| （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）      | -                                                   | -              | -                |
| 其中：1. 基金申购款                              | -                                                   | -              | -                |
| 2. 基金赎回款                                 | -                                                   | -              | -                |
| （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                                | 1,991,356,546.25                                    | 6,967,964.77   | 1,998,324,511.02 |

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

东方红核心价值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》、《东方红核心价值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]1105 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。本基金根据认购费用、申购费用、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 1,991,356,546.25 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（25）第 00159 号验资报告。基金合同于 2025 年 6 月 6 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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《东方红核心价值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允许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债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债（含证券公司发行的短期公司债）、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、可交换债券）、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、国债期货、股票期权、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。本基金的投资比例为：本基金投资于股票资产（含存托凭证）的比例为基金资产的 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及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。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：

沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+中债综合指数收益率×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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 24,896,031.80          |
| 等于：本金          | 24,889,930.01          |
| 加：应计利息         | 6,101.79               |
| 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   | 74,801,629.53 |
| 等于：本金  | 74,799,868.61 |
| 加：应计利息 | 1,760.92      |
| 合计     | 99,697,661.33 |

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |                |                |
|---------------|-------|------------------------|-----------|----------------|----------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息      | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 608,374,100.51         | -         | 516,199,178.99 | -92,174,921.52 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -         | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 16,434,465.41          | 67,200.00 | 15,814,400.00  | -687,265.41    |
|               | 银行间市场 | -                      | -         | -              | -              |
|               | 合计    | 16,434,465.41          | 67,200.00 | 15,814,400.00  | -687,265.41    |
| 资产支持证券        |       | -                      | -         | -              | -              |
| 基金            |       | -                      | -         | -              | -              |
| 其他            |       | -                      | -         | -              | -              |
| 合计            |       | 624,808,565.92         | 67,200.00 | 532,013,578.99 | -92,862,186.93 |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 56,992,000.00          | -         |
| 银行间市场 | -                      | -         |
| 合计    | 56,992,000.00          | -         |

##### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 4,722.68               |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | -                      |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 86,780.45              |
| 其他          | 261.45                 |
| 或有管理费       | 3,587,632.92           |
| 合计          | 3,679,397.50           |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

东方红核心价值混合 A

| 项目            | 本期<br>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          | 432,492,703.83                        | 432,492,703.83  |
| 本期申购          | 200,022,124.39                        | 200,022,124.39  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -305,215,529.76                       | -305,215,529.76 |
| 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           | 327,299,298.46 | 327,299,298.46 |

东方红核心价值混合 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          | 416,600,859.23                  | 416,600,859.23  |
| 本期申购          | 55,480,764.47                   | 55,480,764.47   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -190,446,812.46                 | -190,446,812.46 |
| 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           | 281,634,811.24                  | 281,634,811.24  |

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

东方红核心价值混合 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 53,298,775.85  | -7,905,847.09  | 45,392,928.76  |
| 本期期初           | 53,298,775.85  | -7,905,847.09  | 45,392,928.76  |
| 本期利润           | 83,069,497.96  | -56,261,608.23 | 26,807,889.73  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -24,099,096.60 | 8,494,223.34   | -15,604,873.26 |
| 其中：基金申购款       | 40,903,567.83  | -6,733,063.90  | 34,170,503.93  |
| 基金赎回款          | -65,002,664.43 | 15,227,287.24  | -49,775,377.19 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 112,269,177.21 | -55,673,231.98 | 56,595,945.23  |

东方红核心价值混合 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 49,996,269.19  | -7,581,336.50  | 42,414,932.69  |
| 本期期初           | 49,996,269.19  | -7,581,336.50  | 42,414,932.69  |
| 本期利润           | 70,418,202.81  | -45,724,007.02 | 24,694,195.79  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -25,802,682.70 | 5,638,022.16   | -20,164,660.54 |
| 其中：基金申购款       | 9,994,468.59   | -906,366.82    | 9,088,101.77   |
| 基金赎回款          | -35,797,151.29 | 6,544,388.98   | -29,252,762.31 |

|         |               |                |               |
|---------|---------------|----------------|---------------|
| 本期已分配利润 | -             | -              | -             |
| 本期末     | 94,611,789.30 | -47,667,321.36 | 46,944,467.94 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 70,860.74                             |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | 26,662.77                             |
| 结算备付金利息收入 | 100,383.35                            |
| 其他        | 1,991.82                              |
| 合计        | 199,898.68                            |

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<br>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 | 155,718,519.37             |
| 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               | 155,718,519.37             |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 476,140,883.81                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 319,731,940.61                        |
| 减：交易费用     | 690,423.83                            |
| 买卖股票差价收入   | 155,718,519.37                        |

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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 471,786.27                 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,615,997.32              |
| 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                           | -1,144,211.05              |

#### 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<br>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   | 54,585,877.36              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 55,493,978.73              |
| 减：应计利息总额               | 705,133.74                 |
| 减：交易费用                 | 2,762.21                   |
| 买卖债券差价收入               | -1,615,997.32              |

#### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 4,475,870.12                          |
| 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            | 4,475,870.12                          |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -101,985,615.25                       |
| 股票投资       | -100,879,648.93                       |
| 债券投资       | -1,105,966.32                         |
| 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                     | -101,985,615.25 |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 498,845.34                            |
| 基金转换费收入 | 777,912.95                            |
| 合计      | 1,276,758.29                          |

#### 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<br>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   | 1,238.98                              |
| 银行费用    | 6,952.38                              |
| 或有管理费   | 730,476.58                            |
| 合计      | 825,448.39                            |

#### 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 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”） | 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          |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 | 上年度可比期间<br>2025年6月6日（基金合同生效日）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  | 626,760,566.57                        | 79.09           | 642,362,079.42                            | 100.00          |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 | 上年度可比期间<br>2025年6月6日（基金合同生效日）至2025年6月30 日 |                 |
|-------|---------------------------------------|-----------------|-------------------------------------------|-----------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券成交总额的比例（%） | 成交金额                                      | 占当期债券成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 55,247,636.36                         | 100.00          | 153,896,026.59                            | 100.00          |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                   | 上年度可比期间<br>2025年6月6日（基金合同生效日）至 2025年6月30日 |                   |
|-------|---------------------------------------|-------------------|-------------------------------------------|-------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券回购成交总额的比例（%） | 成交金额                                      | 占当期债券回购成交总额的比例（%） |
| 东方证券  | 56,992,000.00                         | 100.00            | 6,509,731,000.00                          | 100.00            |

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<br>2026年1月1日至2026年6月30日               |                   |              |                     |
|-------|------------------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                                 | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 东方证券  | 280,662.78                               | 77.09             | -            | -                   |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025年6月6日（基金合同生效日）至2025年6月30日 |                   |              |                     |
|       | 当期<br>佣金                                 | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 东方证券  | 287,347.50                               | 100.00            | -            | -                   |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 6 月 6 日（基金合同<br>生效日）至 2025 年 6 月 30<br>日 |
|----------------------|------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费       | 4,363,268.04                             | 784,761.08                                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护<br>费 | 1,620,332.46                             | 333,643.77                                                 |
| 应支付基金管理人的净管理费        | 2,742,935.58                             | 451,117.31                                                 |

注：1、本基金的管理费包括固定管理费、或有管理费和超额管理费。其中，于 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日应支付的固定管理费为人民币 4,363,268.04 元，或有管理费为人民币 730,476.58 元，超额管理费为人民币 0.00 元。

本基金根据每笔基金份额的持有期限与持有期间年化收益率，在赎回、转换转出基金份额或基金合同终止的情形发生时确定该笔基金份额对应的管理费。管理费包含固定管理费、或有管理费和超额管理费，其中，固定管理费按 0.6%年费率每日计提并收取，或有管理费按 0.6%年费率每日计提并根据条件收取或返还，超额管理费在符合收取条件时按 0.3%的年费率计提和收取，具体按以下方式计算和确认。

### （1）固定管理费

本基金的固定管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。固定管理费的计算方法如下：

$$H1 = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H1 为每日应计提的固定管理费

E 为前一日的基金资产净值 固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式支付。

### （2）或有管理费和超额管理费

本基金的或有管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。或有管理费的计算方法如下：

$$H2 = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H2 为每日应计提的或有管理费

E 为前一日的基金资产净值

投资者赎回、转换转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，若该笔份额持有期限不足一年，则该笔份额持有期内计提的或有管理费应确认为应由管理人收取的管理费。或有管理费每日计提，逐日累计至发生基金份额赎回或转出时或基金合同终止情形时计算并支付。基金管理人每日对是否满足或有管理费收取条件进行判断。若该笔份额持有期限达到一年及以上，但  $R \leq R_b - 3\%$  时（R 为该笔基金份额持有期间年化收益率（扣除固定管理费及或有管理费后，扣除超额管理费前）， $R_b$  为本基金业绩比较基准同期年化收益率，下同），则该笔份额持有期内计提的或有管理费将全额返还给投资者，管理人实际收取的或有管理费为 0；若该笔份额持有期限达到一年及以上，且  $R > R_b - 3\%$  时，该笔份额持有期内计提的或有管理费应确认为应由管理人收取的管理费。

基金超额管理费的计算方法如下：

投资者赎回、转换转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，当且仅当该笔份额持有期限达到一年及以上，且  $R > R_b + 6\%$  且  $R > 0$  时，则该笔份额按照 0.30% 的年费率计算超额管理费，并确认为应由管理人收取的管理费；每笔基金份额的超额管理费每日预估计算，但不从基金资产中实际计提，逐日累计。此外，若  $R^* \leq R_b + 6\%$ ，或  $R^* \leq 0$  时（ $R^*$  为扣除超额管理费后的持有期间年化收益率（已扣除固定管理费及或有管理费）），为使得该笔份额在扣除超额管理费后的持有期间年化收益率仍满足本基金收取超额管理费的标准，此时将不收取超额管理费，仍按 1.20% 年费率（固定管理费率 0.6%、或有管理费率 0.6%）收取该笔份额的管理费。

对于已经确认为管理人收入的或有管理费和超额管理费，由基金托管人按照与基金管理人协

商一致的方式支付。

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 6 月 6 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|-----------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 848,957.49                            | 261,587.01                                          |

