

东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资  
基金  
2025 年第 3 季度报告

2025 年 9 月 30 日

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 10 月 28 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2025 年 07 月 01 日起至 2025 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 东方红民享甄选一年持有混合                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金主代码      | 014291                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置 1 年锁定持有期                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金合同生效日    | 2022 年 5 月 10 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 报告期末基金份额总额 | 34,192,993.86 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资目标       | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资策略       | 本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略，在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略努力实现基金资产的稳定增值。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。在固定收益类投资策略方面，本基金将综合运用普通债券投资策略，信用债投资策略，可转换公司债券、可分离交易可转换债券和可交换债的投资策略，资产支持证券投资策略，债券回购杠杆策略及证券公司短期公司债券投资策略。在权益类投资策略方面，本基金将综合运用行业配置策略、个股选择策略、港股投资策略、存托凭证等投资策略。除此之外，本基金还会运用股指期货投资策略、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、参与融资业务策略等进行投资。 |
| 业绩比较基准     | 中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×2%。                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 风险收益特征     | 本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。<br>本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险                                                                                                                                                                                                                  |

|       |                                                        |
|-------|--------------------------------------------------------|
|       | 等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |
| 基金管理人 | 上海东方证券资产管理有限公司                                         |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司                                           |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2025 年 7 月 1 日-2025 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 1,592,624.31                        |
| 2. 本期利润         | 2,516,331.27                        |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0715                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 40,174,012.24                       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1749                              |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 6.48%      | 0.23%         | 0.21%          | 0.09%                 | 6.27%  | 0.14% |
| 过去六个月          | 7.16%      | 0.37%         | 1.38%          | 0.09%                 | 5.78%  | 0.28% |
| 过去一年           | 11.88%     | 0.48%         | 2.39%          | 0.12%                 | 9.49%  | 0.36% |
| 过去三年           | 17.99%     | 0.39%         | 7.45%          | 0.11%                 | 10.54% | 0.28% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 17.49%     | 0.37%         | 7.85%          | 0.11%                 | 9.64%  | 0.26% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方红民享甄选一年持有混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务                      | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|----|-------------------------|-----------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                         | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 胡伟 | 上海东方证券资产管理有限公司副总经理、基金经理 | 2022 年 5 月 10 日 | —    | 21 年   | 上海东方证券资产管理有限公司副总经理、基金经理，2020 年 05 月至 2024 年 03 月任东方红收益增强债券型证券投资基金基金经理、2020 年 05 月至 2024 年 03 月任东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金基金经理、2020 年 06 月至今任东方红品质优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 06 月至 2024 年 04 月任东方红匠心甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 09 月至今任东方红招盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2021 年 01 月至今任东方红锦丰优选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2021 年 07 月至 2024 年 04 月任东方红安盈甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 01 月至今任东方红锦弘甄选两年持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 02 月至今任东方红招瑞甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金经理、2022 年 05 月至今任东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金基 |

|    |                    |                 |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|----|--------------------|-----------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                    |                 |   |      | 金经理、2024 年 08 月至今任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理。中南财经政法大学经济学学士。曾任珠海市商业银行资金营运部债券交易员，华富基金管理有限公司债券交易员，固定收益部基金经理、副总监、总监，总经理助理，上海东方证券资产管理有限公司总经理助理。具备证券投资基金从业资格。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 徐觅 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理 | 2022 年 5 月 10 日 | - | 18 年 | 上海东方证券资产管理有限公司基金经理，2016 年 12 月至今任东方红益鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至 2023 年 04 月任东方红汇利债券型证券投资基金基金经理、2017 年 08 月至 2023 年 04 月任东方红汇阳债券型证券投资基金基金经理、2017 年 09 月至 2024 年 03 月任东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、2017 年 09 月至 2020 年 05 月任东方红货币市场基金基金经理、2018 年 03 月至今任东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018 年 05 月至 2024 年 03 月任东方红配置精选混合型证券投资基金基金经理、2018 年 10 月至 2025 年 08 月任东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2020 年 01 月至 2024 年 04 月任东方红安鑫甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2020 年 07 月至 2022 年 11 月任东方红益丰纯债债券型证券投资基金基金经理、2022 年 05 月至今任东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理、2023 年 11 月至今任东方红 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理、2023 年 12 月至今任东方红季鑫 90 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理、2024 年 01 月至今任东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2025 年 01 月至今任东方红 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理、2025 年 08 月至今任东方红 30 天滚动持有纯债债券型证券投资基金基金经理。复旦大学工商管理硕士。曾任长信基金管理有限责任公司基金事务部基金会计、交易管理部债券交易员，广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员，富国基金管理有限公 |

|  |  |  |  |  |                                               |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 司固定收益部基金经理助理，上海东方证券资产管理有限公司投资经理。具备证券投资基金从业资格。 |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------|