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：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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<br>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                                    |                |            |
|                | 东方红核心价值混合<br>A                                      | 东方红核心价值混合<br>C | 合计         |
|                |                                                     |                |            |
| 东方证券           | -                                                   | 63,748.81      | 63,748.81  |
| 东证资管           | -                                                   | 453,795.94     | 453,795.94 |
| 浦发银行           | -                                                   | 352,890.88     | 352,890.88 |
| 合计             | -                                                   | 870,435.63     | 870,435.63 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 6 月 6 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |                |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                    |                |            |
|                | 东方红核心价值混合<br>A                                      | 东方红核心价值混合<br>C | 合计         |
|                |                                                     |                |            |
| 东方证券           | -                                                   | 12,941.14      | 12,941.14  |
| 东证资管           | -                                                   | 62,300.00      | 62,300.00  |
| 浦发银行           | -                                                   | 171,857.37     | 171,857.37 |
| 合计             | -                                                   | 247,098.51     | 247,098.51 |

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 0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |             |
|---------------------------------|---------------------------------------|-------------|
|                                 | 东方红核心价值混合 A                           | 东方红核心价值混合 C |
| 基金合同生效日（ 2025 年 6 月 6 日）持有的基金份额 | 0.00                                  | —           |
| 报告期初持有的基金份额                     | 10,002,500.00                         | —           |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 0.00                                  | —           |
| 报告期间因拆分变动份额                     | —                                     | —           |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | 0.00                                  | —           |
| 报告期末持有的基金份额                     | 10,002,500.00                         | —           |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 3.0561%                               | —           |

| 项目                             | 上年度可比期间<br>2025 年 6 月 6 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |             |
|--------------------------------|-----------------------------------------------------|-------------|
|                                | 东方红核心价值混合 A                                         | 东方红核心价值混合 C |
| 基金合同生效日（2025 年 6 月 6 日）持有的基金份额 | 10,002,500.00                                       | —           |
| 报告期初持有的基金份额                    | —                                                   | —           |
| 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                    | 10,002,500.00                                       | —           |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例            | 1.0035%                                             | —           |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2025年6月6日（基金合同生效日）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     |
| 东方证券  | 7,943,137.73                          | 15,412.76 | 406,163,126.90                           | 17,028.96  |
| 浦发银行  | 24,896,031.80                         | 70,860.74 | 1,516,011.23                             | 156,791.09 |

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。

本基金的第三方存管户资金为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

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

本基金支付给东证期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确

定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2026 年 06 月 30 日，本基金无应付交易手续费余额(2025 年 12 月 31 日：同)。于 2026 年上半年，本基金当期交易手续费支出 0 元(2025 年同期：428.04 元)。

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 32,723,710.63 元，存出保证金余额为 0 元(2025 年 12 月 31 日：结算备付金余额 32,622,788.48 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 100,383.35 元(2025 年同期：15,146.94 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  | 7,788    | 78,736.68  | 78,736.68  | -  |
| 001248               | 华润新能源 | 2026 年 6 月 24 日 | 6 个月     | 新股锁定   | 10.11 | 10.11  | 18,172   | 183,718.92 | 183,718.92 | -  |
| 001257               | 盛龙    | 2026 年 3        | 6 个月     | 新股锁定   | 7.82  | 20.74  | 1,743    | 13,630.26  | 36,149.82  | -  |

|        |      |                           |      |          |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|---------------------------|------|----------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        | 股份   | 月 24<br>日                 |      |          |       |       |       |           |           |   |
| 001365 | 天海电子 | 2026<br>年 5<br>月 11<br>日  | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 27.19 | 31.31 | 719   | 19,549.61 | 22,511.89 | - |
| 001393 | 维通利  | 2026<br>年 5<br>月 8<br>日   | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 30.38 | 38.99 | 387   | 11,757.06 | 15,089.13 | - |
| 001399 | 惠科股份 | 2026<br>年 6<br>月 16<br>日  | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 10.12 | 27.73 | 3,276 | 33,153.12 | 90,843.48 | - |
| 301531 | 春光集团 | 2026<br>年 4<br>月 28<br>日  | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 13.30 | 51.56 | 290   | 3,857.00  | 14,952.40 | - |
| 301669 | 高特电子 | 2026<br>年 6<br>月 2<br>日   | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 7.08  | 28.40 | 546   | 3,865.68  | 15,506.40 | - |
| 301687 | 新广益  | 2025<br>年 12<br>月 24<br>日 | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 21.93 | 77.78 | 195   | 4,276.35  | 15,167.10 | - |
| 601112 | 振石股份 | 2026<br>年 1<br>月 21<br>日  | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 11.18 | 17.59 | 767   | 8,575.06  | 13,491.53 | - |
| 603284 | 林平发展 | 2026<br>年 2<br>月 3<br>日   | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 37.88 | 34.87 | 46    | 1,742.48  | 1,604.02  | - |
| 603293 | 埃泰克  | 2026<br>年 4<br>月 9<br>日   | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 33.49 | 33.93 | 72    | 2,411.28  | 2,442.96  | - |
| 603352 | 至信股份 | 2026<br>年 1<br>月 8<br>日   | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 21.88 | 25.52 | 112   | 2,450.56  | 2,858.24  | - |
| 603435 | 嘉德   | 2026<br>年 5               | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 15.76 | 46.71 | 104   | 1,639.04  | 4,857.84  | - |

|        |                  |                          |      |          |       |          |       |           |            |   |
|--------|------------------|--------------------------|------|----------|-------|----------|-------|-----------|------------|---|
|        | 利                | 月 15<br>日                |      |          |       |          |       |           |            |   |
| 603459 | 红<br>板<br>科<br>技 | 2026<br>年 3<br>月 31<br>日 | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 17.70 | 84.32    | 330   | 5,841.00  | 27,825.60  | - |
| 688785 | 恒<br>运<br>昌      | 2026<br>年 1<br>月 20<br>日 | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 92.18 | 463.15   | 116   | 10,692.88 | 53,725.40  | - |
| 688797 | 臻<br>宝<br>科<br>技 | 2026<br>年 6<br>月 16<br>日 | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 44.56 | 468.67   | 207   | 9,223.92  | 97,014.69  | - |
| 688808 | 联<br>讯<br>仪<br>器 | 2026<br>年 4<br>月 16<br>日 | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 81.88 | 1,584.33 | 163   | 13,346.44 | 258,245.79 | - |
| 688816 | 易<br>思<br>维      | 2026<br>年 2<br>月 4<br>日  | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 55.95 | 57.10    | 177   | 9,903.15  | 10,106.70  | - |
| 688820 | 盛<br>合<br>晶<br>微 | 2026<br>年 4<br>月 13<br>日 | 6 个月 | 新股<br>锁定 | 19.68 | 141.49   | 1,137 | 22,376.16 | 160,874.13 | - |

#### 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同责任，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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                      | 38,530,013.70            |
| AAA 以下 | 15,814,400.00          | 33,710,145.55            |
| 未评级    | -                      | -                        |
| 合计     | 15,814,400.00          | 72,240,159.25            |

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<br>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              | 99,697,661.33 | -     | -             | -    | -    | -              | 99,697,661.33  |
| 结算备付金             | 32,728,708.98 | -     | -             | -    | -    | -              | 32,728,708.98  |
| 交易性金融资产           | -             | -     | 15,814,400.00 | -    | -    | 516,199,178.99 | 532,013,578.99 |
| 买入返售金融            | 56,992,000.00 | -     | -             | -    | -    | -              | 56,992,000.00  |

|                          |                |        |               |               |       |                |                  |
|--------------------------|----------------|--------|---------------|---------------|-------|----------------|------------------|
| 资产                       | 0              |        |               |               |       |                | 0                |
| 应收股利                     | -              | -      | -             | -             | -     | -117,385.93    | 117,385.93       |
| 应收申购款                    | 10,102.38      | -      | -             | -             | -     | -135,587.71    | 145,690.09       |
| 资产总计                     | 189,428,472.69 | -      | 15,814,400.00 | -             | -     | 516,452,152.63 | 721,695,025.32   |
| 负债                       |                |        |               |               |       |                |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -      | -             | -             | -     | 4,546,408.09   | 4,546,408.09     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -      | -             | -             | -     | -726,387.94    | 726,387.94       |
| 应付托管费                    | -              | -      | -             | -             | -     | -123,803.98    | 123,803.98       |
| 应付销售服务费                  | -              | -      | -             | -             | -     | -142,176.55    | 142,176.55       |
| 应交税费                     | -              | -      | -             | -             | -     | 2,328.39       | 2,328.39         |
| 其他负债                     | -              | -      | -             | -             | -     | 3,679,397.50   | 3,679,397.50     |
| 负债总计                     | -              | -      | -             | -             | -     | 9,220,502.45   | 9,220,502.45     |
| 利率敏感度缺口                  | 189,428,472.69 | -      | 15,814,400.00 | -             | -     | 507,231,650.18 | 712,474,522.87   |
| 上年度末<br>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                     | 130,712,425.15 | -      | -             | -             | -     | -              | 130,712,425.15   |
| 结算备付金                    | 32,628,325.63  | -      | -             | -             | -     | -              | 32,628,325.63    |
| 交易性金融资产                  | -              | -      | 42,875,575.34 | 29,364,583.91 | -     | 618,960,304.23 | 691,200,463.48   |
| 买入返售金融资产                 | 150,075,000.00 | -      | -             | -             | -     | -              | 150,075,000.00   |
| 应收申购款                    | 24,150.84      | -      | -             | -             | -     | -862,508.37    | 886,659.21       |
| 资产总计                     | 313,439,901.62 | -      | 42,875,575.34 | 29,364,583.91 | -     | 619,822,812.60 | 1,005,502,873.47 |
| 负债                       |                |        |               |               |       |                |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -      | -             | -             | -     | 64,196,903.17  | 64,196,903.17    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -      | -             | -             | -     | 1,013,350.96   | 1,013,350.96     |
| 应付托管费                    | -              | -      | -             | -             | -     | -172,012.16    | 172,012.16       |
| 应付销售服务费                  | -              | -      | -             | -             | -     | -222,714.99    | 222,714.99       |
| 应交税费                     | -              | -      | -             | -             | -     | 2,803.17       | 2,803.17         |

|         |                |   |               |               |   |                |                |
|---------|----------------|---|---------------|---------------|---|----------------|----------------|
| 其他负债    | -              | - | -             | -             | - | 2,993,664.51   | 2,993,664.51   |
| 负债总计    | -              | - | -             | -             | - | 68,601,448.96  | 68,601,448.96  |
| 利率敏感度缺口 | 313,439,901.62 | - | 42,875,575.34 | 29,364,583.91 | - | 551,221,363.64 | 936,901,424.51 |