注：1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日（转型基金为初始基金合同生效日），“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对此后非首任基金经理，基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

权益方面，三季度上证指数上涨 12.73%，沪深 300 上涨 17.9%，创业板指上涨 50.4%，中证 500 上涨 25.31%，中证 800 上涨 19.83%，中证 1000 上涨 19.17%。通信、电子、电力设备、有色板块涨幅居前，超 40%；银行板块跌幅超 10%。港股表现弱于 A 股，恒生指数上涨 11.56%，恒生科技上涨 21.93%。7 至 8 月市场趋势上涨，受政策预期升温及流动性推动，市场风险偏好显著提

升；8月底至9月，市场进入震荡整固阶段，成交量维持高位。经过4月美国所谓“对等关税”压力测试后，市场系统性下行风险下降的预期较为一致。虽然三季度基本面偏弱，但在“反内卷”政策促发下，市场表现超预期强势，且稳定性提升、波动率降低，从而带来股票资产吸引力的提升。展望四季度，制造业投资和地产投资仍将偏弱，非美出口表现强势一定程度上延缓了出口下行的速度，但“抢出口”效应消退后外需仍面临回落压力。而当前内需表现仍弱，消费修复动能不足，需要依靠财政支撑。四季度基本面或延续回落，但完成全年经济增长目标压力不大。中美关税谈判进程虽有不确定性，但整体朝着积极方向发展。在此背景下，国内政策发力的紧迫性下降，基本面与政策博弈的预期仍在。值得关注的是虽然当前“反内卷”的供给侧的措施并不能解决需求端的问题，但国内工业品价格长期处于底部之后，其一定程度的改善或带动企业利润修复，从而或带来中长期的盈利向上。因此，四季度市场或延续震荡格局，中长期来看或将呈现震荡向上的趋势。经过三季度风格表现极度分化后，四季度或存在风格再平衡的可能。在配置方向上，将继续聚焦受益于供给侧优化且具备盈利修复弹性的领域，重点关注高端制造、新能源产业链以及科技成长板块的结构性机会。同时，随着市场估值中枢上移，对业绩确定性强、股息率较高的优质蓝筹资产也将保持适度配置。对于港股，在流动性改善与企业盈利触底回升的双重驱动下，估值修复空间仍存。

转债方面，三季度中证转债指数上涨9.43%，转债估值进一步抬升，转股溢价率处于历史较高水平，市场对正股上涨预期较为乐观。转债相比正股的性价比进一步下降，需要关注转债后续波动放大的概率增加。本产品在前期上涨、估值修复中对一些高价、高估值标的进行了兑现，继续降低了组合的转债配置比例，后续仍然会对市场保持密切跟踪，关注市场变化，适时精选一些优质转债进行配置。

债券方面，三季度收益率整体上行：7月受“反内卷”政策驱动，商品期货普涨，带动10Y国债收益率从期初1.64%上行至1.75%；后续权益市场接力上涨，市场风险偏好显著提振，债券收益率再度上行至1.90%年内高位，至季末稍有回落，收于1.86%。货币政策方面本季度维持“适度宽松”基调，流动性整体保持宽松，月度均实现净投放。但受权益市场走强和北交所打新全额冻结资金影响，月中资金利率波动较大。财政政策继续发力，以旧换新补贴持续推进，新设5000亿元新型政策性金融工具用于补充项目资本金，保持了对实体经济的支持力度。本季度组合维持了国债的持仓，久期方面调整幅度较大，降低了长久期利率债仓位，从季初7年左右降至季末3.2年左右。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为1.1749元，份额累计净值为1.1749元。本报告期基金

份额净值增长率为 6.48%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内（2025 年 7 月 1 日-2025 年 9 月 30 日），本基金持续处于基金资产净值低于五千万元的情形；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的情形。本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人已向中国证监会报告，并提出就本基金持续运作事项召集持有人大会表决的解决方案。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 8,382,288.29  | 20.85        |
|    | 其中：股票             | 8,382,288.29  | 20.85        |
| 2  | 基金投资              | —             | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 26,413,220.50 | 65.69        |
|    | 其中：债券             | 26,413,220.50 | 65.69        |
|    | 资产支持证券            | —             | —            |
| 4  | 贵金属投资             | —             | —            |
| 5  | 金融衍生品投资           | —             | —            |
| 6  | 买入返售金融资产          | —             | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —             | —            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 5,405,664.68  | 13.44        |
| 8  | 其他资产              | 10,194.53     | 0.03         |
| 9  | 合计                | 40,211,368.00 | 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 4,043,168.57 元人民币，占期末基金资产净值比例 10.06%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —            | —            |
| B  | 采矿业              | —            | —            |
| C  | 制造业              | 3,518,167.40 | 8.76         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —            | —            |