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）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 31,419.43                   | 151,607.62             |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -31,295.08                  | -150,908.96            |

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<br>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  | -                      | 21,539,511.02 | -         | 21,539,511.02 |
| 资产合计     | -                      | 21,539,511.02 | -         | 21,539,511.02 |
| 以外币计价的   |                        |               |           |               |

|                       |                          |               |               |               |
|-----------------------|--------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 负债                    |                          |               |               |               |
| 负债合计                  | -                        | -             | -             | -             |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | 21,539,511.02 | -             | 21,539,511.02 |
| 项目                    | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |               |               |               |
|                       | 美元<br>折合人民<br>币          | 港币<br>折合人民币   | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |               |               |               |
| 交易性金融资<br>产           | -                        | 29,984,379.08 | -             | 29,984,379.08 |
| 资产合计                  | -                        | 29,984,379.08 | -             | 29,984,379.08 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |               |               |               |
| 负债合计                  | -                        | -             | -             | -             |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | 29,984,379.08 | -             | 29,984,379.08 |

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<br>动      | 对资产负债表日基金资产净值的<br>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<br>升值 5% | 1,076,975.55                    | 1,499,218.95           |
|    | 2、港币相对人民币<br>贬值 5% | -1,076,975.55                   | -1,499,218.95          |

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<br>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025年12月31日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 516,199,178.99         | 72.45            | 618,960,304.23      | 66.06            |
| 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            | 516,199,178.99         | 72.45            | 618,960,304.23      | 66.06            |

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<br>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%       | 21,874,379.90                   | 22,615,098.41          |
|    | 2. 沪深 300 指数下降 5%       | -21,874,379.90                  | -22,615,098.41         |

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 530,889,531.91         | 690,905,311.57           |
| 第二层次          | 262,455.60             | -                        |
| 第三层次          | 861,591.48             | 295,151.91               |
| 合计            | 532,013,578.99         | 691,200,463.48           |

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              | 516,199,178.99 | 71.53        |
|    | 其中：股票             | 516,199,178.99 | 71.53        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 15,814,400.00  | 2.19         |
|    | 其中：债券             | 15,814,400.00  | 2.19         |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | 56,992,000.00  | 7.90         |
|    | 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      | 132,426,370.31 | 18.35        |
| 8  | 其他各项资产            | 263,076.02     | 0.04         |
| 9  | 合计                | 721,695,025.32 | 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 21,539,511.02 元人民币，占期末基金资产净值比例 3.02%。

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         | 4,243,626.00   | 0.60         |
| B  | 采矿业              | 6,878,667.82   | 0.97         |
| C  | 制造业              | 294,799,590.31 | 41.38        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,064,335.60   | 0.43         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 23,747,346.00  | 3.33         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,437,358.46   | 0.20         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 106,780,807.18 | 14.99        |
| J  | 金融业              | 29,205,668.00  | 4.10         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业          | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业      | 21,075,497.60  | 2.96  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 2,945,220.00   | 0.41  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 481,551.00     | 0.07  |
| 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            | 494,659,667.97 | 69.43 |

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  | -             | -            |
| 20 工业   | 368,732.80    | 0.05         |
| 25 可选消费 | 15,656,929.74 | 2.20         |
| 30 主要消费 | -             | -            |
| 35 医药卫生 | 1,871,394.00  | 0.26         |
| 40 金融   | -             | -            |
| 45 信息技术 | 2,735,544.80  | 0.38         |
| 50 通信服务 | 906,909.68    | 0.13         |
| 55 公用事业 | -             | -            |
| 60 房地产  | -             | -            |
| 合计      | 21,539,511.02 | 3.02         |