|   |                 |              |       |
|---|-----------------|--------------|-------|
| E | 建筑业             | —            | —     |
| F | 批发和零售业          | —            | —     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 92,925.00    | 0.23  |
| H | 住宿和餐饮业          | —            | —     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 452,947.32   | 1.13  |
| J | 金融业             | 275,080.00   | 0.68  |
| K | 房地产业            | —            | —     |
| L | 租赁和商务服务业        | —            | —     |
| M | 科学研究和技术服务业      | —            | —     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | —            | —     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | —            | —     |
| P | 教育              | —            | —     |
| Q | 卫生和社会工作         | —            | —     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | —            | —     |
| S | 综合              | —            | —     |
|   | 合计              | 4,339,119.72 | 10.80 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|--------------|--------------|
| 10 能源   | —            | —            |
| 15 原材料  | —            | —            |
| 20 工业   | 387,504.00   | 0.96         |
| 25 可选消费 | 1,484,653.52 | 3.70         |
| 30 主要消费 | —            | —            |
| 35 医药卫生 | —            | —            |
| 40 金融   | 1,073,244.30 | 2.67         |
| 45 信息技术 | 189,808.20   | 0.47         |
| 50 通信服务 | 907,958.55   | 2.26         |
| 55 公用事业 | —            | —            |
| 60 房地产  | —            | —            |
| 合计      | 4,043,168.57 | 10.06        |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股）  | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|--------|------------|--------------|
| 1  | 00700  | 腾讯控股   | 1,500  | 907,958.55 | 2.26         |
| 2  | 09988  | 阿里巴巴-W | 5,300  | 856,466.75 | 2.13         |
| 3  | 002475 | 立讯精密   | 12,100 | 782,749.00 | 1.95         |
| 4  | 002459 | 晶澳科技   | 48,400 | 635,976.00 | 1.58         |
| 5  | 002028 | 思源电气   | 4,200  | 457,884.00 | 1.14         |
| 6  | 688099 | 晶晨股份   | 4,074  | 452,947.32 | 1.13         |

|    |        |          |         |            |      |
|----|--------|----------|---------|------------|------|
| 7  | 603606 | 东方电缆     | 6,100   | 430,904.00 | 1.07 |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药     | 6,000   | 429,300.00 | 1.07 |
| 9  | 03800  | 协鑫科技     | 324,000 | 387,504.00 | 0.96 |
| 10 | 03618  | 重庆农村商业银行 | 70,000  | 384,090.00 | 0.96 |

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

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 26,177,219.13 | 65.16        |
| 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） | 236,001.37    | 0.59         |
| 8  | 同业存单      | —             | —            |
| 9  | 其他        | —             | —            |
| 10 | 合计        | 26,413,220.50 | 65.75        |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019785 | 25 国债 13 | 146,000 | 14,628,876.00 | 36.41        |
| 2  | 019742 | 24 特国 01 | 33,000  | 3,554,875.73  | 8.85         |
| 3  | 019766 | 25 国债 01 | 30,000  | 3,023,193.70  | 7.53         |
| 4  | 019780 | 25 国债 11 | 30,000  | 2,987,706.58  | 7.44         |
| 5  | 019778 | 25 国债 09 | 20,000  | 1,982,567.12  | 4.93         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，以回避市场风险。基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以获取相应股票组合的超额收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 3,695.81 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | 6,488.80 |
| 4  | 应收利息    | -        |

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 5 | 应收申购款 | 9.92      |
| 6 | 其他应收款 | —         |
| 7 | 其他    | —         |
| 8 | 合计    | 10,194.53 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 128119 | 龙大转债 | 236,001.37 | 0.59         |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 37,007,979.24 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 826,691.76    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 3,641,677.14  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —             |
| 报告期期末基金份额总额               | 34,192,993.86 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期，本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期，本基金管理人不存在申购、赎回或交易本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人经与基金托管人协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于持续运作东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金的议案》。会议投票表决时间自 2025 年 9 月 22 日起，至 2025 年 11 月 11 日 17:00 时止。具体内容请见相关公告。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予注册东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金的文件；
- 2、《东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、东方红民享甄选一年持有期混合型证券投资基金财务报表及报表附注；
- 5、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：  
[www.dfham.com](http://www.dfham.com)。

上海东方证券资产管理有限公司

2025 年 10 月 28 日