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 | 2,398,800 | 40,659,660.00 | 5.71         |
| 2  | 300494 | 盛天网络 | 3,782,200 | 31,883,946.00 | 4.48         |
| 3  | 603997 | 继峰股份 | 2,539,500 | 30,042,285.00 | 4.22         |
| 4  | 300791 | 仙乐健康 | 1,850,000 | 29,637,000.00 | 4.16         |
| 5  | 601878 | 浙商证券 | 2,696,500 | 25,616,750.00 | 3.60         |
| 6  | 600998 | 九州通  | 5,063,400 | 23,747,346.00 | 3.33         |
| 7  | 688484 | 南芯科技 | 392,182   | 22,154,361.18 | 3.11         |
| 8  | 600460 | 士兰微  | 341,200   | 18,649,992.00 | 2.62         |
| 9  | 300566 | 激智科技 | 502,300   | 18,559,985.00 | 2.61         |
| 10 | 002609 | 捷顺科技 | 2,416,900 | 18,416,778.00 | 2.58         |
| 11 | 002415 | 海康威视 | 458,500   | 15,680,700.00 | 2.20         |
| 12 | 002475 | 立讯精密 | 207,700   | 14,622,080.00 | 2.05         |
| 13 | 688798 | 艾为电子 | 187,744   | 13,765,390.08 | 1.93         |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 14 | 601012 | 隆基绿能   | 1,014,600 | 13,311,552.00 | 1.87 |
| 15 | 09988  | 阿里巴巴-W | 141,000   | 11,370,930.90 | 1.60 |
| 16 | 300083 | 创世纪    | 781,770   | 10,647,707.40 | 1.49 |
| 17 | 002959 | 小熊电器   | 299,200   | 9,490,624.00  | 1.33 |
| 18 | 002027 | 分众传媒   | 1,886,000 | 9,128,240.00  | 1.28 |
| 19 | 300525 | 博思软件   | 1,115,100 | 8,296,344.00  | 1.16 |
| 20 | 600570 | 恒生电子   | 389,500   | 8,253,505.00  | 1.16 |
| 21 | 688396 | 华润微    | 76,592    | 7,471,549.60  | 1.05 |
| 22 | 300226 | 上海钢联   | 450,960   | 6,904,197.60  | 0.97 |
| 23 | 300653 | 正海生物   | 470,000   | 6,749,200.00  | 0.95 |
| 24 | 300413 | 芒果超媒   | 456,100   | 6,672,743.00  | 0.94 |
| 25 | 688099 | 晶晨股份   | 62,180    | 6,398,322.00  | 0.90 |
| 26 | 300796 | 贝斯美    | 1,000,000 | 6,290,000.00  | 0.88 |
| 27 | 603025 | 大豪科技   | 450,000   | 6,138,000.00  | 0.86 |
| 28 | 002011 | 盾安环境   | 553,600   | 5,873,696.00  | 0.82 |
| 29 | 002841 | 视源股份   | 154,900   | 5,348,697.00  | 0.75 |
| 30 | 300662 | 科锐国际   | 297,000   | 5,043,060.00  | 0.71 |
| 31 | 301039 | 中集车辆   | 709,900   | 5,004,795.00  | 0.70 |
| 32 | 300161 | 华中数控   | 170,500   | 4,964,960.00  | 0.70 |
| 33 | 300383 | 光环新网   | 378,200   | 4,704,808.00  | 0.66 |
| 34 | 600782 | 新钢股份   | 1,731,500 | 4,294,120.00  | 0.60 |
| 35 | 300761 | 立华股份   | 258,600   | 4,243,626.00  | 0.60 |
| 36 | 600547 | 山东黄金   | 169,600   | 3,916,064.00  | 0.55 |
| 37 | 000725 | 京东方 A  | 449,400   | 3,900,792.00  | 0.55 |
| 38 | 600966 | 博汇纸业   | 783,300   | 3,744,174.00  | 0.53 |
| 39 | 300059 | 东方财富   | 176,100   | 3,588,918.00  | 0.50 |
| 40 | 000938 | 紫光股份   | 111,000   | 3,203,460.00  | 0.45 |
| 41 | 603018 | 华设集团   | 573,000   | 2,945,220.00  | 0.41 |
| 42 | 600583 | 海油工程   | 581,800   | 2,926,454.00  | 0.41 |
| 43 | 601619 | 嘉泽新能   | 651,600   | 2,801,880.00  | 0.39 |
| 44 | 03888  | 金山软件   | 142,000   | 2,735,544.80  | 0.38 |
| 45 | 688320 | 禾川科技   | 63,973    | 2,651,680.85  | 0.37 |
| 46 | 02015  | 理想汽车-W | 65,300    | 2,613,488.84  | 0.37 |
| 47 | 002705 | 新宝股份   | 174,700   | 1,935,676.00  | 0.27 |
| 48 | 01789  | 爱康医疗   | 420,000   | 1,871,394.00  | 0.26 |
| 49 | 603298 | 杭叉集团   | 73,100    | 1,744,166.00  | 0.24 |
| 50 | 300911 | 亿田智能   | 71,500    | 1,519,375.00  | 0.21 |
| 51 | 601333 | 广深铁路   | 522,100   | 1,435,775.00  | 0.20 |
| 52 | 02333  | 长城汽车   | 180,000   | 1,377,342.00  | 0.19 |
| 53 | 603338 | 浙江鼎力   | 30,500    | 1,296,250.00  | 0.18 |
| 54 | 603915 | 国茂股份   | 81,500    | 1,156,485.00  | 0.16 |
| 55 | 688108 | 赛诺医疗   | 59,213    | 1,097,216.89  | 0.15 |
| 56 | 603712 | 七一二    | 81,000    | 1,044,090.00  | 0.15 |

|    |        |       |         |            |      |
|----|--------|-------|---------|------------|------|
| 57 | 600166 | 福田汽车  | 325,300 | 946,623.00 | 0.13 |
| 58 | 002092 | 中泰化学  | 175,200 | 671,016.00 | 0.09 |
| 59 | 603711 | 香飘飘   | 58,900  | 654,379.00 | 0.09 |
| 60 | 688677 | 海泰新光  | 6,379   | 645,108.27 | 0.09 |
| 61 | 301459 | 丰茂股份  | 17,600  | 544,544.00 | 0.08 |
| 62 | 00772  | 阅文集团  | 30,200  | 496,276.60 | 0.07 |
| 63 | 000035 | 中国天楹  | 99,700  | 481,551.00 | 0.07 |
| 64 | 00700  | 腾讯控股  | 1,100   | 410,633.08 | 0.06 |
| 65 | 02866  | 中远海发  | 488,000 | 368,732.80 | 0.05 |
| 66 | 06862  | 海底捞   | 32,000  | 295,168.00 | 0.04 |
| 67 | 001248 | 华润新能源 | 25,960  | 262,455.60 | 0.04 |
| 68 | 688808 | 联讯仪器  | 163     | 258,245.79 | 0.04 |
| 69 | 688820 | 盛合晶微  | 1,137   | 160,874.13 | 0.02 |
| 70 | 688797 | 臻宝科技  | 207     | 97,014.69  | 0.01 |
| 71 | 001399 | 惠科股份  | 3,276   | 90,843.48  | 0.01 |
| 72 | 688785 | 恒运昌   | 116     | 53,725.40  | 0.01 |
| 73 | 001257 | 盛龙股份  | 1,743   | 36,149.82  | 0.01 |
| 74 | 603459 | 红板科技  | 330     | 27,825.60  | 0.00 |
| 75 | 001365 | 天海电子  | 719     | 22,511.89  | 0.00 |
| 76 | 001237 | 惠康科技  | 285     | 16,740.90  | 0.00 |
| 77 | 301669 | 高特电子  | 546     | 15,506.40  | 0.00 |
| 78 | 301687 | 新广益   | 195     | 15,167.10  | 0.00 |
| 79 | 001393 | 维通利   | 387     | 15,089.13  | 0.00 |
| 80 | 301531 | 春光集团  | 290     | 14,952.40  | 0.00 |
| 81 | 601112 | 振石股份  | 767     | 13,491.53  | 0.00 |
| 82 | 001369 | 双欣材料  | 897     | 12,127.44  | 0.00 |
| 83 | 688816 | 易思维   | 177     | 10,106.70  | 0.00 |
| 84 | 601026 | 道生天合  | 451     | 6,575.58   | 0.00 |
| 85 | 603435 | 嘉德利   | 104     | 4,857.84   | 0.00 |
| 86 | 603352 | 至信股份  | 112     | 2,858.24   | 0.00 |
| 87 | 603293 | 埃泰克   | 72      | 2,442.96   | 0.00 |
| 88 | 603284 | 林平发展  | 46      | 1,604.02   | 0.00 |
| 89 | 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  | 600999 | 招商证券 | 21,924,465.80 | 2.34           |
| 2  | 688484 | 南芯科技 | 21,001,655.34 | 2.24           |
| 3  | 300776 | 帝尔激光 | 19,072,435.80 | 2.04           |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 4  | 601012 | 隆基绿能   | 18,193,941.00 | 1.94 |
| 5  | 09988  | 阿里巴巴-W | 13,864,346.98 | 1.48 |
| 6  | 688798 | 艾为电子   | 13,270,114.96 | 1.42 |
| 7  | 600460 | 士兰微    | 13,242,133.00 | 1.41 |
| 8  | 600570 | 恒生电子   | 12,497,686.00 | 1.33 |
| 9  | 300413 | 芒果超媒   | 9,859,771.00  | 1.05 |
| 10 | 300566 | 激智科技   | 9,716,992.74  | 1.04 |
| 11 | 300226 | 上海钢联   | 9,474,715.00  | 1.01 |
| 12 | 300059 | 东方财富   | 9,317,551.00  | 0.99 |
| 13 | 300083 | 创世纪    | 8,254,697.50  | 0.88 |
| 14 | 002475 | 立讯精密   | 7,644,513.00  | 0.82 |
| 15 | 300761 | 立华股份   | 7,345,804.00  | 0.78 |
| 16 | 002011 | 盾安环境   | 6,028,692.00  | 0.64 |
| 17 | 600782 | 新钢股份   | 6,011,369.87  | 0.64 |
| 18 | 688099 | 晶晨股份   | 5,993,622.30  | 0.64 |
| 19 | 301039 | 中集车辆   | 5,642,401.96  | 0.60 |
| 20 | 300383 | 光环新网   | 5,247,663.00  | 0.56 |

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   | 72,216,531.00 | 7.71           |
| 2  | 300776 | 帝尔激光   | 45,055,041.33 | 4.81           |
| 3  | 603688 | 石英股份   | 33,344,154.00 | 3.56           |
| 4  | 600999 | 招商证券   | 29,937,968.55 | 3.20           |
| 5  | 600163 | 中闽能源   | 27,703,911.96 | 2.96           |
| 6  | 688677 | 海泰新光   | 27,508,256.60 | 2.94           |
| 7  | 002092 | 中泰化学   | 23,566,743.00 | 2.52           |
| 8  | 603000 | 人民网    | 17,836,000.00 | 1.90           |
| 9  | 000725 | 京东方 A  | 16,500,842.00 | 1.76           |
| 10 | 600893 | 航发动力   | 13,532,509.00 | 1.44           |
| 11 | 688099 | 晶晨股份   | 13,063,864.45 | 1.39           |
| 12 | 06862  | 海底捞    | 11,918,220.55 | 1.27           |
| 13 | 002061 | 浙江交科   | 11,243,497.00 | 1.20           |
| 14 | 300662 | 科锐国际   | 10,982,445.00 | 1.17           |
| 15 | 002897 | 意华股份   | 10,468,360.00 | 1.12           |
| 16 | 601866 | 中远海发   | 5,934,730.00  | 0.63           |
| 16 | 02866  | 中远海发   | 3,378,727.18  | 0.36           |
| 17 | 603888 | 新华网    | 7,752,046.10  | 0.83           |
| 18 | 02057  | 中通快递-W | 6,986,187.55  | 0.75           |
| 19 | 002415 | 海康威视   | 6,698,520.00  | 0.71           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 20 | 300661 | 圣邦股份 | 6,528,123.00 | 0.70 |
|----|--------|------|--------------|------|

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 | 317,850,464.30 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 476,140,883.81 |

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      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 15,814,400.00 | 2.22         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 15,814,400.00 | 2.22         |

### 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  | 123113 | 仙乐转债 | 140,000 | 15,814,400.00 | 2.22         |

### 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原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。本基金将

选择流动性好、交易活跃的期货合约，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。

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将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。本基金将选择流动性好、交易活跃的期货合约，并与债券现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末进行国债期货投资。

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，上海南芯半导体科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海市公安局浦东分局的处罚。

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 | -          |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | 117,385.93 |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 145,690.09 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 263,076.02 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 123113 | 仙乐转债 | 15,814,400.00 | 2.22         |

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<br>户数<br>（户） | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>（%） | 持有份额           | 占总<br>份额<br>比例<br>（%） |
| 东方红核<br>心价值混<br>合A | 2,843            | 115,124.62    | 71,977,387.09  | 21.99             | 255,321,911.37 | 78.01                 |
| 东方红核<br>心价值混<br>合C | 2,780            | 101,307.49    | 143,267,027.64 | 50.87             | 138,367,783.60 | 49.13                 |
| 合计                 | 5,623            | 108,293.46    | 215,244,414.73 | 35.35             | 393,689,694.97 | 64.65                 |

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（%） | 93.63                                |

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 | 东方红核心价值混合 A | 4,347,657.76 | 1.33        |
|                  | 东方红核心价值混合 C | 4,443,794.20 | 1.58        |
|                  | 合计          | 8,791,451.96 | 1.44        |

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 | 东方红核心价值混合 A | >100              |
|                                | 东方红核心价值混合 C | >100              |
|                                | 合计          | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 东方红核心价值混合 A | 50~100            |
|                                | 东方红核心价值混合 C | 0                 |
|                                | 合计          | 50~100            |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                    | 东方红核心价值混合 A    | 东方红核心价值混合 C    |
|---------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>（2025 年 6 月 6 日）<br>基金份额总额 | 996,779,607.46 | 994,576,938.79 |
| 本报告期期初基金<br>份额总额                      | 432,492,703.83 | 416,600,859.23 |
| 本报告期基金总申<br>购份额                       | 200,022,124.39 | 55,480,764.47  |
| 减：本报告期基金总<br>赎回份额                     | 305,215,529.76 | 190,446,812.46 |
| 本报告期基金拆分<br>变动份额                      | -              | -              |
| 本报告期期末基金                              | 327,299,298.46 | 281,634,811.24 |

|      |  |  |
|------|--|--|
| 份额总额 |  |  |
|------|--|--|

§ 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。  
报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。  
报告期内，无涉及本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：报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 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 (%) |    |
| 东方证券  | 2      | 626,760,566.57 | 79.09            | 280,662.78 | 77.09          | -  |
| 金融街证券 | 2      | 165,711,993.82 | 20.91            | 83,392.00  | 22.91          | -  |
| 国泰海通  | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 华泰证券  | 3      | -              | -                | -          | -              | -  |

注：1、本基金采用委托证券公司办理交易模式，不适用单个证券公司交易佣金的比例限制，上述数据为本基金通过相应证券公司办理交易的相关数据。

#### 2、证券公司的选择标准和程序

##### (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，与其签订经纪服务协议。

3、本基金本报告期内委托办理交易的证券公司无变更。

### 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 (%) |
| 东方证券  | 55,247,636.36 | 100.00           | 56,992,000.00 | 100.00             | -    | -                |
| 金融街证券 | -             | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 国泰海通  | -             | -                | -             | -                  | -    | -                |
| 华泰证券  | -             | -                | -             | -                  | -    | -                |

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  | 东方红核心价值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 |
| 2  | 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 |
| 3  | 东方红核心价值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 |
| 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 3 月 31 日 |
| 5  | 东方红核心价值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 |
| 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 5 月 21 日 |
| 7  | 东方红核心价值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 5 月 22 日 |
| 8  | 东方红核心价值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 5 月 22 日 |
| 9  | 东方红核心价值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 5 月 22 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核心价值混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红核心价值混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《东方红核心价值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](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2026 年 8 月 31 日